

量化交易系统的构建





科学稳定的交易策略是在市场中存活的前提

市场参与者：

- 1.市场参与者都认为自己能够在市场中获利
- 2.交易人都认为自己可能找到了正确的交易方法
- 3.当盈利的时候会认为自己确定性掌握了正确的投资方法
- 4.当投资出现亏损时坚持前期盈利的方法
- 5.亏损连续出现时会否定前期的方法做出交易策略的调整



投资人为啥大多数会失败

- 1.没有一个正确的方法
- 2.赌徒心理
- 3.依赖他人的建议和小道消息
- 4没有坚持正确的方法

有了系统的方法还是困惑

- 1.没有工具帮助对自己的投资策略进行历史数据的回测
- 2.历史数据的回测方式有误
- 3.不能控制自己的情绪
- 4.从众心理严重
- 5.受外界媒体信息影响



怎么办？



用机器来替代人工刚性的操作交易也许是个不错的选择！



基本步骤：

- 1.首先要把自己的策略思想准确的逻辑描述出来
- 2.选择一个适合自己的量化交易系统平台
- 3.把自己的策略思想写成交易系统的计算机代码
- 4.使用量化交易系统平台对历史数据进行策略测试
- 5.发现缺陷和不足对交易系统进行修改
- 6.对系统的参数进行合理的优化
- 7.进行仿真系统的运行测试
- 8.小额资金使用进入实盘测试
- 9.进入实盘正常运行



策略时量化交易的核心

主观交易时很多投资人是使用的多策略组合

主观交易的许多投资人会随市场运行的不同阶段和市场情绪状况使用不同的交易方式，他们在调整交易策略的时候很多时候是潜意思影响或受账面资金变化的影响，极少是有计划主动的合理运用策略组合的



要把不同的交易策略分解开

01 — 趋势策略

02 — 波动策略

03 — 对冲套利策略



程序化工作

- 01 描述策略的思想
- 02 行情数据的合理取用
- 03 消除静态、动态的差异的方法
- 04 人为规则的针对性描述



程序化交易商业平台的选择

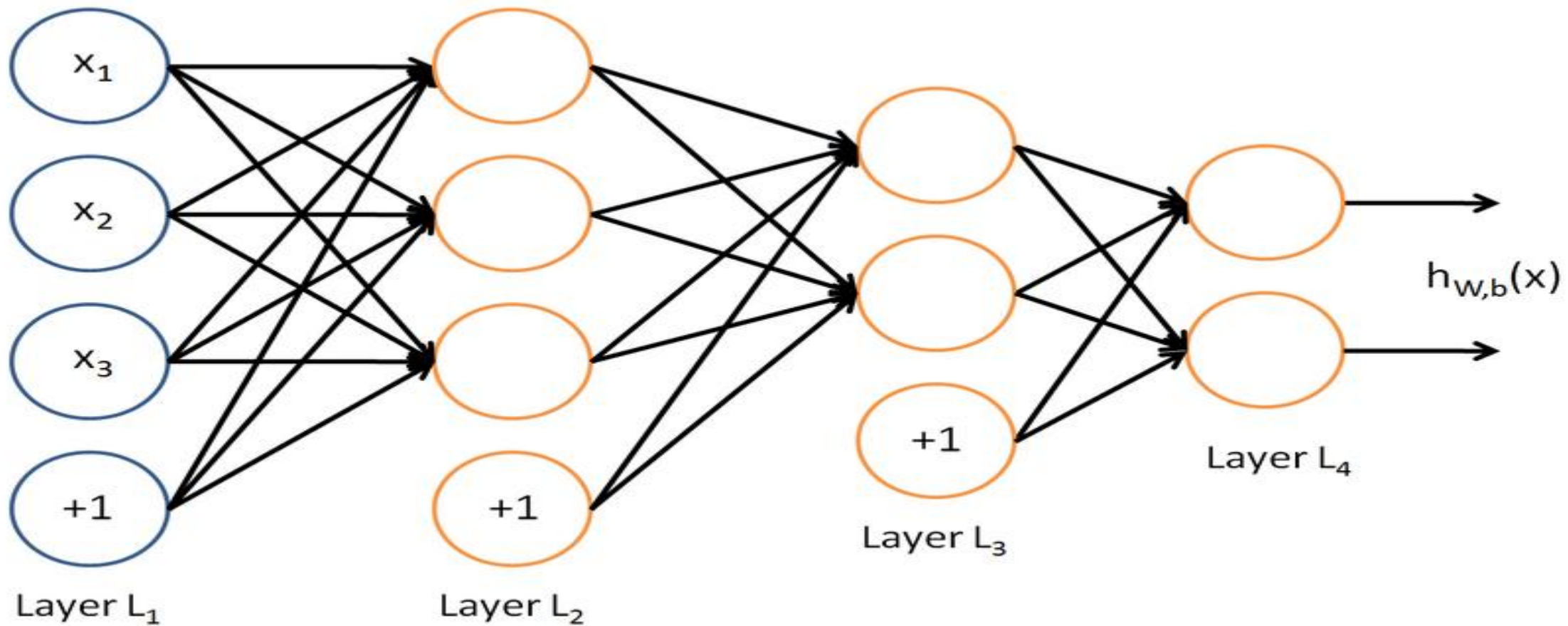
01 — MultiCharts

02 — Tradeblazer(TB)开拓者

03 — 文华(WH8)

04 — 金字塔决策交易系统

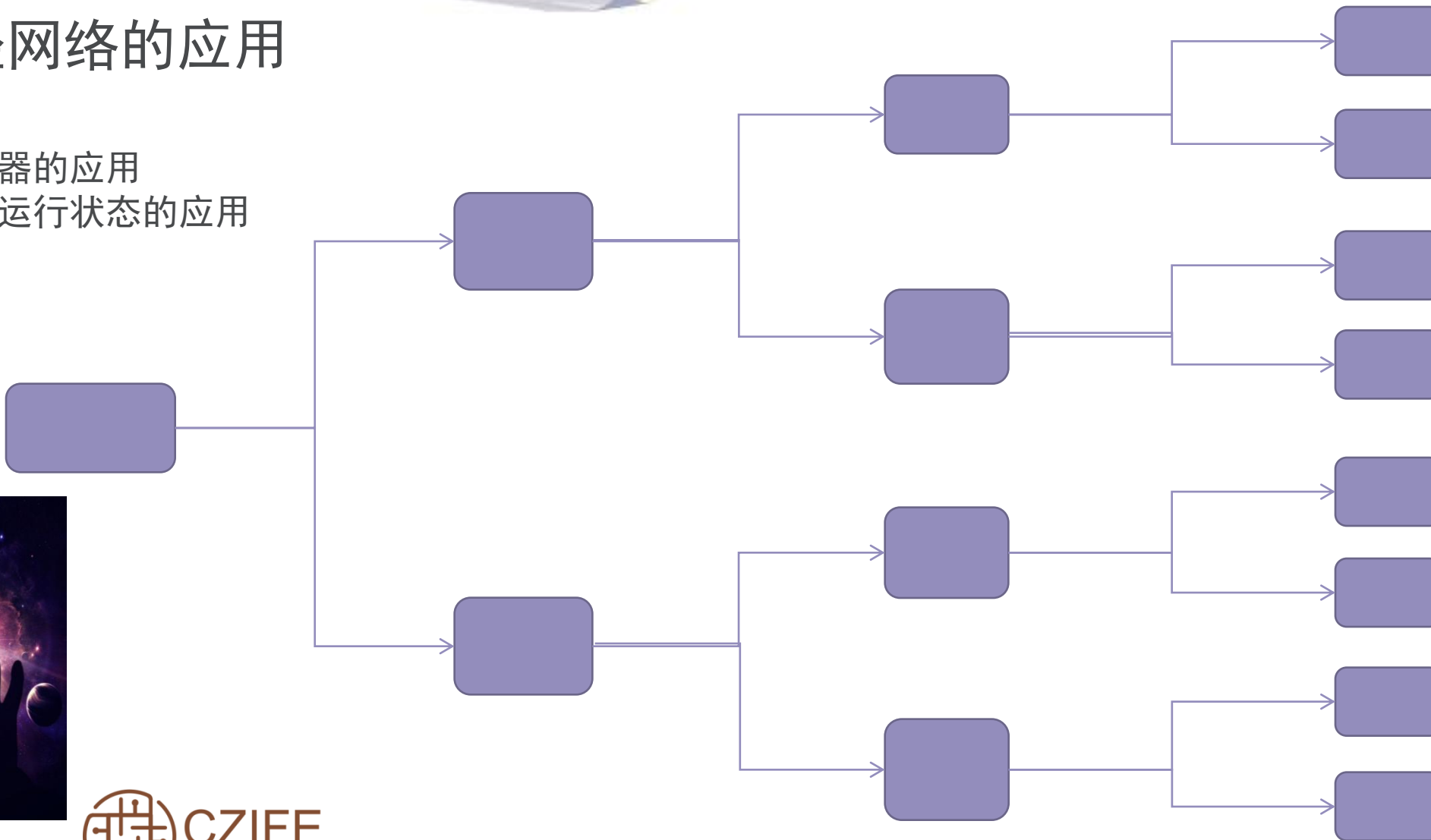
05 — 红璟程序化交易平台





神经网络的应用

- 1. 选股器的应用
- 2. 市场运行状态的应用



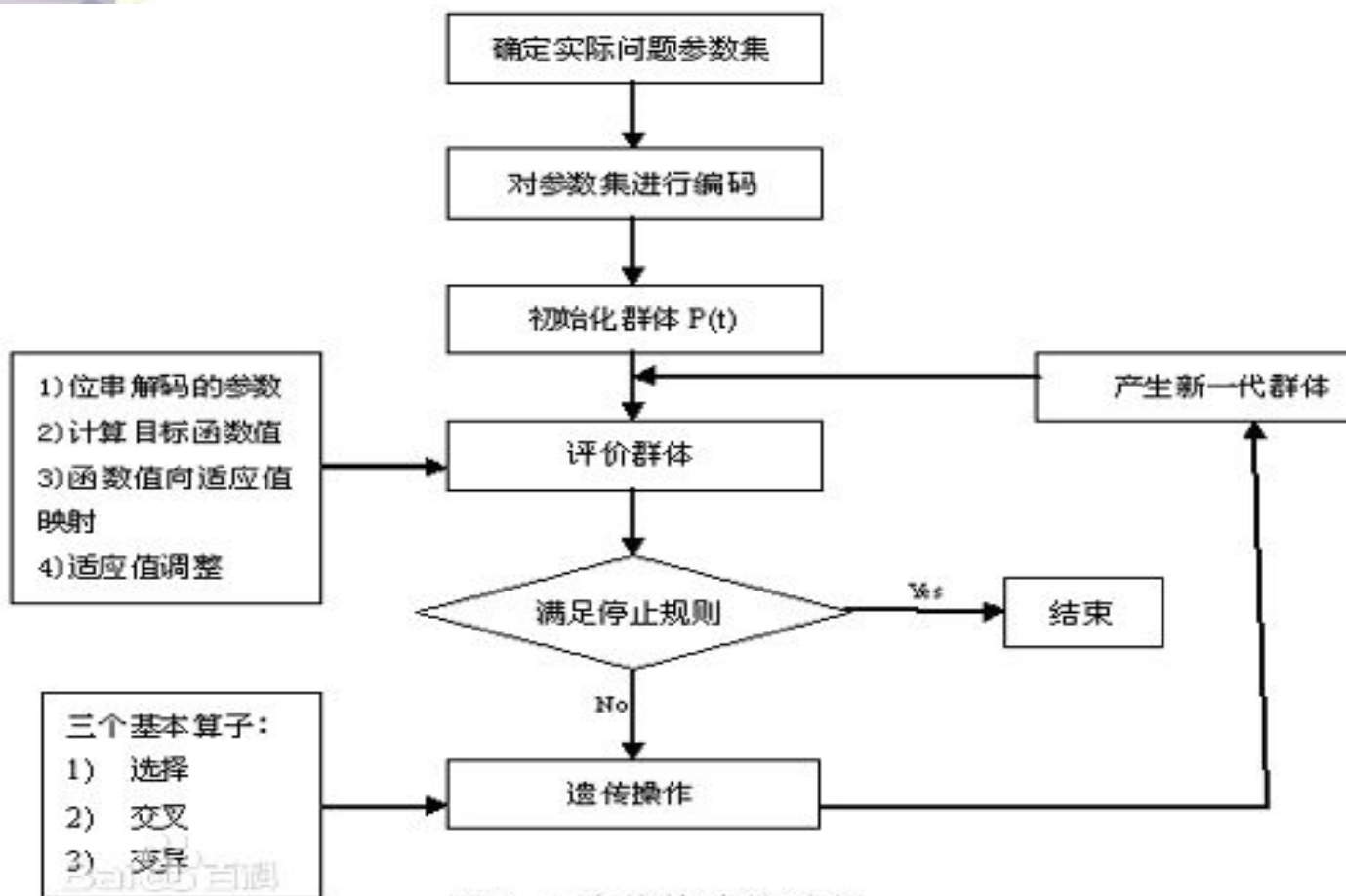


图2-1 遗传算法的过程

关于参数的优化问题-----遗传算法的应用



计算机的深度学习



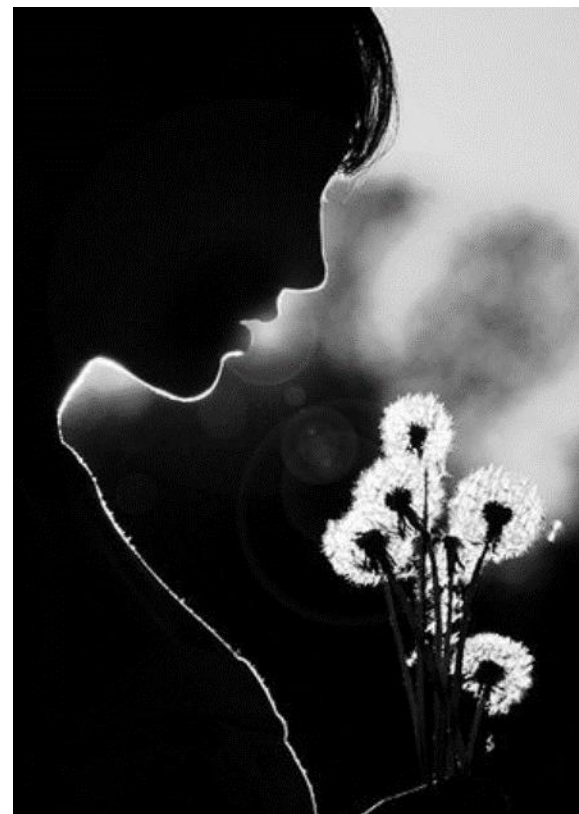
主题投资策略的应用

- 1.关注度领先标的
- 2.市场情绪的分析
- 3.特殊事件的影响



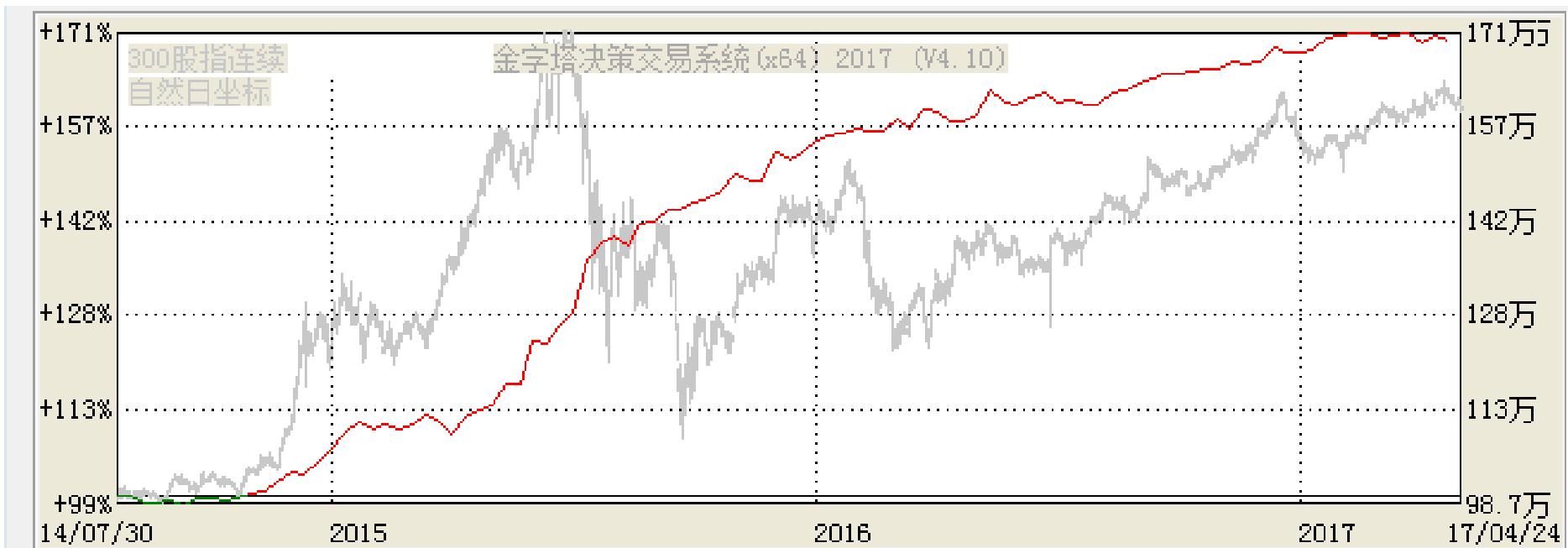
策略的回测

- 1.历史行情数据
- 2.测试的硬件环境
- 3.回测报告的分析



做好一件事情总是需要足够多的时间和耐心的，持之以恒才能到达彼岸！

沪深300股指期货



名称	利润率	年回报	胜率	交易数	成功率	最大回撤...	MAR比率
全部综合	70.44%	21.50%	34.03%	1484	0.00%	3.20%	6.73
S 300股指连续	70.44%	21.50%	34.03%	1484	0.00%	3.20%	6.73

交易次数: 1484次
年均交易次数: 542.02次

胜率: 34.03%
盈/亏次数: 505/979

最大单次盈利: 6.63%(71,546.42)
5,479.43)
平均盈利: 4,617.69
所有平均利润: 474.66
2.78

最大单次亏损: -0.64%(-
亏损: -1,662.45
均盈利/均亏损:

最大连盈次数: 6
最大连盈幅度: 6.05%(71,546.38)
24,921.88)
夏普率: 4.6401

最大连亏次数: 14
最大连亏幅度: -1.93%(-
MAR比率: 6.73%

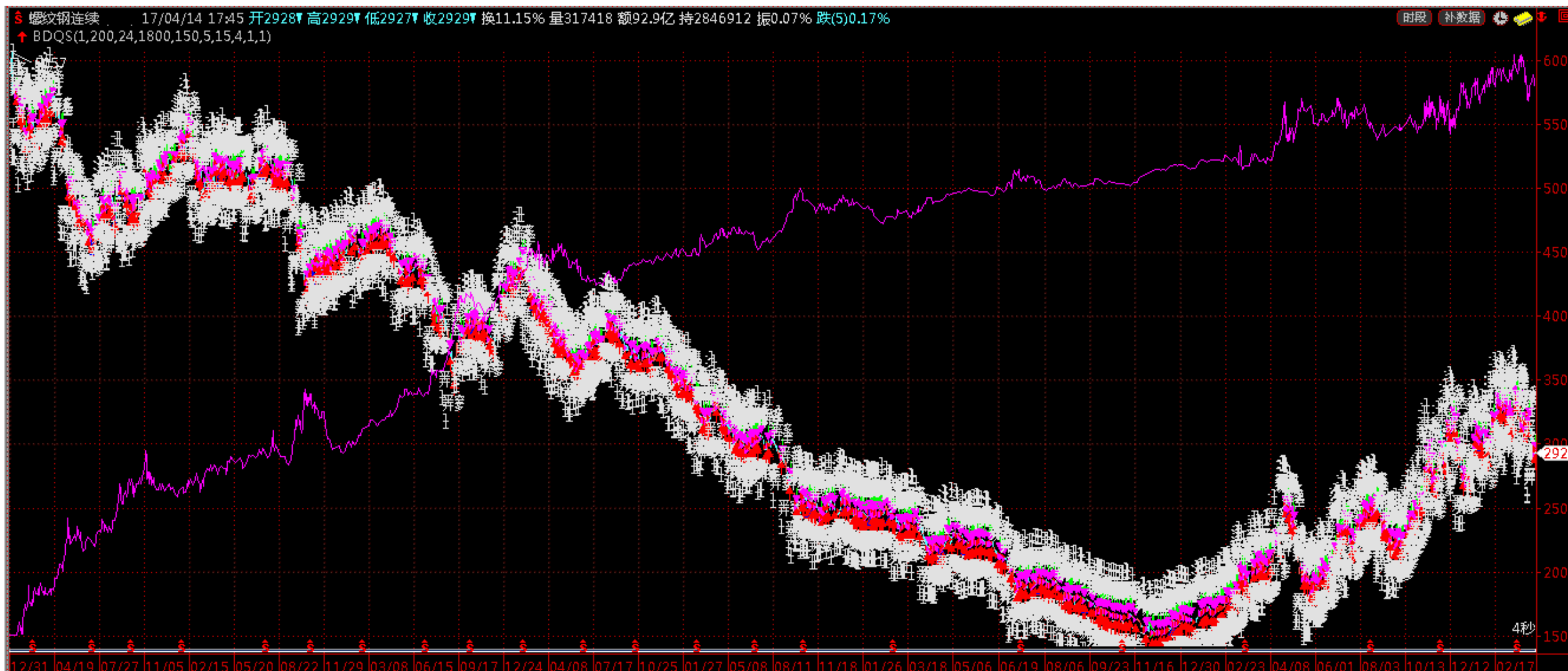
最大浮动盈利: 7.94%(85,702.22)
86,442.34)
最大回撤幅度: 3.20%
13:36:00

最大浮动亏损: -4.03%(-
最大回撤时间: 2015/06/19



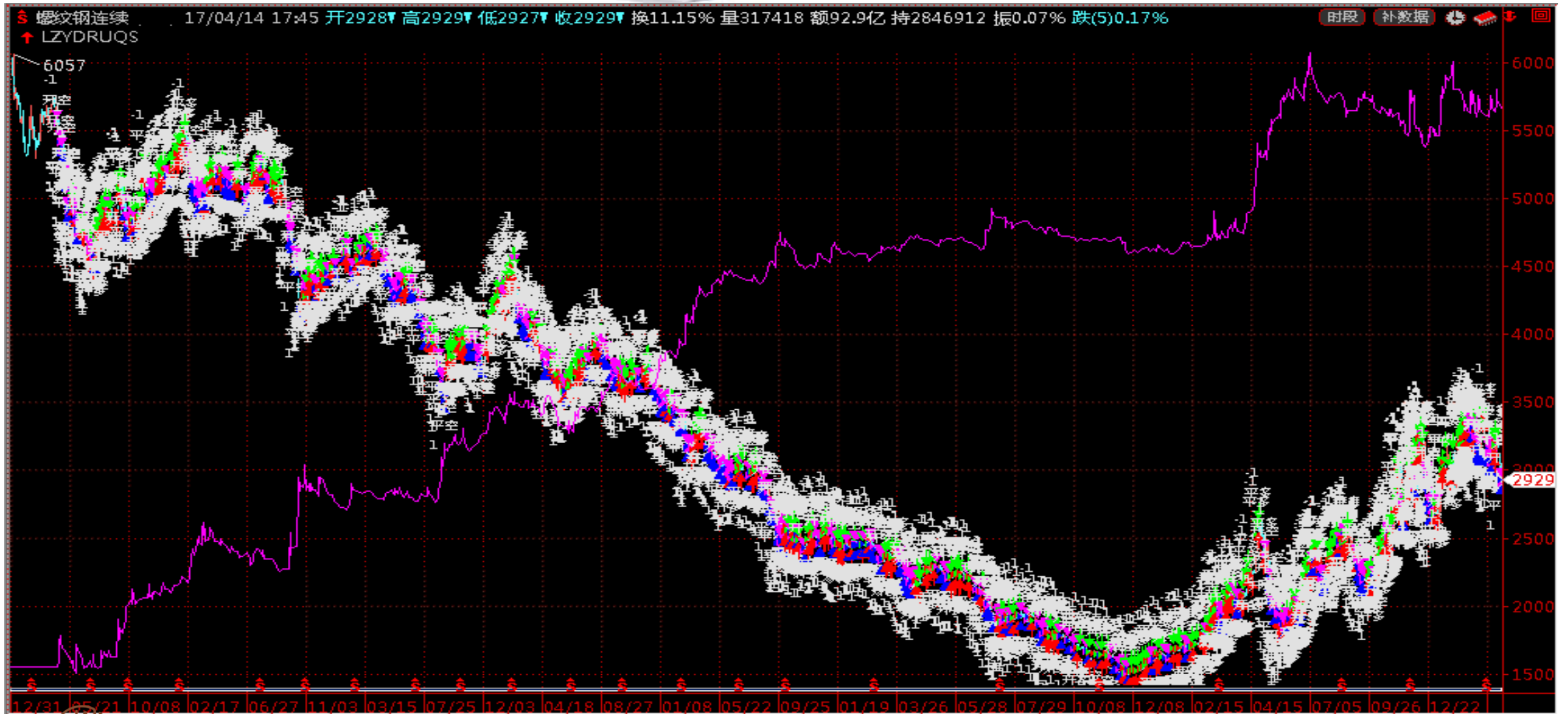
螺纹钢多策略理论交易信号和净值曲线图

2009-12-31-----2017-04-17



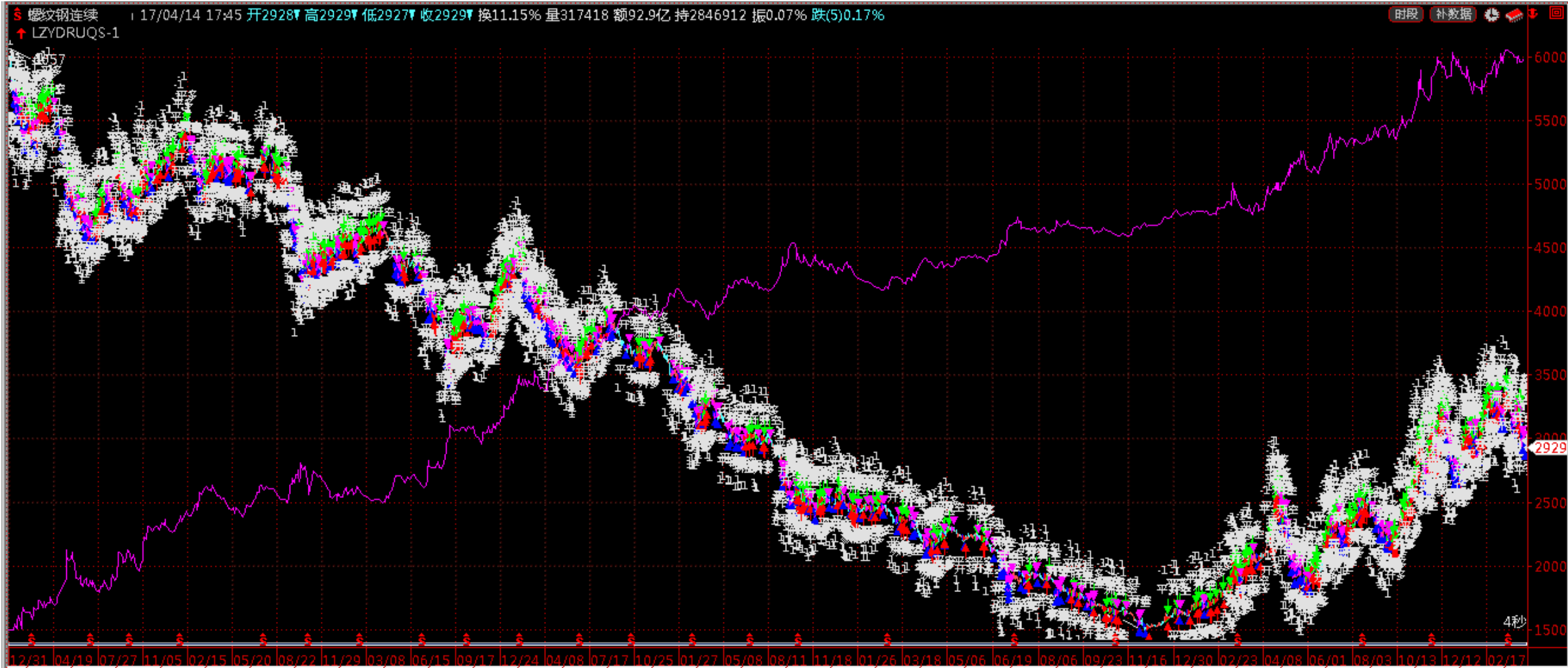
螺纹钢多策略理论交易信号和净值曲线图

2009-12-31-----2017-04-17



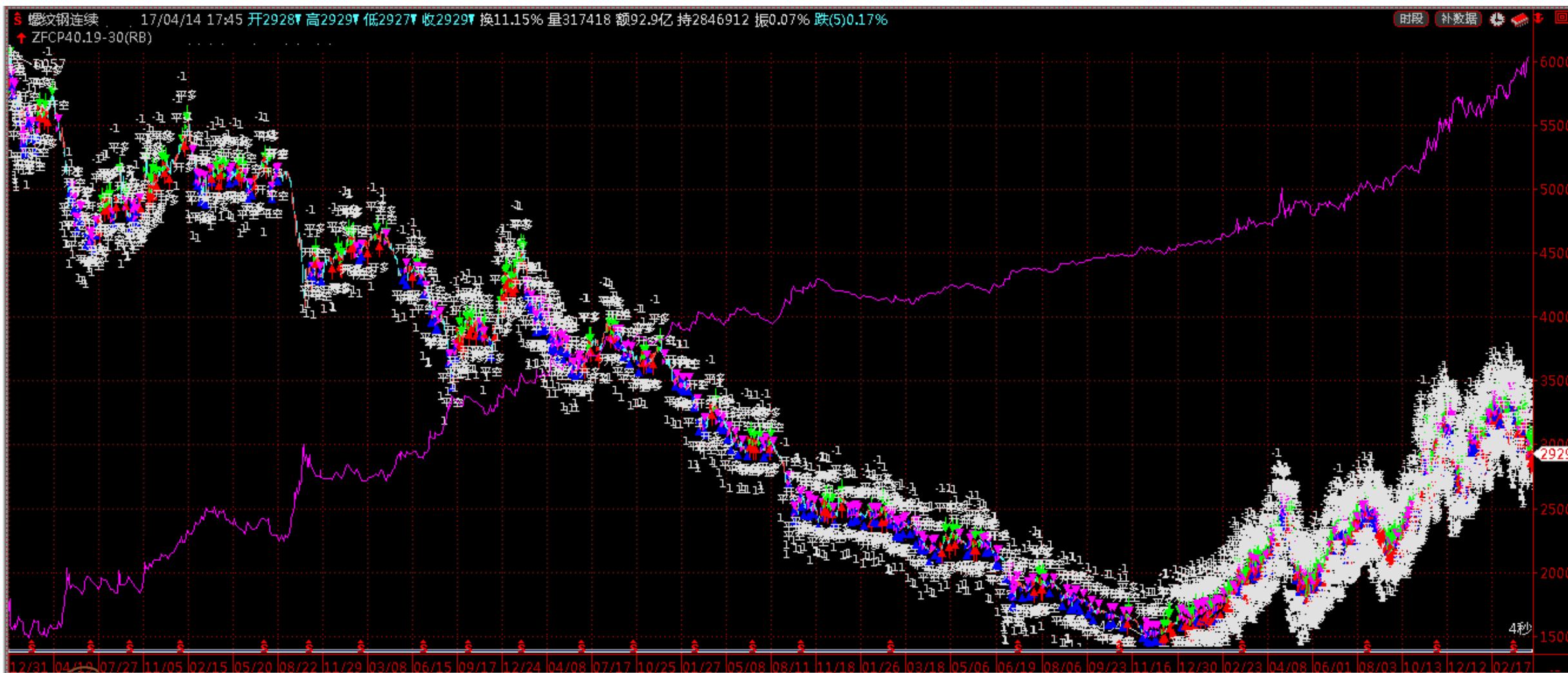
螺纹钢多策略理论交易信号和净值曲线图

2009-12-31-----2017-04-17



螺纹钢多策略理论交易信号和净值曲线图

2009-12-31-----2017-04-17





CZIFE
正福金融研究院



THANKS

郑 刚
TEL:13880218038



成都正福金融工程应用研究院 TEL:028-64798263