

Quantitive-Investing

开发属于我们的量化投资策略

量化投资前景广阔，近些年，各地相继组织形成了量化投资学会，可见其在中国的蓬勃发展。量化投资，它看似神秘、深奥，但其背后的思维和算法源于数学，数学工具渗透在资产配置、风险防范等各个方面。

量化投资的核心在于策略。而这个策略最初只来源于一个直觉，依靠计算机模拟/程序，让我们可以方便地测试这种直觉。一个直觉是一种单一的算法，它将在数学的作用下演变和发展，甚至升华。我们的量化投资策略开发，本项目的研究路径也按照如此的思路，最终希望形成具有独立风格的投资策略。

前言：普通投资者为什么赚不到钱？

我本人在高中时第一次接触股票，第一次买股票。那时是08金融危机刚开始扩散的前半年，各国开始提出刺激经济和救市方案；我那时买了万科A，成本12元。万科的股价每下跌1~2元，我就补进去，到2013年，我共有接近八手的000002.sz，成本大概是8元。

也就在前几个月大盘第一次爬高的时候，万科股价随即开始涨，我按捺不住，早早离场，因为资金事实上是“冻结”了几年。这一次我把手中的股票全卖了，盈利不超过500元。从上一次集中关注股票，到现在离场，有三年了。

也是在近期，我购入的银行、证券股引领大盘跳水。个人资产也亏损达30%以上，再次心灰意冷，这次套牢，大概也要等上很久了。

我的投资经历是十分像普通投资者的，十个进去，八个亏着出来。事实上，是心里因素，或者说是我们患得患失的心态让我们被套，让我们无法盈利。追高，杀低，都是盲目的；达到止损点不离场，盈利到位了也不离场，仓位控制也是问题。

项目实施计划

第一阶段

我们从简单的策略开始，到达止损点坚决离场，到达买入点淡定买入，到达盈利目标退场。

- 将这种有“纪律”的交易行为，与普通股民的行为进行对比；研究其收益/总资产变化。

这样做的目的，在于确立该阶段的一个立论：有纪律的策略比普通行为好！虽然这个立论很简单，但是对这个问题所做的工作，关乎整个计划的成败。因为它是基础，程序的数据获取、测试表现都在此时形成。我们将会发现，在不同行情下，两种情况的收益并非前者最优——这就给我们进行下一阶段的计划提供了素材。