

1997-2026

樂發財量化選股智能體

深度學習的智能量化投資決策系統

讓機構級AI策略，成為每個投資者的私人量化分析師

主講人：饒向輝

目錄 Contents



01

核心技術原理

Core values

02

核心團隊

core team

03

技術架構

Technical Architecture

04

適用客群

Applicable customer group



01 核心技术原理

Core values

核心技術原理

Core values

1. 數據建模與特徵提取

- 基於滬深A股全市場歷史日級行情數據（OHLCV），採用對抗神經網絡（GAN）挖掘短期（月頻周期）內具備超額收益潛力的股票特徵集。
- 每項特徵對應獨立量化交易策略。

2. 策略生成與驗證體系

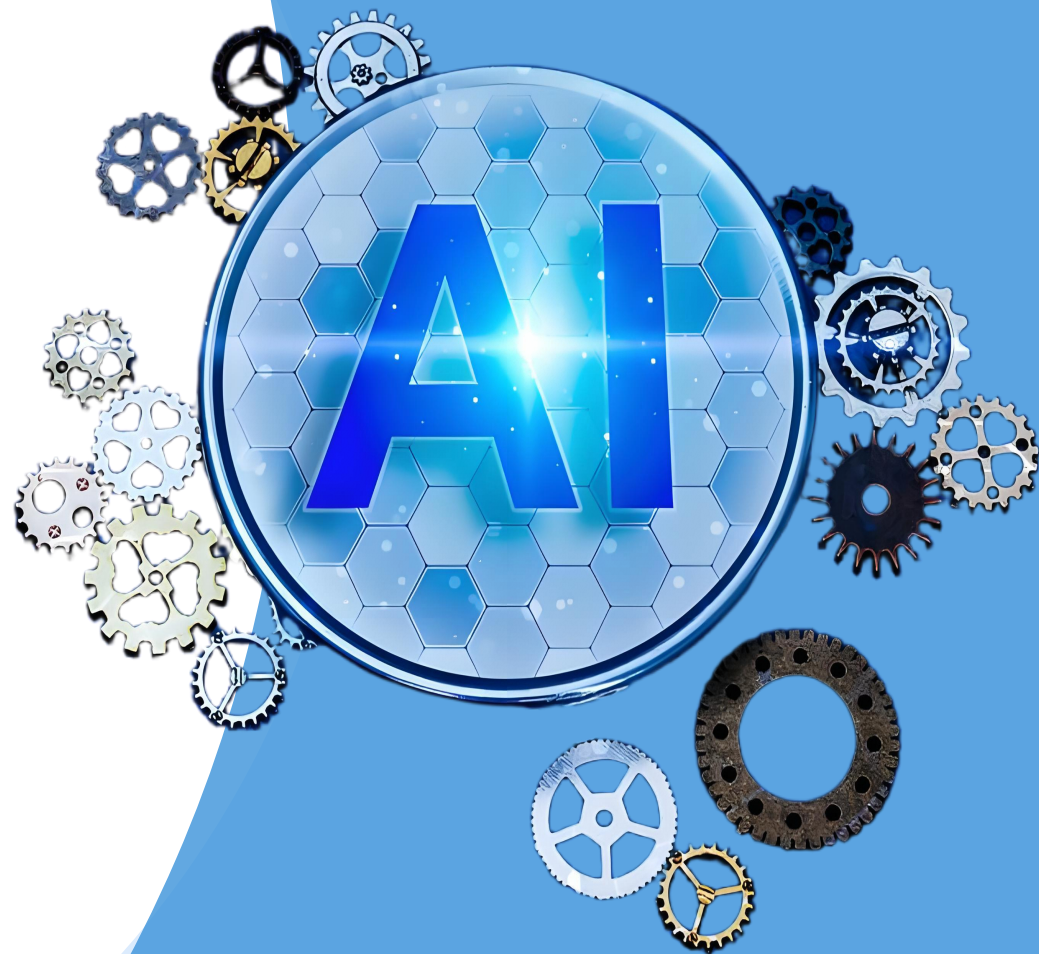
- 系統通過回歸統計引擎，對策略進行二十年以上歷史數據回測，通過實盤交易和模擬交易驗證穩定性。
- 通過勝率 $\geq 60\%$ 篩選有效策略。

3. 策略庫架構

- 當前策略庫覆蓋9,600+條選股策略，經長期實盤壓力測試。

高魯棒性策略納入生產環境。

- 策略類型主要採用：反轉策略。





02 核 心 團 隊

core team

核心團隊

core team

創始人

技術核心

饒向輝

上海科技大學 理論物理專業碩士

10年量化私募基金經理

研發基礎

理論物理思維實驗發現市場缺陷+12年量化實戰經驗

研發方式

數學建模+數據清洗+AI編程

研究分析

A股量化建模和實現

專業資格

基金從業資格，證券分析資格，中低頻交易系統發明專利

核心團隊

Team Introduction

創始人

軟件開發

江楓

上海航空電子有限公司615研究所研究專員

研发经验

12年分佈式系統架構經驗

技術特長

通用證券軟件開發能力，軟件穩定且健壯

研究分析

A股量化建模和實現

專業資格

基金從業資格，證券分析資格

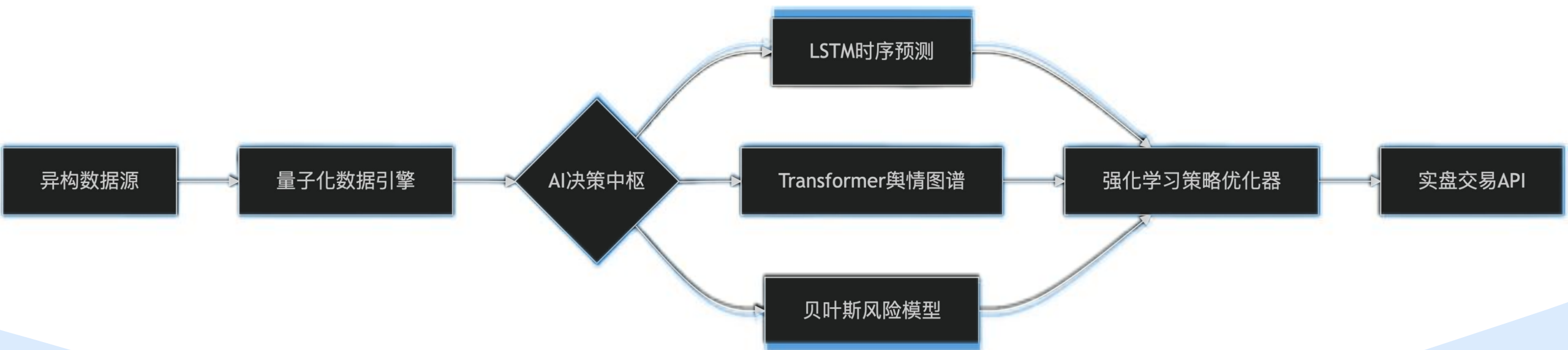


03 技術架構

Technical Architecture

技術架構

Technical Architecture



AI量化選股 vs 傳統選股的降維打擊性優勢

維度	傳統人工選股	AI量化選股系統	優勢倍數
數據處理量	10-20份研報/日	1萬+數據點/日	500倍
因子覆蓋廣度	5-10個核心因子	300+動態因子 (含另類數據)	30倍
情緒干擾	嚴重 (追漲殺跌)	零情緒 (機器紀律執行)	100%消除

核心功能特點

Technical Architecture

全自動化決策流程

交易日19:00自動同步交易所清算數據，觸發策略信號生產與組合優化。

自動化

機器交易收益歸因

每日監控持倉盈虧，自動發出止盈止損信號。

機器交易

用戶適配性設計

為尚未建立成熟交易體系的投資者提供策略沙盒功能+持倉框盈虧提示，支持歷史策略表現回歸與參數靈敏度測試，輔助用戶理解市場規律。

功能特點

樂發財量化選股智能體五大技術護城河

01 全息數據融合引擎

對象:

滬深A股全市場歷史日級行情數據

特點:

採用對抗神經網絡 (GAN) 挖掘短期 (月頻周期) 內具備超額收益潛力的股票特徵集。

應用:

每項特徵對應獨立量化交易策略

02 動態因子進化機制

對象:

機構流動性價值波動率

特點:

因子挖掘-因子淘汰

應用:

實時監控因子有效性衰減預警系統 (提前3天提示策略調整)

03 市場微观結構建模

對象:

機構/隱藏主力

特點:

應用GAN(對抗神經網絡)分析

應用:

隱藏主力探測
預測短期價格壓力
買賣牆衝擊成本

樂發財量化選股智能體五大技術護城河

04 行為金融學套利

對象:

人類行為偏差定價

特點:

AI捕捉人類行為偏差的套利空間。

如人類過度反應捕捉的情緒波動

極端值反向交易，年化套利空間

18%–22%

應用:

每項特徵對應獨立量化交易策略

05 極端環境防禦體系

對象:

黑天鵝模擬器

特點:

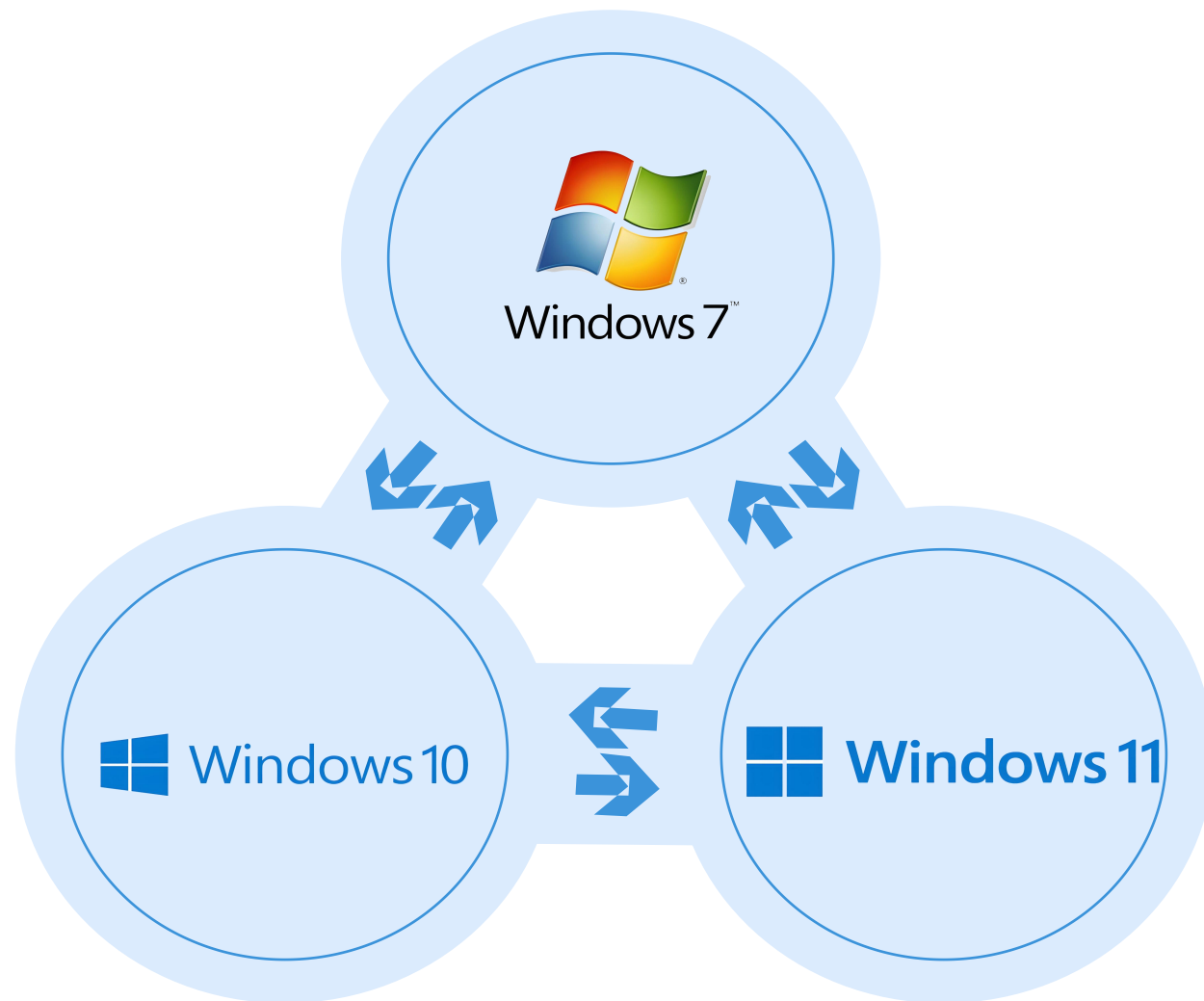
生成2015級金融危機/戰爭/疫情

等50種極端場景

應用:

動態對沖–壓力測試報告–量化展示策略最大生存回撤

運行環境





04 適用客群

Compliance and Security

應用場景與價值



機構用戶

可作為資產組合的衛星策略執行終端，提升阿爾法收益捕捉效率

個人投資者

通過紀律化交易規避認知偏差，逐步形成基於數據驅動的投資方法論

另適用客群痛點解決方案

公募基金

痛點: 指增產品超額收益衰減

鏈路: 動態因子庫+機器學習行業輪動

券商自營

痛點: 方向性交易風險過高

鏈路: 多空對沖+波動率擇時系統

家族辦公室

痛點: 定制化策略開發週期長

鏈路: 可視化策略工廠

保險資管

優點: 絕對收益要求嚴謹

缺點: 固收+AI增強策略

“
當人類分析師還在閱讀昨日財報時，我們的AI已從最新交易邏
輯中捕捉到明天的Alpha

”

——樂發財量化選股智能體



1997-2026

谢谢观看

Thanks

主讲人：饶向辉

