

京东量化平台分享

于建明



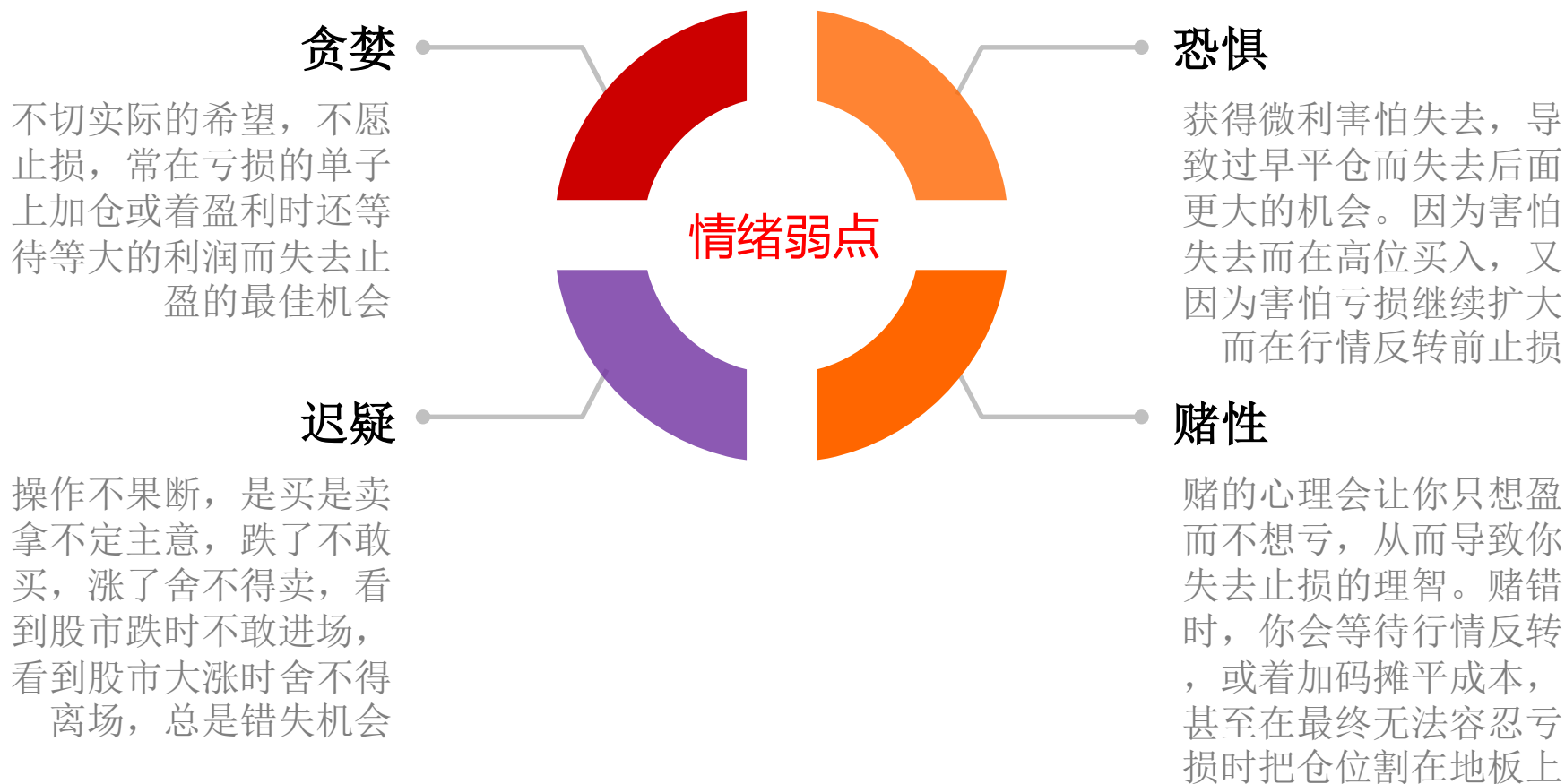
京东金融
JD Finance

CDA 数据分析师
www.cda.cn



什么是量化交易

量化交易是指投资者利用计算机技术、金融工程建模等手段将自己的金融操作作用很明确的方式去定义和描述，用以协助投资者进行投资决策，并且严格按照所设定的规则去执行交易策略的交易方式。



量化交易优势



京东金融
JD Finance



规避主观情绪



提高交易速度



复制盈利模式



降低人力成本



量化交易风险

主观交易与量化交易对比

交易方式	投资者主观交易	投资者量化交易
决策判断方式	感性/主观/恐惧/贪婪	理性/客观/数据讯号
精力与时间投入	高	低
运算速度/执行能力	缓慢	快速
交易记录/风险警示	人工手动	电脑自动
投资回报率稳定性	不稳定	比较稳定



京东量化平台业务架构

业务

历史回测

实盘模拟

研究模块

策略竞赛

在线社区

策略编写

在线编译

风险分析

模型分析

自定义数据

实盘交易消息

分享策略

用户交流

帮助文档

外部系统

京东大数据

京东股票

数库

接口

Java API

Python API

Data API

数据

历史行情数据

财务数据

实时数据

京东特色大数据



< 8.11复杂策略7

编辑策略

回测结果

回测历史

收益概况

日期: 从2015-01-01至2016-08-28 | 初始资金: ¥1,000,000.00 | 交易数据: 每天 | 用时: 23.656秒 | 回测状态: 回测完成

分享

交易详情

每日持仓&收益

输出日志

Barra归因分析

晨星风格箱分析

策略收益

Alpha

Beta

Sharpe

Sortino

Information Ratio

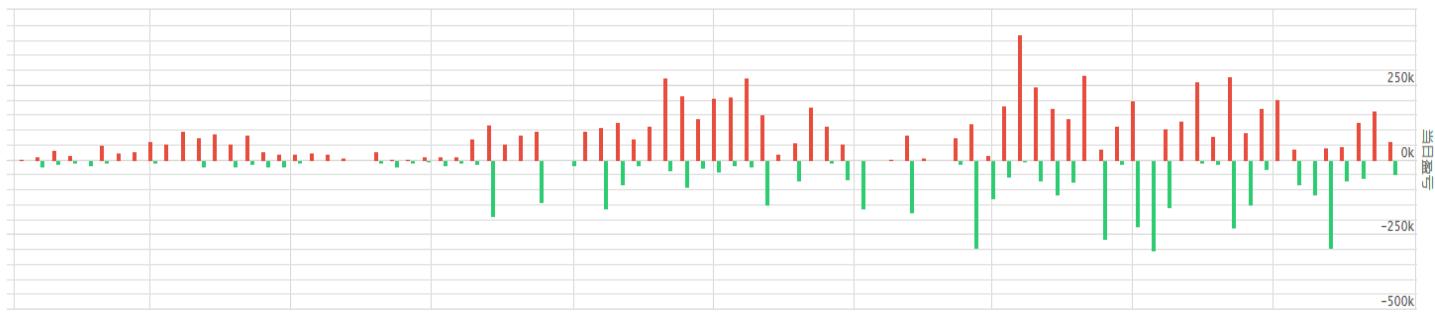
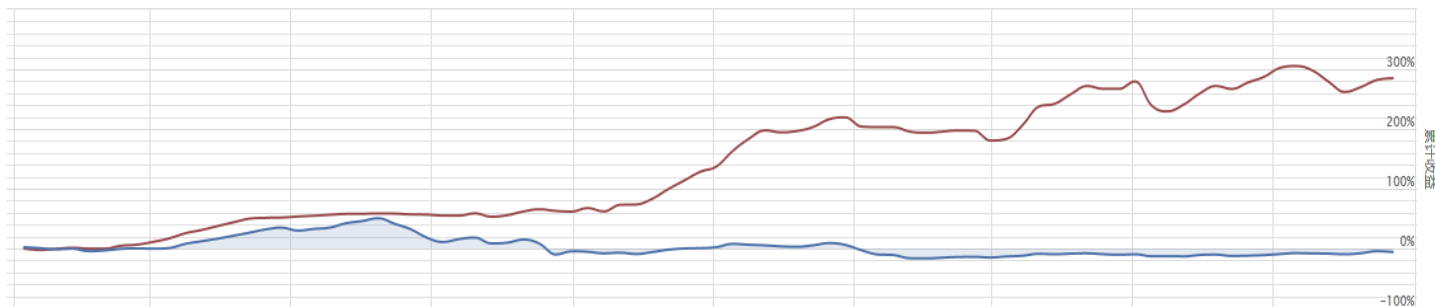
Volatility

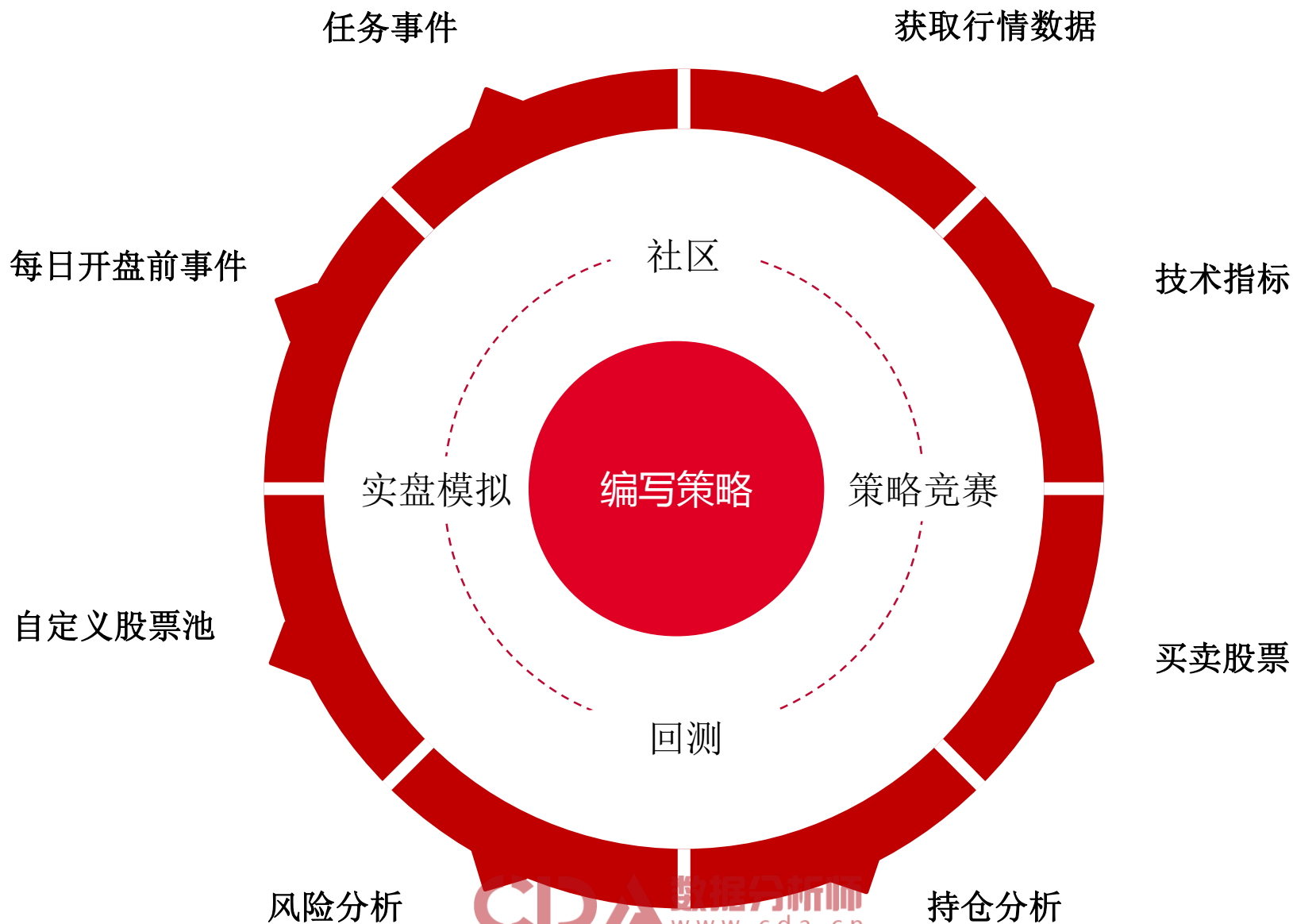
最大回撤

回测收益	回测年化收益	基准收益	Alpha	Beta	Sharpe	Sortino	InformationRatio	Volatility	最大回撤	TrackingError	DownsideRisk
287.04%	132.12%	-6.41%	1.3246	0.4146	2.9861	4.0823	2.6495	28.82%	17.18%	32.66%	21.08%

缩放 1周 1月 3月 6月 1年 全部

从 2015-01-01 到 2016-08-28







谢谢



京东金融
JD Finance

CDA 数据分析师
www.cda.cn