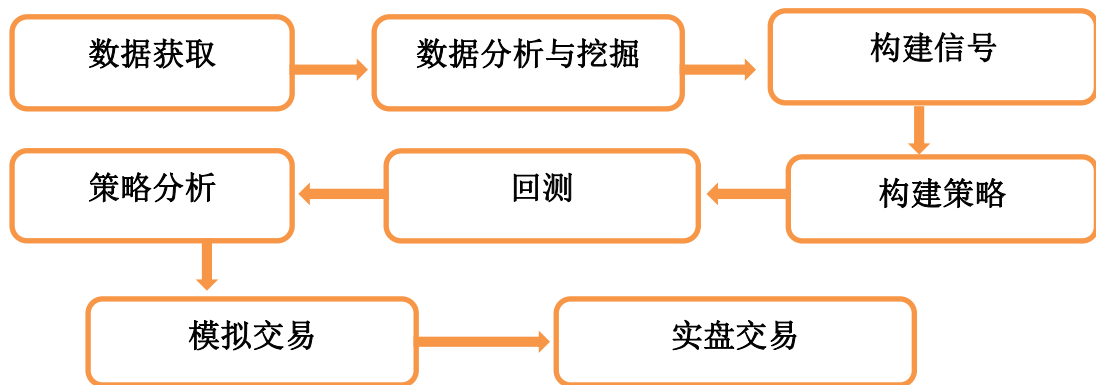


谈到量化，大家基本上都会浮现出一个标配：顶尖的理工科高材生+超额收益。也正是由于大众对量化过于神化的概念使大多对量化有着浓厚兴趣的朋友们对量化交易望而却步，会觉得自己能力不够做不了量化的工作，或者投资了一些量化产品收益率并没有达到预期而对量化投资失去了信心。量化投资究竟是什么，不用理解的太过高大上，它只是一种投资工具，只不过和以往基本面分析不一样，它采用了一定的数学模型而已。今天小编就和大家一起简单谈谈量化投资。

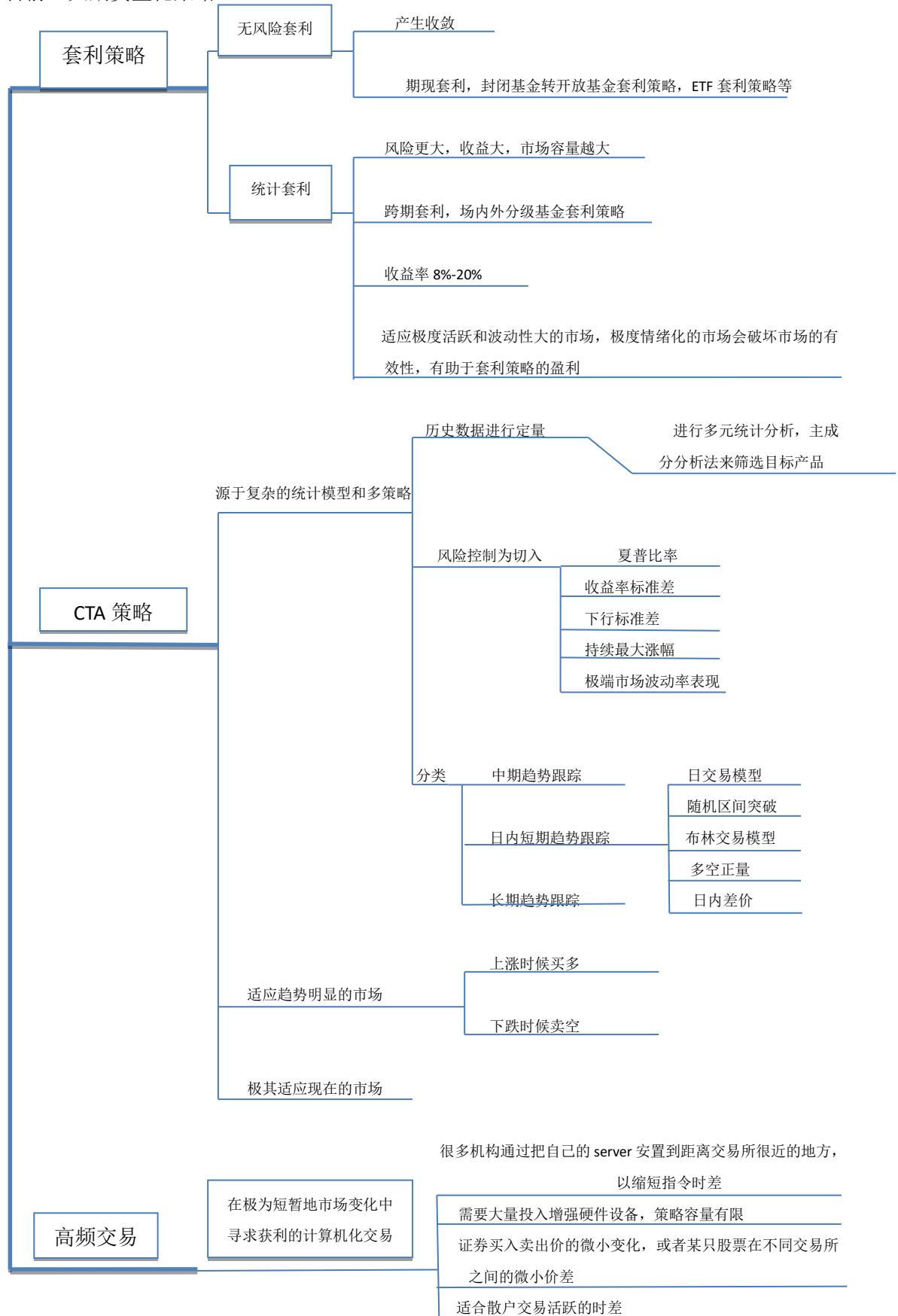
刚刚已经提到量化投资的本质，它是利用计算机科技并采用一定的数学模型去实现投资理念，实现投资策略的过程。它不是基本面分析的对立者，很多量化投资模型也是基于基本面分析得出的。和传统的投资策略相比量化投资最大的优势，小编认为有3点：1) 提高工作效率，通过回测、仿真对全品种或组合进行覆盖；2) 一定程度上解决交易过程中的执行问题，提高交易过程中的纪律性；3) 量化交易是以模型或算法作为基础，可以根据模型或算法对策略运行情况进行动态监控、评估、调整。

那量化交易到底是怎么形成的呢，小编用一幅图简单描述一下量化研究的过程。



现在小编和大家讨论一下策略这部分。策略是整个量化交易的核心，同时也是和投资者最关心的收益率最息息相关的部分。之前提到，有些量化投资者会觉得自己的收益率没有达到预期，从而对量化投资失去兴趣。但事实上，量化策略是有区分的，不是所有策略的目标都是高额收益。并且量化投资也是有风险的，在追求高收益的同时也必然会面对高风险。小编也不得不再次提醒，在进行量化投资时万万不可将其神化，绝不可相信打着量化口号，但实质上进行“赌博”的投资行为。我们团队目前主要专注于价差套利策略，并加入了资金管理的思路。虽然年化收益率无法达到最高，但我们的风险会很低，所以我们目前的夏普比率很高，非常适合风险抗压较低的投资者。之后我们团队也会不定期更新其他量化策略的详细研究报告，模型跟踪周报和量化相关知识的介绍，在这里就先用一幅图简洁明了的为大家梳理了一下。

目前三大期货量化策略



最后小编想和大家介绍一下我们团队的组成和能为大家提供的服务。我们团队主要分为两大部分：程序 part 和策略 part。程序 part 由我们的量化组负责人田景山老师负责，他毕业于哈尔滨工业大学计算机专业，曾就职于上期技术，2018 年加入华鑫期货，有着丰富的交易、结算、风控系统开发的经验，精通 C++ 和 Python 编程，擅长高性能交易系统搭建，熟悉量化领域各种前沿技术，在各量化平台上进行复杂交易策略开发。多次为客户开发过量化策略并获得高度认可，拥有从技术选型、系统搭建、策略实现、回测、仿真、实盘全生命周期量化交易实施经验。策略 part 由我们华鑫期货研究所所长助理崇盛棠老师和小编我负责。崇盛棠老师硕士毕业于英国埃克塞特大学，主修金融数学，2010 年加入华鑫期货，主要专注于股指、期权等金融期货衍生品研究，对期货投资有着丰富的经验。小编我本科毕业于英国兰卡斯特大学，研究生毕业于英国华威大学，本硕专业都是金融与经济，2019 年顺利毕业后便加入了华鑫期货工作。在中国银行，民生信托和中信建投等国内头部金融公司有过实习经验，能为团队带来最新的金融理念和策略想法。对于我们能提供的服务，小编在最开始也提过，不是非得高等理工男才可以参与到量化投资。只要您对量化感兴趣，并想通过量化的方式来进行投资，我们团队都能为您提供帮助。如果您已经有了一定的量化想法却没有编码的基础，我们团队可以为您提供自动交易的平台并帮您实现策略编码的工作。如果您是有编码能力的程序员却没有相应的量化策略想法，我们团队可以与您沟通与您一起设计出您需要的策略。除此以外我们公司还拥有国内市场顶尖的快速通道，它可以以最快的速度让客户你接收到交易所发布的交易行情并把您的订单快速传达到交易所来抢到您想要的最优价格。

欢迎大家来和我们讨论一切量化相关的话题！