

# cta策略为什么与股票负相关\_\_为什么CTA策略这么火？- 股识吧

## 一、雁丰多策略基金？CTA策略，阿尔法策略，套利策略怎么样

每个人都知道开飞机得飞行员，做手术得医师。

不过好多人以为人人都可以直接买股票和基金而不需要先学习投资技能。

所以大多数人什么都不懂就买无异于自己去开飞机或给人做手术，后果可想而知。

现实中往往嫉妒别人赚钱后就去跟风接盘早已忘记这些基本常识了。

别说基金有基金经理操盘，基金同样是看天吃饭的，大行情走坏时一样玩完。

说到底，投资必须靠自己的悟性和努力才能稳稳小赚，再加上好运气才能大赚，周期轮回中控制风险排第一，止损的意义可以小亏不能大亏，被动等着大行情来了赚一波就够了。

也可以说谋事在人，成事在天。

CTA策略，阿尔法策略，套利策略等适合于一部分人，每个人必须发现或发明适合自己性情和三观的策略才能很好的去执行，才有立足之地，否则就是别人的韭菜。

## 二、为什么CTA策略这么火？

1、CTA不只是做商品，股指期货的CTA策略可以极低成本地转移到其他资产类别上。

2、对于股票来说，这是个分散投资。

3、CTA可以做量化，风控比较容易理解，策略可以很有效。

趋势交易就是用大量不同的指标寻找当前的市场趋势，然后建立头寸，等待趋势终结，周期可以日内或几周，周期的不同限制资金的使用量，但是趋势是否终结是仓位改变的唯一标准。

所以，你会发现，在牛市中，趋势跟踪策略一点都不少赚，而且在牛市迅速转熊市的过程中，这类基金会非常快的掉头，反手做空，继续赚空头的钱，所以趋势策略在牛熊转换较快或者趋势转换明显的时候，优势非常大。

不像一般的Alpha策略，不怕熊市，怕牛市，趋势类CTA在趋势明显时什么都不怕。

但这策略也有弱点，如果趋势不明显，市场涨涨跌跌，震来震去，那么这种趋势策略就会因为不断止损而亏损很大。

而反趋势交易CTA基金策略这个时候就会盈利，这类策略通常运用价格和交易量等反转指标来发现趋势的转折信号，然后建立头寸。

所以基金经理需要判断，到底用什么策略，没有一成不变的赚钱秘诀。

总之，CTA策略在后股指期货时代(暂时的)，是一个不错的资产配置选择，对于股票投资者来讲，分散投资，不但要分散资产，还要分散策略。

### 三、访问量 cta 点击率注册转化率其中的cta是什么意思

CTA策略研究对象copy：狭义上来说，CTA策略的研究对象只包括期货，像国内的股指期货，大宗商品期货和国债期货（利率期货），这些品种是目前国内CTA策略的主要研究对象和利润来源；

广义上来说，可以是大宗商品期货，国债期货（利率期货），股票，外汇（包括spots和futures），甚至期权等任何有一定历史公开量价数据的品种。

CTA策略研究周期：通常来说，以分钟、小时和日线数据为主。

少部分CTA策略也会用到tick数据，包括level2的bidprice，askprice，bidvolume，askvolume。

CTA策略研究方法：对单个品种历史上的量价数据进行分析，包括开盘价，收盘价，最高价，最低价，成交量，持仓量这些数据，提炼出具有概率优势的规律，这就是通常意义上的因子或者策略，并将此规律用代码实现，并假设这类规律在未来会依然存在。

最后用此类规律来判断品种未来的方向，进行开仓道，平仓，加仓，减仓等操作，并以此来获利。

通常来说，演化至今的CTA策略基本都是全自动交易，但也依然有辅之以手工判断的交易存在。

### 四、CTA策略有什么特点优势?

私募排排网为您解答：CTA是投向于与股市涨跌相关性非常低的期市，所以趋势跟踪策略能够提供与股市最低的相关性。

与其他策略相关性低。

## 五、什么是CTA策略

CTA策略称为商品交易顾问策略，也称作管理期货。

商品交易顾问对商品等投资标的的走势做出预判，通过期货期权等衍生品在投资中进行做多、做空或多空双向的投资操作，为投资者获取来自于传统股票、债券等资产类别之外的投资回报。

趋势交易是通过大量的指标排除市场噪音，设定交易系统，判断当前市场趋势，然后建立头寸，而调整头寸的临界点都是特定计算机算法所规定的。

CTA策略的趋势交易之所以会取得成功，不仅是因为投资者相信市场并非那么有效，更重要的是他们观察到市场是存在趋势的。

事件性影响会导致标的物价值在短期内迅速提升，但其价格却需要一段时间后才提升，之后价格还可能会继续攀升以致超出其价值。

在这期间，趋势跟踪策略就可以买入获利。

扩展资料：CTA策略研究方法：对单个品种历史上的量价数据进行分析，包括开盘价，收盘价，最高价，最低价，成交量，持仓量这些数据，提炼出具有概率优势的规律，这就是通常意义上的因子或者策略，并将此规律用代码实现，并假设这类规律在未来会依然存在。

最后用此类规律来判断品种未来的方向，进行开仓，平仓，加仓，减仓等操作，并以此来获利。

通常来说，演化至今的CTA策略基本都是全自动交易，但也依然有辅之以手工判断的交易存在。

CTA基金更可能是以信托投资的形式出现，收入的主要来源也更可能是盈利分成而非管理费，这一点与现有的证券投资基金不同，更接近于私募基金。

因此，与公募的证券投资基金只有投资者、管理人（基金公司）、托管人（商业银行）三方参与，各方的权利义务相对清晰不同，CTA基金涉及的利益方更多，管理的难度也更大。

这对监管机构也将是一个巨大的挑战。

参考资料：搜狗百科---CTA Fund

## 六、什么是CTA策略？期货CTA哪家做得好？富善致远CTA怎么样

CTA(Commodity Trading Advisors)商品交易顾问，通常也被称作管理期货基金，是由于其最初主要活跃于商品市场。

CTA基金起源于1949年，随着期货交易品种的不断扩展，CTA基金在资产的风险管理与运作方面显得日趋重要，很多机构投资者诸如养老金、信托基金等都开始大量采用CTA作为他们投资组合中的重要组成部分，并在优化组合、分散风险等方面取

得了良好的效果。

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

就投资方法而言，CTA基金有两大类，一类是主观CTA，即由基金管理人基于基本面、调研或操盘经验，主观来判断走势，决定买卖时点；

第二大类是量化CTA，是通过分析建立数量化的交易策略模型，由模型产生的买卖信号进行投资决策。

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

很多人提到CTA基金的主要投资标的——期货，第一反应都是觉得期货带杠杆，风险大，但用量化的方法来投资期货能够在获取收益的同时很好的管理风险。

量化CTA能够很好的避免人为主观的非理性，在出现亏损或回撤时能够及时的止损从而有效的规避风险，同时量化CTA基金能够产生规模效应，这也是在国内乃至海外，量化逐渐成为CTA基金的主流交易方法。

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

Preqin Hedge的数据统计，在海外，2022年80%的CTA基金采用程序化交易，9%采用混合策略，仅11%的基金采用主观分析。

而在国内，根据期货资管网的统计，国内量化CTA占比约5成并呈稳步上扬的势头。

。

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

量化CTA中用的比较多的策略是趋势交易策略，趋势交易就是用大量各种策略模型寻找当前的市场趋势，判断多空；

趋势策略可以说是无惧牛熊，只要有上涨或下跌的行情就能获利。

这种策略特别在牛熊快速转换或者趋势明确时，优势非常大。

总之，趋势在、收益就有。

但如果趋势不明显，或者是震荡市场，那么这种策略可能会因为来回不停的止损而出现回撤。

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

简单来说，量化CTA的收益和投资标的的涨跌无关，他和投资标的的涨幅或者跌幅有关，即在波动率很大的行情中容易获利。

用一个形象的比喻吧，投资标的的波动率是CTA基金获利的心电图，一马平川或者小幅来回震荡贡献不了收益率甚至会出现回撤，而波峰波谷频现大起大落的行情下，CTA就能大幅获利。

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

&nbsp; ;

期货cta做的比较好的有：黑翼，富善，凯丰。

## 七、AB为正相关，为什么A与C时正相关，而B与C却是负相关

这个题要看A是什么函数，假如A是二次函数，即抛物线，而B和C分别是端点在抛物线A对称轴上的两天射线，如图：虽然A与B、A与C正相关，但是B与C负相关。

## 八、举一个资产收益高度正相关和高度负相关的例子。

资产收益高度正相关：高科技产业资产收益高度负相关：夕阳产业

## 参考文档

[下载：cta策略为什么与股票负相关.pdf](#)

[《金融学里投资股票多久是一个周期》](#)

[《证券转股票多久到账》](#)

[《增发股票会跌多久》](#)

[《股票通常会跌多久》](#)

[《退市股票确权申请要多久》](#)

[下载：cta策略为什么与股票负相关.doc](#)

[更多关于《cta策略为什么与股票负相关》的文档...](#)

声明：

本文来自网络，不代表

【股识吧】立场，转载请注明出处：

<https://www.gupiaozhishiba.com/subject/63260886.html>