

[论坛](#)
[金融投资论坛 六区](#)
[金融工程（数量金融）与金融衍生品](#)
[量化投资](#)
[什么人适合Quant这个职位？Quant一天的生活是怎样的？](#)

Stata培训 EViews培训 SPSS培训	金融建模 CFA/FRM 投行估值 商务图表	Python量化投资: 从零基础到实战	【CDA数据分析师】LEVEL 2培训
《Hadoop大数据分析师》现场&远程	CVA注册估值分析师 VBA金融 并购估值	加入经营之家俱乐部 数据定制服务	【拼团】机器学习与R语言 SSCI论文视频
SAS培训 Matlab培训 R培训 AMOS培训	统计年鉴汇总 行业分析报告汇总	数据处理与分析 成为VIP会员	中国数据分析和数据挖掘俱乐部(CDA)邀请参
论坛bbs 经管爱问	CDA数据分析师 项目交易	求职招聘 在线教育	投稿 服务一览 快速导航
《SAS/SPSS数据统计分析师》认证培训	【高薪】CDA大数据分析师就业班（3个月）	【Stata】初高级2018年寒假特训	机器学习 深度学习 Mplus论文分析

[发帖](#)
[回复](#)

[返回列表](#)

[提升主题](#) | [本版置顶](#) | [关闭主题](#) | [变更主题颜色](#) | [抢沙发](#) | [顶贴](#) | [显身卡](#) | [道具中心](#)

楼主: kuankejie

加关注

串个门

加好友

发消息

0 关注

14 粉丝

硕士生

23%

还不是VIP/贵宾

威望

0 级

论坛币

82 个

亮客界

QUANTVIEW

[讨论交流] 什么人适合Quant这个职位? Quant一天的生活是怎样的? [推广有奖]

6694

kuankejie 发表于 2015-8-27 10:12:57 | 只看作者 | 倒序

提示: 受到警告 fantuanxiaot 广告 2015-9-10 15:46

quants一天的工作内容和他公司的风格、他研究的策略方向有所区别。我说下我们团队一个quants一天的工作吧。我们团队的风格主要是统计套利和高频流动性交易。

8:30: quants来到公司, 开始为今天的交易准备数据, 包括从万得、Bloomberg等终端导出数据, 喂给自动交易系统。然后根据昨晚优化的结果, 配置今天的核心参数。

9:00: 所有数据准备好, 配置文件设置好后, 风控专员过来检查风控参数, 包括每个交易员级别的、每个策略级别的、每个品种级别的指标。比如每个策略配置的资金、总交易的最大手数、每个品种交易的最大手数、当日最大持仓量、流控参数等等;如果是套利检查进场出场点的基差, 如果是流动性交易, 检查基准基差等等。

9:30前: 所有交易参数、风控指标检查完毕后, 使用暂停和手动模式启动自动交易系统, 自检成功后, 切换到手动模式, 手动挂撤几笔单子, 没有问题的话, 启动自动交易模式。今天的交易就算正式开始了。

交易启动成功后, quants的主要工作就是启动matlab, 继续优化或者研发新的策略, 正在交易的策略就完全通过耳朵来监控, 对于不同的信息有不同的声音, 比如行情延迟中断报警、下单成功、盈亏、交易异常报警等等。这里的策略研发也分不同的阶段, 比如早期或者一个新的quants, 更多的是做paper test。或者要做个新的方向, 首先也是先做paper test。paper test的过程中, 免不了大量的回测, 这里回测要注意几个关键的坑:

1. 脏数据: 这里包括数据粒度问题, 做套利的还得考虑不同交易市场的时间戳对齐问题。

2. 高收益: 有时候回测会发现, 某个策略跑的数据真漂亮呀, 这个时候千万不要得意忘形, 很认真剔除那些单次高收益的点, 这些点往往贡献了很高的收益, 却在未来不可重现。

3. 过优化: 过优化, 过拟合这些坑就不说了。

当一个策略在历史回测中表现不错, 并且样本外测试也符合的话, 就可以考虑准实盘测试了, 这里的表现不错主要是看年化收益、最大回测、夏普率、市场容量。有时候也会根据公司的短板有意识的补充一些策略。这里的准实盘测试是指用实盘行情, 模拟下单在实盘跑。

经管之家-就业指导

你的困惑, 我也有过

一对一职业指导咨询

数据分析师、大数据工程师、精算师、人工智能、量化投资、区块链、市场营销金融分析师。

而另一群做高频交易策略的quants，更多就是编程工作，考虑着怎么降低系统延迟，怎么更快的下单。

15：30：收盘后，关闭交易系统。下载当日历史数据，用历史数据重跑一次交易，比较与实盘的差异。如果有差异，找出差异点;写交易日报。

17：00：投资总监发起每日的组会，讨论每个策略的交易情况。

18：00：开始健身房，30分钟-60分钟健身。

19：00：晚餐。

20：00：晚上8点后的夜生活就因人而异了，有继续回公司研究策略的，也有灯红酒绿、纸醉金迷的。。。 (来源：宽客界微信公众号quantview)

回贴

分享

收藏 5

支持 0

反对 0

评分

关键词：quant Ant Bloomberg bloomer Quants

职位

相关帖子

- CDA数据分析师认证考试
 - SAS数据统计分析师招聘（2013.3.21）（北京or上海）
 - 升降职---绩效统计----4月
 - 1
 - 互联网数据架构，分析，挖掘，建模，算法相关职位开
- 猎头职位：某著名国产手机急招数据挖掘 年薪30W
 - 新人
 - 【证券公司各部门介绍】
 - 交易员offer求比较信托vs基金
 - 中信集团招聘信息（最新职位为2013-07-18发布）

使用道具 举报 回复



qnboyka 发表于 2015-8-27 13:07:39 | 只看作者

谢谢分享

沙发

使用道具 评分 举报 回复



怀念kome 发表于 2015-8-27 14:20:21 | 只看作者

thanks for share

藤椅

使用道具 评分 举报 回复



JCR 发表于 2015-9-2 15:58:07 | 只看作者

揭秘黑客生活，管晚饭挺不错

板凳



陪妳看海 发表于 2015-9-10 10:19:29 | 只看作者

NICE !

使用道具 评分 举报 回复

报纸

使用道具 评分 举报 回复

发帖 回复

返回列表



添加附件

高级模式

发表回复

☐ 申请奖励

☐ 回帖后跳转到最后一页

零基础 学会数据分析技术 丁亚军 主讲

手机版 | 意见反馈 | 帮助 | 新手入门 | 用户手册 | 友情链接 |

4000-51-9191

JG 经管之家 jg.com.cn

Peixun.net

CIDA 数据分析师 CERTIFIED DATA ANALYST

联系我们 招聘英才

合作加盟 广告服务

如有投资本站或合作意向，请联系（010-62719935）；投放广告：13661292478（刘老师）
客服QQ：2881989700 邮箱：service@pinggu.org 投诉或不良信息处理：（010-68466864）

京ICP备16021002-2号 京B2-20170662号 京公网安备 11010802022788号
论坛法律顾问：王进律师 知识产权保护声明 免责及隐私声明