

## 量化交易可预见的政策性风险、可预见的市场性风险、可预见的操作性风险会有哪些？

产品名称	量化交易可预见的政策性风险、可预见的市场性风险、可预见的操作性风险会有哪些？
公司名称	四川麦芒网络科技有限公司
价格	.00/件
规格参数	
公司地址	绵阳高新区石桥铺跨境电子商务产业园7栋4楼406
联系电话	18380514181 18380514181

## 产品详情

这是一个非常宽泛的问题，虽然量化交易在风险控制方面有优势，但也面临着各种不同的风险。可预见的政策性风险：因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。可预见的市场性风险：如多头一方因持有股票会面对持有股票的一系列风险（价格波动风险、经济环境风险、上市公司经营风险等），而空头部分因持有空头股指期货会面对期货投资的风险（杠杆风险、基差风险、平仓风险等），但正因为多头风险与空头风险可以大部分相互对冲，所以整体风险被控制在一个较安全的水平。可预见的操作性风险：相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，如越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。当然这些可预见的风险，管理人都会提前做规避工作，尽全力做到“风险可控”。

在量化交易中，可预见的政策性风险包括但不限于以下几个方面：

**监管政策变化风险：**政府或监管机构可能会修改相关的法规和政策，例如对交易所规则、交易税收、杠杆比例等进行调整，这可能影响到量化交易策略的运作方式和盈利能力。

**财务政策风险：**政府的财政政策和货币政策的调整可能对市场产生影响，例如通胀率的变化、利率政策的调整等，这会对量化交易策略的盈利能力产生影响。

**地缘政治风险：**国际关系和地缘政治的变化可能导致市场的不稳定性，例如国际贸易争端、地区冲突等，这对量化交易策略的投资标的和市场预期都会造成风险。

可预见的市场性风险包括但不限于以下几个方面：

**市场流动性风险：**市场的交易量和参与者数量可能会发生变化，当市场流动性减少时，可能导致交易执

行困难或成本增加。

市场价格波动风险：市场价格的波动性和波动程度可能会超出量化交易策略的预期，造成交易损失。

市场传导风险：不同市场之间存在联动性，当一个市场出现重大变动时，可能会对其他市场产生连锁反应，这会影响到量化交易策略的投资组合。

市场操纵风险：市场可能存在操纵行为，例如操纵股价、价格操纵等，这可能导致量化交易策略的信号失真或交易执行受阻。