量化极客投资交易系统说明

[一、 整体逻辑框架： 2](#_Toc365842240)

[1 数据准备 2](#_Toc365842241)

[1.1 参数设置 2](#_Toc365842242)

[1.2 数据提取 2](#_Toc365842243)

[1.3 数据库维护 2](#_Toc365842244)

[2 投资分析 2](#_Toc365842245)

[2.1 宏观指标 2](#_Toc365842246)

[2.2 情绪指数 2](#_Toc365842247)

[2.3 量化行业配置 2](#_Toc365842248)

[2.4 中国合成VIX指数 2](#_Toc365842249)

[3 策略回溯测试 2](#_Toc365842250)

[3.1 策略回溯设置 2](#_Toc365842251)

[3.2 资金管理方案选择 2](#_Toc365842252)

[3.3 并行测试选择 2](#_Toc365842253)

[3.4 回溯测试执行 3](#_Toc365842254)

[3.5 回溯结果报表 3](#_Toc365842255)

[3.6 回溯数据库维护 3](#_Toc365842256)

[3.7 自动回溯设置 3](#_Toc365842257)

[4 风险管理 3](#_Toc365842258)

[4.1 合规设置 3](#_Toc365842259)

[4.2 资金管理方案选择 3](#_Toc365842260)

[4.3 交易执行监控 3](#_Toc365842261)

[4.4 实时盈亏情况汇总 3](#_Toc365842262)

[5 策略执行 3](#_Toc365842263)

[5.1 期货价差套利 3](#_Toc365842264)

[5.2 融资融券配对交易 3](#_Toc365842265)

[5.3 股指期货无风险套利 3](#_Toc365842266)

[5.4 中低频趋势交易 3](#_Toc365842267)

[5.5 Alpha对冲交易 3](#_Toc365842268)

[5.6 指数基金构建 3](#_Toc365842269)

[6 策略组合管理 3](#_Toc365842270)

[6.1 策略分配优化 3](#_Toc365842271)

[6.2 资金分配 3](#_Toc365842272)

[6.3 策略组合监控 3](#_Toc365842273)

[6.4 策略组合调整 3](#_Toc365842274)

[6.5 紧急情况处理 3](#_Toc365842275)

[7 绩效分析 3](#_Toc365842276)

[7.1 投资业绩回顾 3](#_Toc365842277)

[7.2 绩效归因 3](#_Toc365842278)

1. 整体逻辑框架：
2. 数据准备
   1. 参数设置

目前可以想象到的数据参数包括：

开始时间、结束时间、是否选取交易日、字段推荐、频率、数据库名字。

* 1. 数据提取

数据库包括期货和融资融券两个。全部是落在MongoDB中间，commodityIndex,securityMargin两个，目前都保留的是日频率数据。Genesis里retrieveDataSample就是用来落地这两个数据的。目前的字段是：open,high,low,close,volume,amt,pct\_chg,swing,vwap,oi,oi\_chg,settle。

* 1. 数据库维护

1. 投资分析
   1. 宏观指标
   2. 情绪指数
   3. 量化行业配置
   4. 中国合成VIX指数
2. 策略回溯测试
   1. 策略回溯设置
   2. 资金管理方案选择
   3. 并行测试选择
   4. 回溯测试执行
   5. 回溯结果报表
   6. 回溯数据库维护
   7. 自动回溯设置
3. 风险管理
   1. 合规设置
   2. 资金管理方案选择
   3. 交易执行监控
   4. 实时盈亏情况汇总
4. 策略执行
   1. 期货价差套利
   2. 融资融券配对交易
   3. 股指期货无风险套利
   4. 中低频趋势交易
   5. Alpha对冲交易
   6. 指数基金构建
5. 策略组合管理
   1. 策略分配优化
   2. 资金分配
   3. 策略组合监控
   4. 策略组合调整
   5. 紧急情况处理
6. 绩效分析
   1. 投资业绩回顾
   2. 绩效归因