



BUSINESS PLAN 商业计划书

AI量化 / AI机器学习算法 / AI大数据 / 高级量化策略研发



CONTENTS

01 企业介绍

02 主营业务

03 市场分析

04 投资回报



01

企业介绍

我们满怀热诚，用匠心致力于AI量化交易、AI机器学习算法、
AI大数据分析、高级量化策略研发。



锣鼎科技有限公司

COMPANY PROFILE

锣鼎科技有限公司是一家致力于AI量化交易系统开发、AI机器学习算法、AI大数据分析、高级量化策略研发，专业提供国内外AI量化交易服务的企业。

公司持续进行量化投资策略的研究、创新和实践，取得了不错的市场成果。依靠在数据、系统、技术等方面不断的积累和良好的投资运作，更好地实现了公司资产的保值增值，服务案例遍布全国。



AI量化交易系统



AI机器学习算法



AI大数据分析



高级量化策略分析



团队组成

公司创始团队由一群怀揣梦想与热诚，具有丰富金融、互联网从业经验的专业人员组成。



专业技术人才

Programmer

专注于AI量化交易系统程序
开发与维护。



金融、互联网行业人才

Industry Elite

提供量化投资策略运维与管理，
实现盈利及复利。



AI量化策略研究人才

Technical Experts

提供AI算法技术支持和量化
策略研究。

企业精神文化

我们是一群匠人！心怀理想，满腹热诚，用专业技术为客户提供最优策略和资产管理。





02

主营业务

AI量化可以利用计算机对海量数据进行分析，
得到常人难以发现的盈利机会，而且有些机会只有AI量化交易才能利用。
我们专业提供AI量化服务，为您的资产增值保驾护航。





加密货币量化交易系统

公司海外业务中，加密货币业务成熟，收益持续稳定增长，并不断向利好趋势发展。

01

02

03

04



量化私募基金

公司已经完成量化私募基金前期筹备工作，正在积极申请相关运营资质。

期货量化交易系统



公司正在独立自主研发国内外期货量化交易系统，已经进入实质性开发阶段。

外汇、股指



在稳定现有强势业务版块的同时，公司积极开拓业务市场，力图向外汇、股指市场进发。

专业服务，为客户创造价值

AI量化交易系统、AI机器学习算法、AI大数据分析、高级量化策略研发。



AI量化交易系统

以数学模型为交易思维，
以历史数据为基础，以数
学建模、统计学分析、编
程设计为工具，利用计算
机技术，从庞大的历史数
据中筛选出能带来超额收
益的多种大概率获利事件。



AI机器学习算法

AI机器学习算法，可使计
算机从以前的结果中学习
并获得信息的更新，而无
需人工干预。简单地向其
馈送大量结构化数据以完
成任务，而无需编程如何
执行此任务。



AI大数据分析

从海量数据中挖掘具有潜
在价值的关系、模式和趋
势，构建数据模型，做出
预测分析，帮助企业及时
了解自身问题，发现市场
机会，做出科学的经营决
策。



高级量化策略研发

为用户提供人性化、专业
服务，减少人为情绪影响，
严格按照设定好的策略执
行。帮助投资者在加密货
币市场中实现套利积累资
金。

AI机器学习算法

A

AI算法

AI机器学习算法，可使计算机从以前的结果中学习并获得信息的更新，而无需人工干预。简单地向其馈送大量结构化数据以完成任务，而无需编程如何执行此任务。根据获得的数据，AI机器学习算法将通过考虑多种因素来建立假设并提出可能的新结果，做出比人类更好的决策。

B

AI量化交易系统开发

公司目前已经具备设计和开发AI量化交易系统的能力，并已经进入系统设计过程，利用AI算法24小时多核心运算，实时提出最优的投资组合参数，以及各种指标的组合运算。

C

AI量化交易系统优势

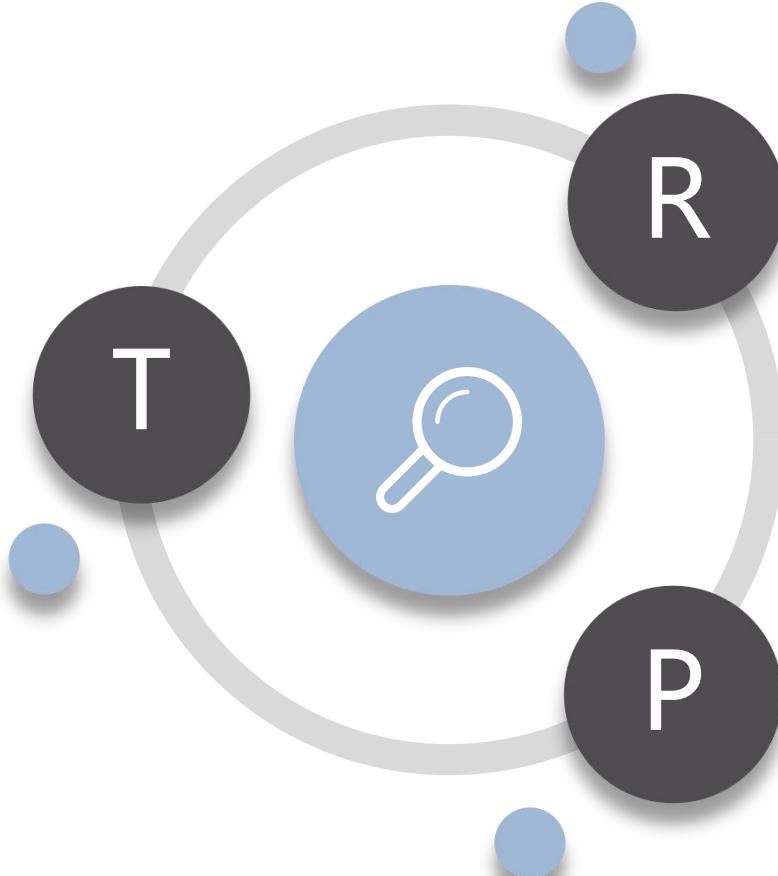
AI量化交易系统优势十分明显，比如利用AI机器学习算法，支持动态买入卖出指标，MACD判断；追踪建仓，延迟补单、智能追踪止盈；灵活的参数策略，同时支持上千交易对；高月化率、高年化率，保证用户收益；多种交易模式，保障高收益的同时降低更多的风险。

三个核心模型

PART 02

AI量化交易模型

在AI量化交易模型中，并没有绝对成功或绝对失败的投资策略，随着市场环境的波动变化，每种投资策略都能得到很好的运用。AI量化交易模型通过预测产品价格变化幅度、方向、持续时间等信息，使得后续方案能够获得绝对收益甚至收获可以超过市场基准的回报量。它的主要意义即是追求交易成本、风险与利润之间的相互平衡，从而达到最好的投资效果。



风险模型

风险模型的核心在于，从金融活动中分析具有金融风险的具体部分，并判断该部分受金融风险影响的程度。在进行判断的同时，也要对“敞口”进行专业的控制，借此来提升产品收益的稳定性。风险模型严格限制资本投放在某产品上的规模以及该产品、策略暴露出的最大风险性。

盈利模型

盈利模型对于量化交易模型而言的主要目的就是运用数据分析技术，对过往数据进行挖掘、分析，得出其中暗藏的有效信息，从而对未来趋势有所判断，最终赢得收益。



AI交易系统——

某国际国内机票整套销售系统，某国内酒店预定系统；
某三方平台及线上支付系统（银行、微信、支付宝、快付通等各种渠道支付）；
某大型连锁超市进销存系统，连锁企业人力系统；
某线上商城系统。

AI管理系统——

某大型连锁企业数据分析可视平台；
某硬件智能识别软件；
某顾客导向智能分析平台。

AI学习系统——

AI领域成熟算法设计；
大数据分析；
人工智能学习。

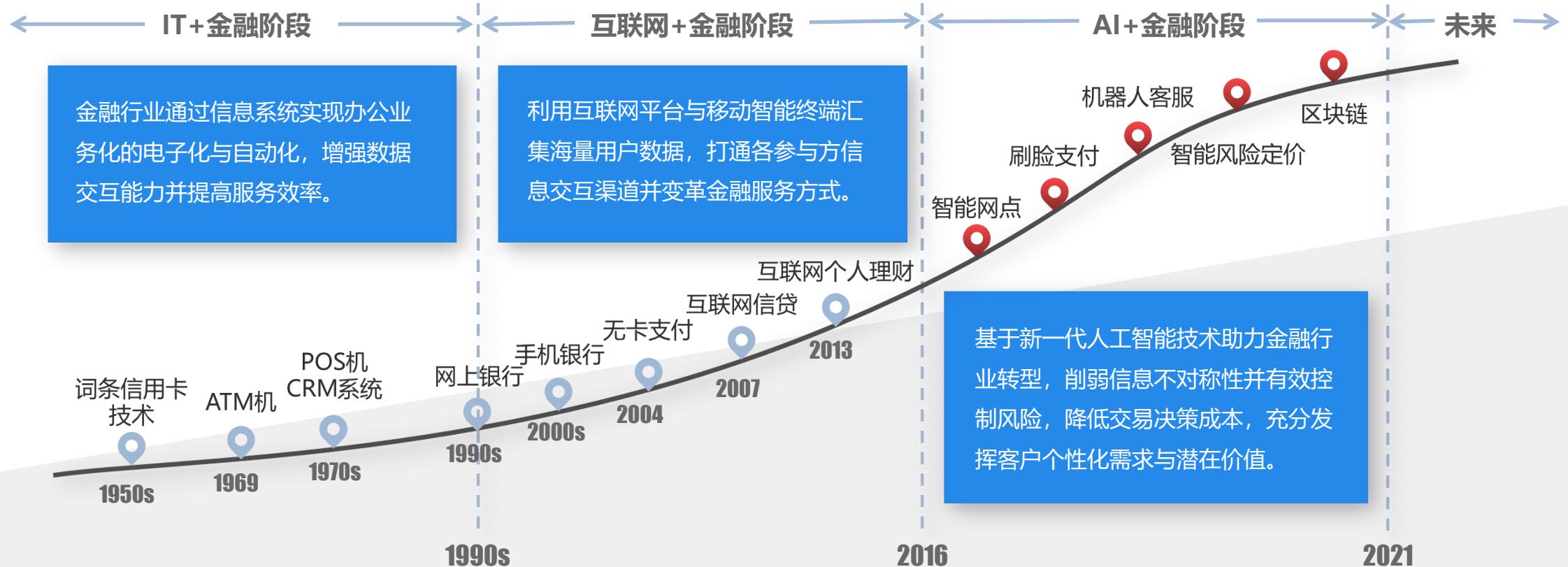


03

市场分析

我们从不缺少机会，缺的是了解机会的意愿、判断机会的眼光、尝试机会的勇气、坚持机会的恒心以及相信自己的信念。

金融科技发展历程

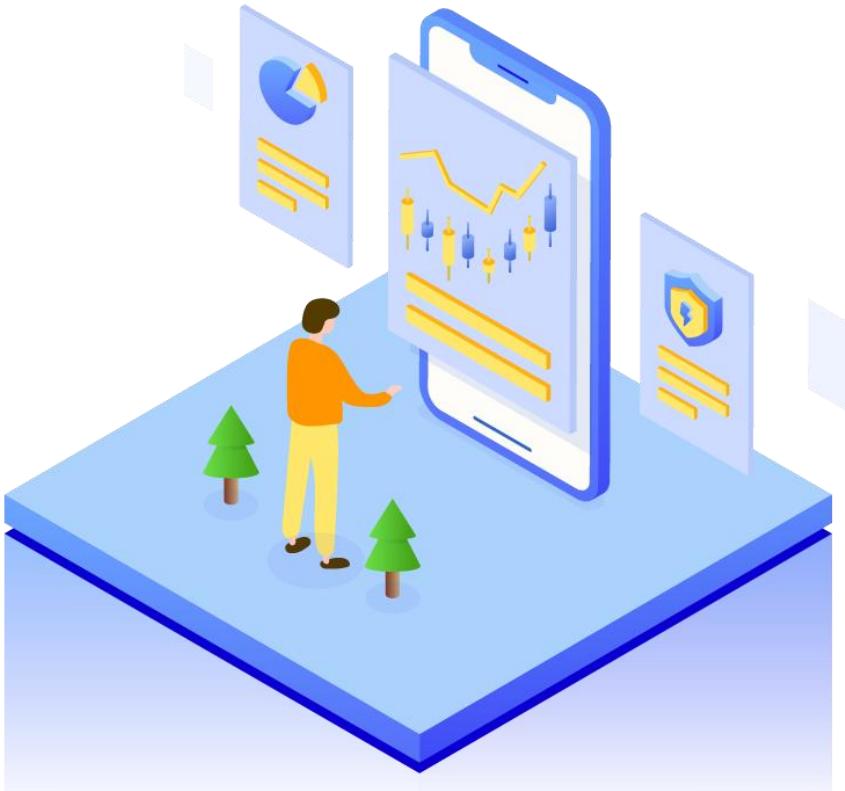


AI量化国内外市场规模发展规模

国外市场

- 首先，从全球市场的参与主体来看，按照管理资产的规模，2018年全球排名前六位中的五家投资管理机构，都是依靠计算机技术来开展投资决策。**2019年，由量化及程序化交易所管理的资金规模进一步扩大。**

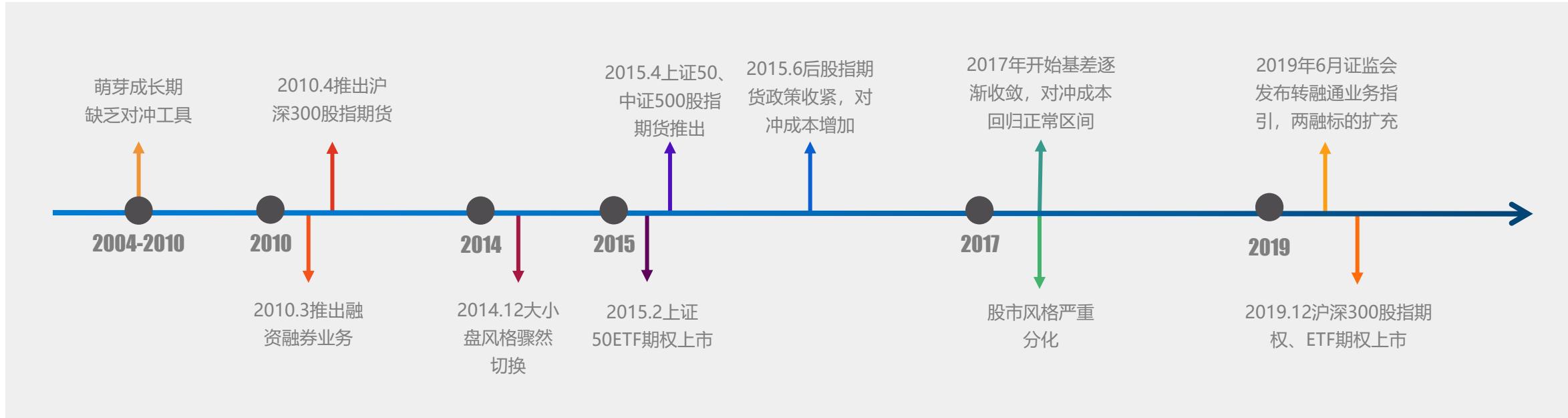
- 其次，**全球超70%的资金交易用计算机或者程序进行，其中一半是由量化或者程序化的管理人来操盘。**



国内市场

- 目前国内量化投资规模大概是3500到4000亿人民币，其中公募基金1200亿，其余为私募量化基金，数量达300多家，占比3%，金额在2000亿左右。
- 中国证券基金的整体规模超过16万亿，乐观估计，量化基金管理规模在国内证券基金的占比在1%~2%，在公募证券基金占比不到1%，在私募证券基金占比5%左右，相比国外超过30%的资金来自于量化或者程序化投资，**AI量化国内未来的增长空间巨大。**

国内量化私募基金发展现状

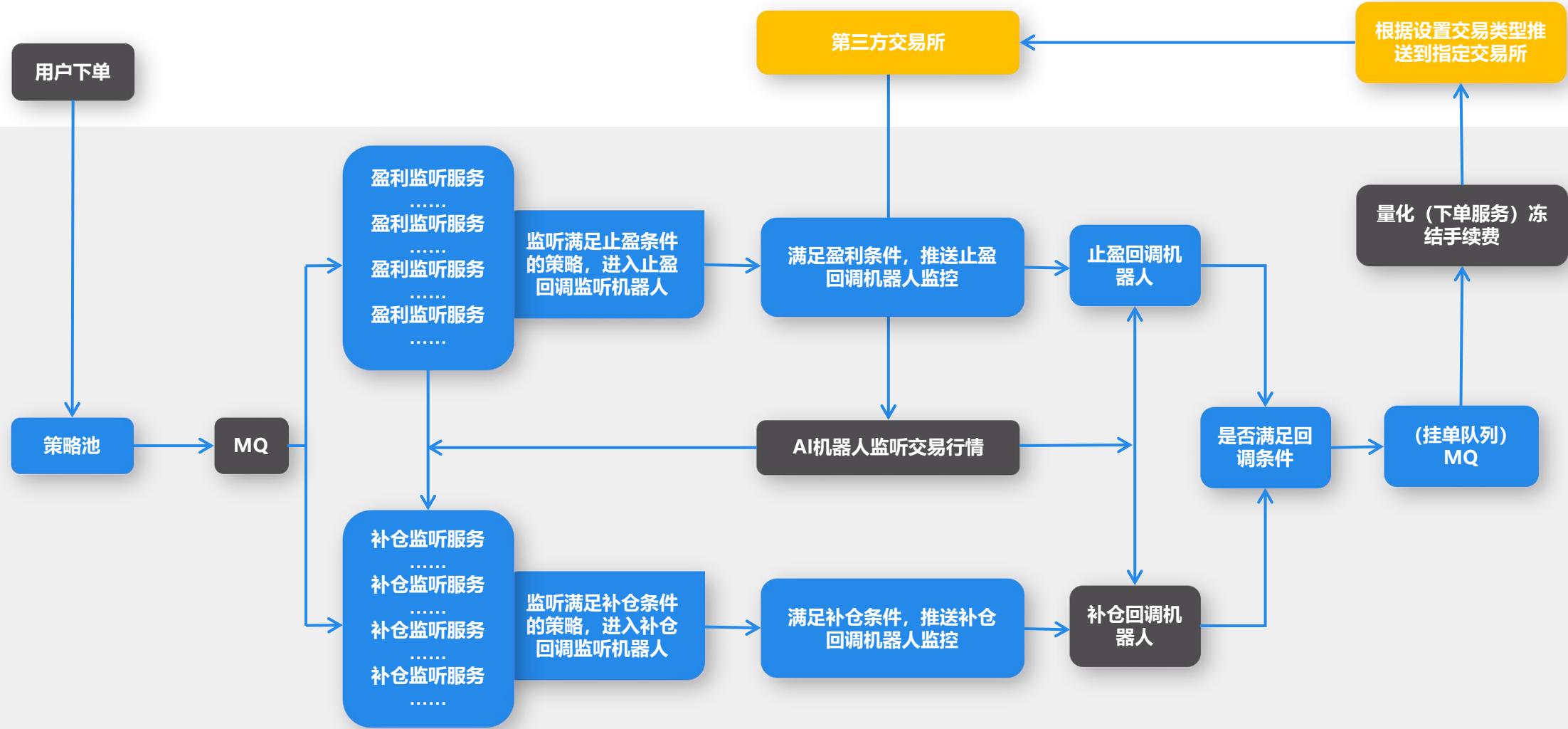


近两年，国内量化私募基金发展迅猛，并积极开拓海外市场。根据中国证券投资基金业协会的统计，2020年量化基金规模大幅增长，规模达到6999.87亿元，较2019年增长66.5%。

2018-2021年期间，公募基金和私募基金业绩对比，私募量化收益相对更为稳健。其中，2018年股票市场普跌但是私募量化管理期货策略收益率中位数仍取得正值。2019和2020的结构性牛市中公募基金与私募量化指数增强收益率中位数表现相当。2021年上半年，私募量化策略中位数跑赢公募。

(数据信息来源：私募排排网)

AI量化技术构架





策略逻辑对比

马丁格尔策略

类型：单边马丁，双向马丁。

补仓方式：斐波那契，平摊，倍投。

特点：市面上大多数类似策略，不判断趋势方向，头寸特别小，看对方向赚蝇头小利，看错方向不断补仓死抗，不盈利不平仓。

总结：震荡行情会有盈利，价格单边行为，不止损，不断补仓，浮亏非常大，牛市“保健品”，熊市现货套牢，合约爆仓，赚钱是过程，爆仓是结局。

CTA趋势策略

类型：CTA策略类型，追随趋势，自动判断方向。

特点：亏损坚决止损，盈利再加仓，严格仓位管理，实盘不超过二倍杠杆，自动开仓，自动加仓，自动多种止损方式，自动多种止盈方式，数百个品种同时交易，增加胜率，非标准周期捕捉交易信号，快人一步。

总结：自动判断方向，紧跟趋势，交易合约，轻松跨越牛熊周期，严格止损，不存在爆仓套牢风险，盈利加仓，扩大盈亏比，资金利用率高，数百个品种同时交易，胜率大，主动权掌握在交易者手上。

网格策略

类型：无线网格，有限网格，马丁网格。

补仓方式：头寸一般是总资产50%，有限网格区间补仓等额数量的仓位。

特点：划定一个价格区间，亏损不断加仓，加仓部分产生盈利抛出，不断高抛低吸，产生网格利润。

总结：震荡行情会有盈利，头寸过大，不止损，一旦方向错误或者插针，价格单边行为，浮亏特别大，必定爆仓。

合约CTA趋势策略

特点：

频率：中低频，CTA策略

合约衍生品，跨越牛市熊市

自带止损，严格仓位管理，最大限度克服人性贪婪恐惧

自动判断多空方向，自动开仓，自动加仓

自动多种止损方式，自动多种止盈方式

数百个品种同时交易对监控开仓，增加胜率

非标准周期性捕捉交易信号，快人一步

参数自主设置，适应不同周期

增加模拟盘功能，实时进行参数调优



AI量化系统优势



降低情绪波动影响

AI量化有着严格的纪律性，可以克服人性的弱点，如贪婪、恐惧、侥幸心理，也可以克服认知偏差。一个好的投资方法应该是一个“透明的盒子”。我们的每一个决策都是有理有据的，特别是有数据支持的。



减少对指标的依赖

量化市场技术指标成百上千，种类繁多，指标是非常好的工具，但在瞬息万变的金融市场，指标也不是万能的，否则就不会存在亏损事件。AI量化基于海量金融数据，做出最优策略，可以减少对传统技术指标的依赖。



有效降低投资风险

AI量化从庞大的历史数据中筛选能带来超额收益的多种“大概率”事件以制定策略，用数量模型验证及固化这些规律和策略，然后严格执行已固化的策略来指导投资，以求获得可以持续的、稳定且高于平均收益的超额回报。



避免投入过多时间精力

AI学习机器人可24小时全天候高强度工作，并且自我学习，极速策略交易，自动化执行任务，能够接受大量的价格数据，分析价格的异常和统计形态，选择并完成交易，整个过程只需要10毫秒。



降低盈亏计算难度

AI量化支持因子和策略的自动监控分析，多种维度可视化分析展示，输出完整绩效分析报告。有效较低盈亏计算难度。



降低操作难度

AI量化支持多账户智能交易、算法交易、篮子交易等多样复杂交易场景。极速策略交易，任务自动化执行，信息精准及时，日志完整可查。新手小白也能一键投资。



04

融资计划

AI时代的到来，助推了金融行业全自动交易的快速发展，给投资方法带来了巨大的改变。

AI量化自动化交易逐步替代传统投资者的事事亲力亲为，提升了交易效率，并极大的避免投资者的主观因素导致交易亏损，抓住稍纵即逝的获利机会。



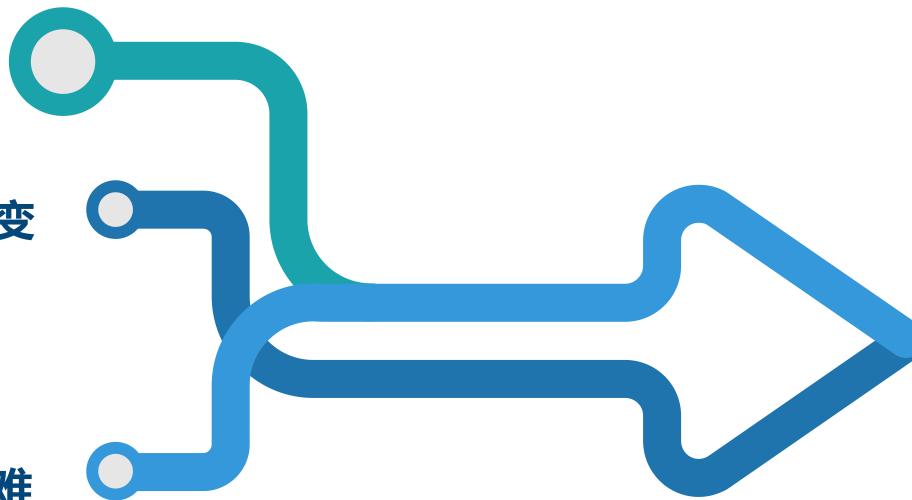
多元化投资

- 后疫情时代，疫情时起时伏，随时都可能爆发。疫情对社会经济的不良影响，全球通货膨胀、不可预见的干旱、洪水等各种自然灾害因素，使得投资实体经济亏损风险急剧上涨，闲置资金储蓄的速度跑不过资产贬值的速度。
- 大变革之下，我们个人一定要注意投资的多样化，尽可能化解金融危机对自己的影响。

后疫情时代，实体经济投资难

自然灾害频发，市场瞬息万变

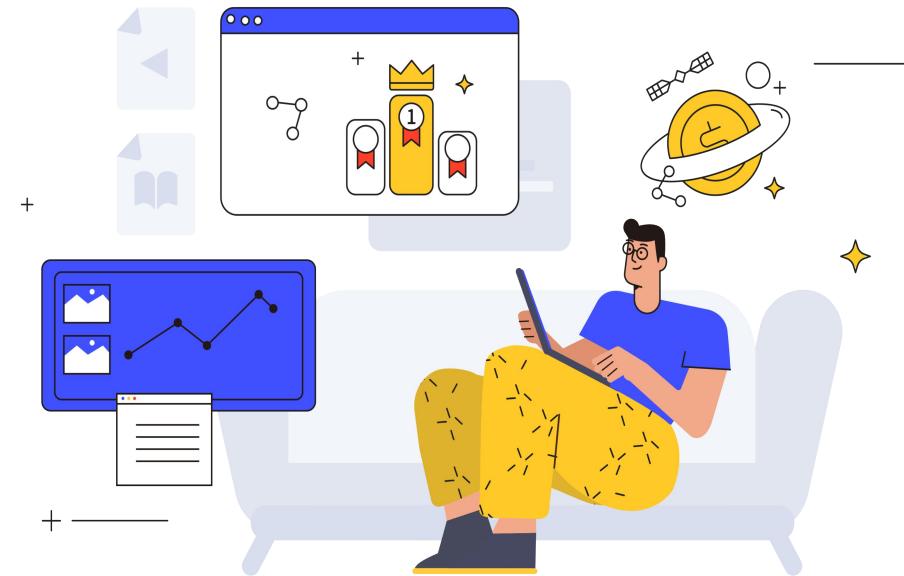
全球通货膨胀，资产保值升值难



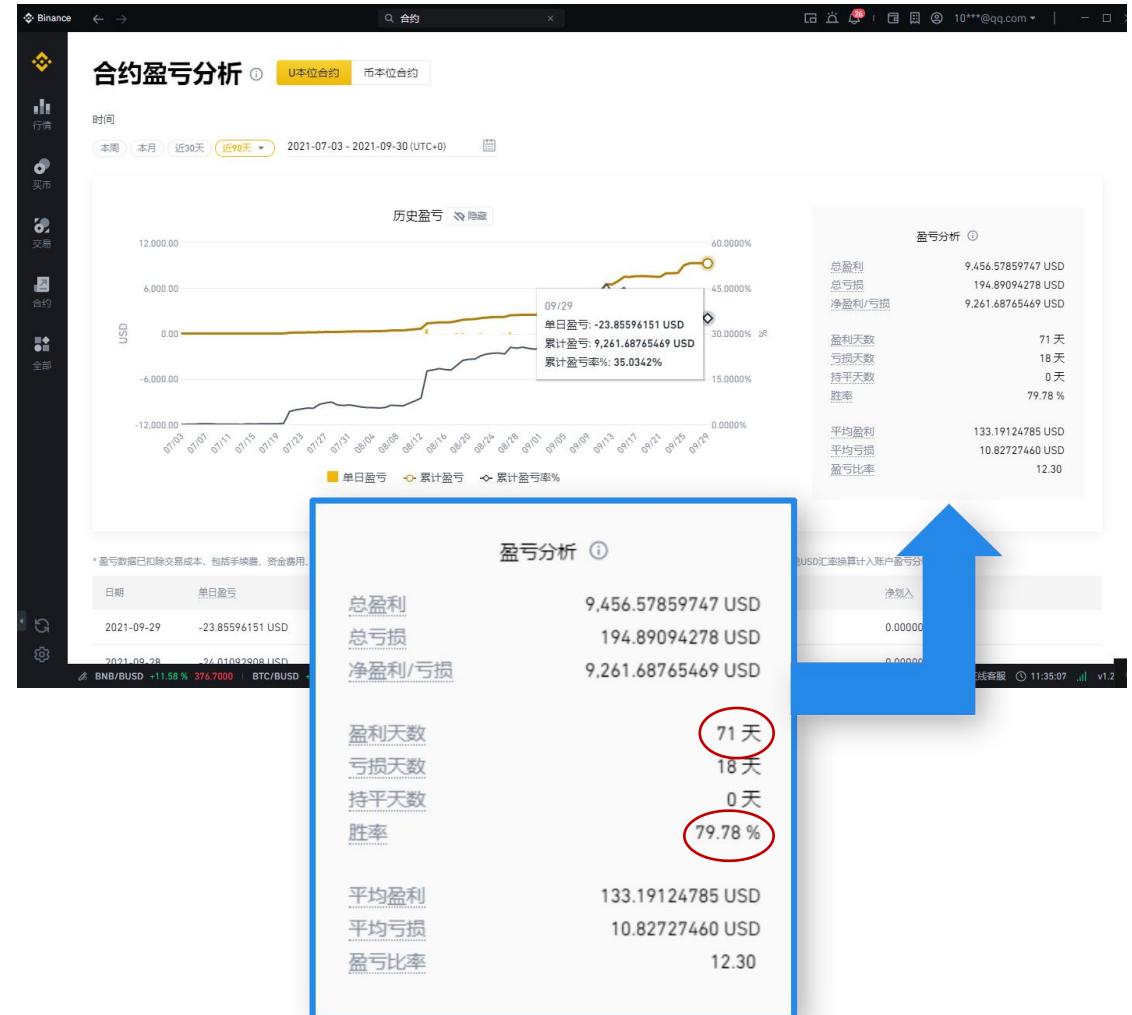
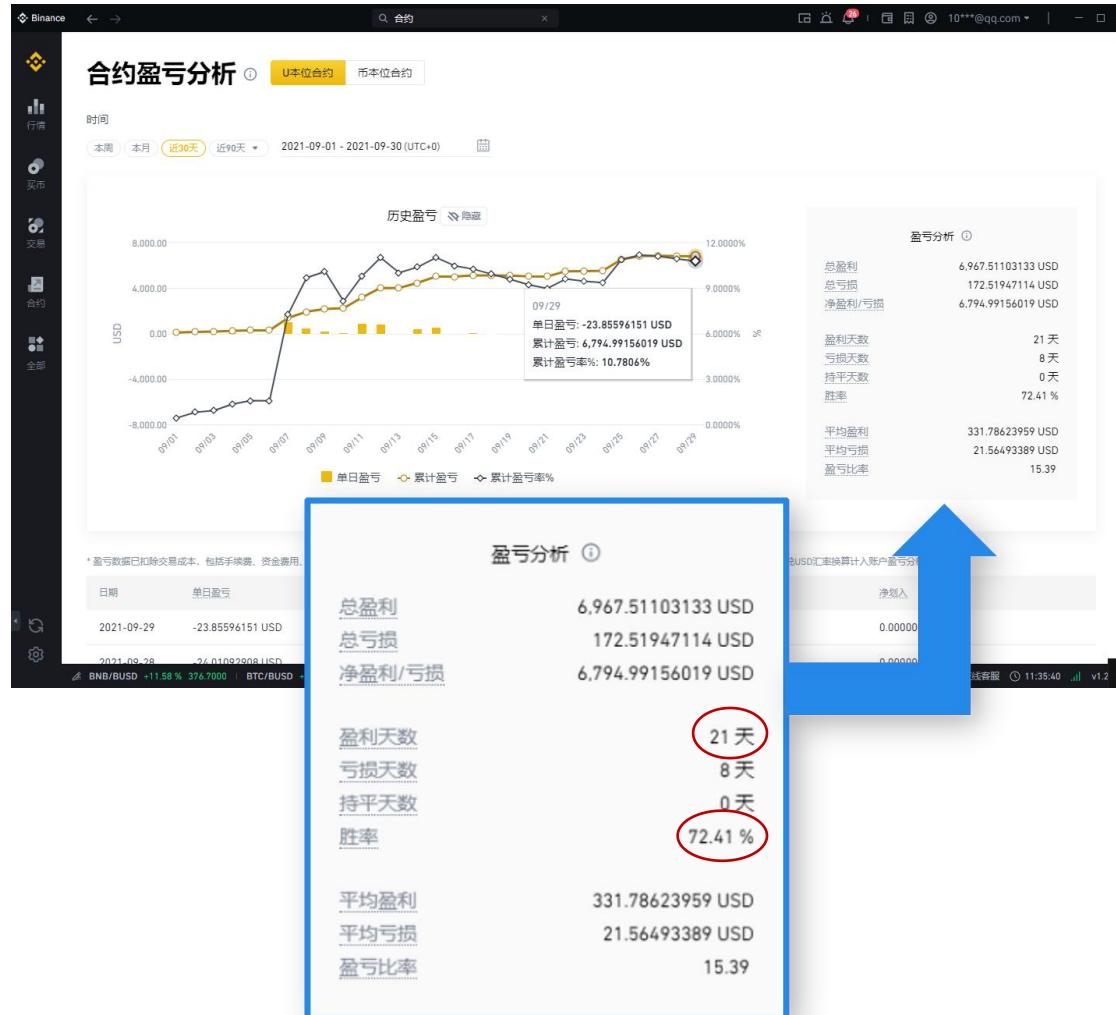
多元化投资
AI量化保驾护航

收益模式和经营现状

- 阿星科技拥有机制健全的AI量化交易系统，通过合规的**风险控制模型、盈利模型和量化交易模型**，实现公司可持续盈利以及产品研发。
- 公司目前的收益模式主要通过量化产品的运营获取盈利，按照一定比例收取盈利分成。目前公司量化产品运营的盈利水平远高于同行，且风险控制在一定范围内。
- 公司现阶段已经实现**多重策略组合性投资**，在提高收益的同时，降低更多未知因素的影响，保证投资的稳定性、持续性以及更多同类型业务的战略布局。



合约客户投资效果



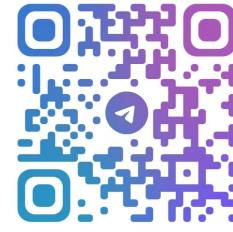


THANK YOU
感谢您的观看！

期 / 待 / 与 / 您 / 共 / 创 / 财 / 富!



Wechat



@GNIDAOL



锣鼎科技
Loding Tec