

SCMS Seminar



量化投资策略和云交易

冯永昌 博士

量邦科技

Time: 10:00-11:00 a.m., Friday, October 31th, 2014

Venue: Room 2201, East Guanghua Tower (Main), Fudan University

Abstract: 量化投资策略是定量方法在投资交易中的具体使用，涉及的领域有因素选股模型，程序化交易，统计套利，高频交易等，主要用的统计方法有机器学习，协整，波动率预测，优化等。本报告简要介绍量化投资的前沿方法，和在实际中的应用。

Bio: 冯永昌博士担任包括量邦科技在内的多家金融高科技企业的董事长。中国人民银行金融研究所互联网金融博士后，毕业于中国人民大学（统计学学士）和北京大学光华管理学院（统计学博士），美国芝加哥大学访问学者。曾任美国芝加哥商品交易所 UIC 研究中心研究员，嘉实基金高级产品经理和投资经理。具有多年的量化金融投资研究和实战经验，对量化投资、对冲基金和互联网金融有着深刻的理解。发起创办了国家高科技企业量邦科技、互联网金融企业微量网、对冲基金专业服务机构对冲汇。

$$\Delta y_i = \int_{x_i}^{x_{i+1}} y' dx - \left(\sum_{j=1}^{i-1} a_{ij} x_j^{(k)} + \sum_{j=i+1}^n a_{ij} x_j^{(i)} \right)$$
$$\int_{x_k}^{x_{k+1}} f(x, y) dx = \int_{x_k}^{x_{k+1}} y' dx = y(x)$$
$$\sqrt{(y_n + 0.5\tau k_1)^2 + (t_n + 0.5\tau)^2}$$