

## 重要提示：

为避免服务器资源浪费，我们提供的课程及工具包下载进行了反爬虫验证，需要通过以下链接进行下载，需要对弹窗输入验证信息。

您可以通过以下验证信息及 URL 下载我们的课程和工具包，出于利益最大化的需求，我们需要降低此宣传服务器的资源费用支出，的服务器带宽较低，您也可以通过

<https://forms.cloud.microsoft/r/rRQjWJ7srG?origin=lprLink>

留下您的信息，我们客服会协助您通过其他方式获取。

验证账户及密码：ailianghua/ailianghua

课程下载 URL：

<https://www.ailianghua2026.com//files/protected/lecture.zip>

工具下载 URL：

<https://www.ailianghua2026.com//files/protected/toolpack.zip>

## 一、什么是量化交易？

量化交易的核心在于“量化”二字。它通过收集海量的历史数据，利用数学、统计学和计算机技术，找出那些能够带来超额收益的“大概率”事件，并将其编写成交易策略（算法）。一旦市场情况触发了这些预设条件，计算机就会自动下单执行。

它的主要工作流程通常包括：

1. **策略研发：** 建立数学模型。
2. **回测验证：** 用历史数据跑一遍，看看这个模型在过去赚钱吗，风险大不大。

3. **实盘执行：** 接入自动化交易系统，由电脑盯着盘面执行。

---

## 二、 量化交易的优点

量化交易之所以在现代金融市场（尤其是华尔街和顶级对冲基金）占据统治地位，主要是因为它解决了人类投资者的许多先天弱点：

### 1. 克服人性弱点（冷静无情）

人不是机器，在面对股市暴跌时会恐惧，在暴涨时会贪婪。量化交易严格执行程序指令，**该止损时绝不手软，该进场时从不犹豫**，完全排除了情绪干扰。

### 2. 极高的执行效率

- **反应速度快：** 计算机可以在毫秒级（甚至微秒级）完成分析并下单，这在捕捉瞬息万变的机会（如套利）时比人工快得多。
- **覆盖范围广：** 一个人同时盯着几只股票就很累了，但一个量化系统可以同时监控全球成千上万个交易品种（股票、期货、外汇、期权等）。

### 3. 策略的可验证性（回测）

在实战之前，你可以用过去 10 年的数据来“考试”你的模型。这能让你清楚地知道这个策略在牛市、熊市和震荡市的表现，从而对风险有精确的预期，而不是靠“感觉”去投机。

### 4. 严密的纪律性

量化交易具有高度的一致性。它不会因为交易员昨天没睡好或者今天心情差而改变判断标准，确保了投资逻辑在长时间维度下不走样。

### 5. 发现隐藏规律

大数据和机器学习技术可以识别出人类肉眼根本无法发现的复杂微观模式。例如，不同市场之间的微小价格波动关联，这些规律往往隐藏在海量的数据噪声中。

特点	传统主观交易	量化交易
决策依据	直觉、经验、宏观分析	数据、数学模型、统计概率
执行方式	人工下单	计算机自动下单
情绪影响	波动大，易受恐惧/贪婪驱动	零干扰，严格执行纪律
处理能力	有限，通常只能关注少数标的	极强，可同时扫描全市场
容错率	靠经验补救	依赖模型准确性与系统稳定性