

“量化交易”这个词语对于接触过金融市场交易的许多投资者来说想必或多或少都了解一些。但是部分投资者对于它的具体涵义并没有形成清晰的认知框架。这篇帖子旨在帮助诸位梳理思路。

一、定义

量化交易是指以先进的数学模型替代人为的主观判断，利用计算机技术从庞大的历史数据中海选能带来超额收益的多种“大概率”事件以制定策略，进而交易的过程。（注:来源于百度词条）

二、具体阐释

量化交易是对立于主观交易的一个概念，其本质在于将交易逻辑付诸于程序化。交易逻辑的形成可以来源于数学思想、统计模型、价格形态、甚至一些古代玄学；程序化则是指利用计算机技术实现交易逻辑的自动执行，它区别于手动交易。

三、举例说明（以期货市场为例）

1、确定交易逻辑

主题思路：均线突破

开仓思路：

日内即时行情上穿加权平均线上一个单位价格触发买入下单；日内即时行情下穿加权平均线下一个单位价格触发空单开仓。

止损思路：即时行情下穿加权平均线，触发多仓平仓；空单反之操作。

止盈思路：

挖掘投资标的历史数据，统计上穿和下穿后各自的平均波幅，以此确定止盈空间。

仓位管理：略

2、编写程序化策略

这部分根据个人习惯的编程语言而定，比如Python，可以利用Pands包或者Talib包。

3、回测

利用历史数据检验策略的过去表现，并不断调整完善交易策略。

4、实盘

许多量化平台都提供实盘接口，按照其交易规则操作即可。如果策略对于延迟要求高的话，可以找交易所申请机房托管，但是对投资者的资金量要求比较高；当然，也可以找自己期货公司申请使用期货公司在交易所的机房资源，要求比前者要低。

5、放弃量化交易

有开玩笑的性质在哈。这部分主要是提醒大家，量化交易并不是说一定能赚取投资收益，它只是一种区别于主观交易的投资方式，只不过在表现形式上更加具有规则性。因此，在选择投资方式时，可以视自己的情况而定。