

高质量合成数据与应用供应商

AI-Based Synthetic Data/Application Vendor

“

基于生成式AI的人造合成数据与应用一站式解决方案

”



北京宽客进化科技有限公司
Quant Evolving Technology Co., Ltd.

*本资料版权归北京宽客进化科技有限公司所有

宽客进化是基于生成式人工智能 (Generative AI) 与金融量化技术结合的机器学习技术公司，金融合成数据与应用提供商、沙盒运营商。

- 提供金融市场合成数据与对抗博弈环境、场景智能体解决方案
- 服务证券市场投资机构、政府经济治理、证券市场监管、金融科研
- 中关村高新技术企业，国家高新技术企业，Nvidia加速器成员、证券行业智能量化解决方案提供商

愿景：

“合成金融人造数据、构建市场平行世界，加速金融投资的人工智能发展”

国内第一个金融 “合成数据库、合成装置”

- 基本面
- 股票、指数
- 期货

- 多周期
- 多指标
- 多资产

- GANs
- GARCH
- Bootstrap

- 保真性评价
- 多样性评价

价值：机器复杂思考的生产要素

细分：

• 隐私保护

• 构建特定场景

• 海量多样性

• 增广增强

•

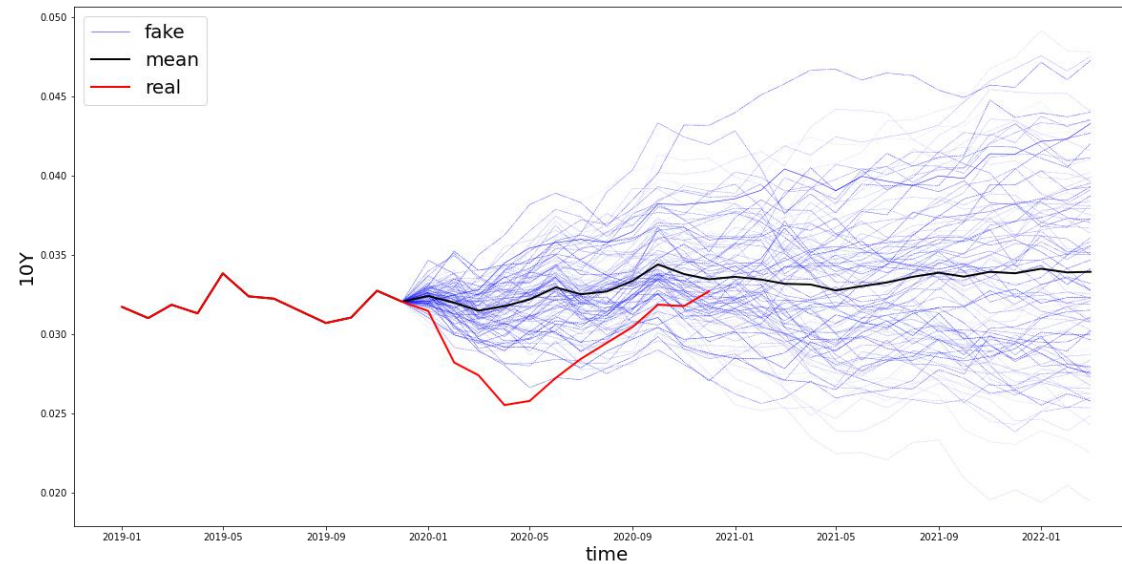
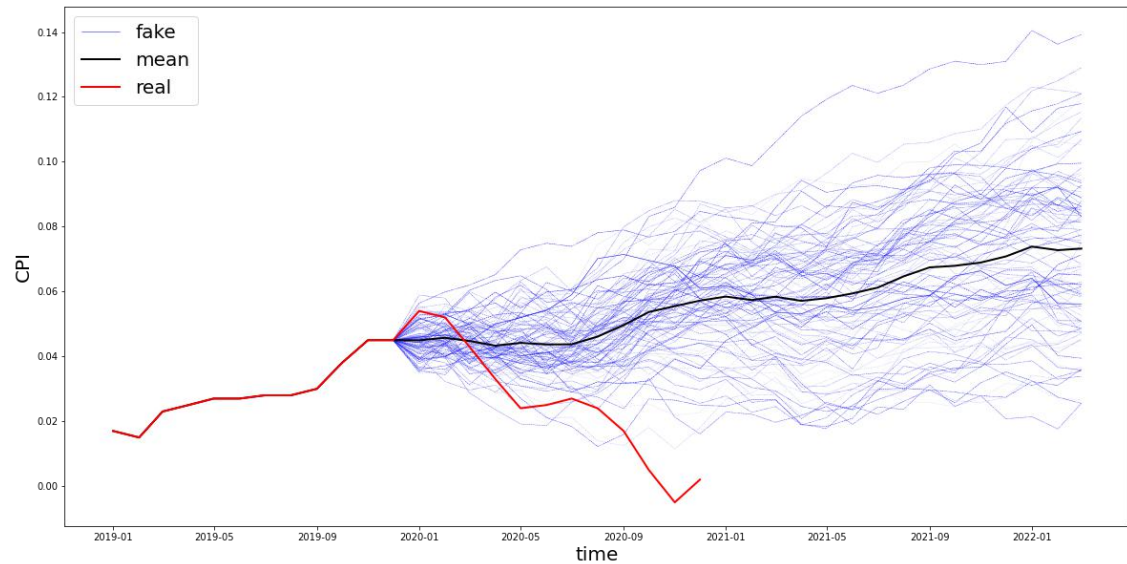
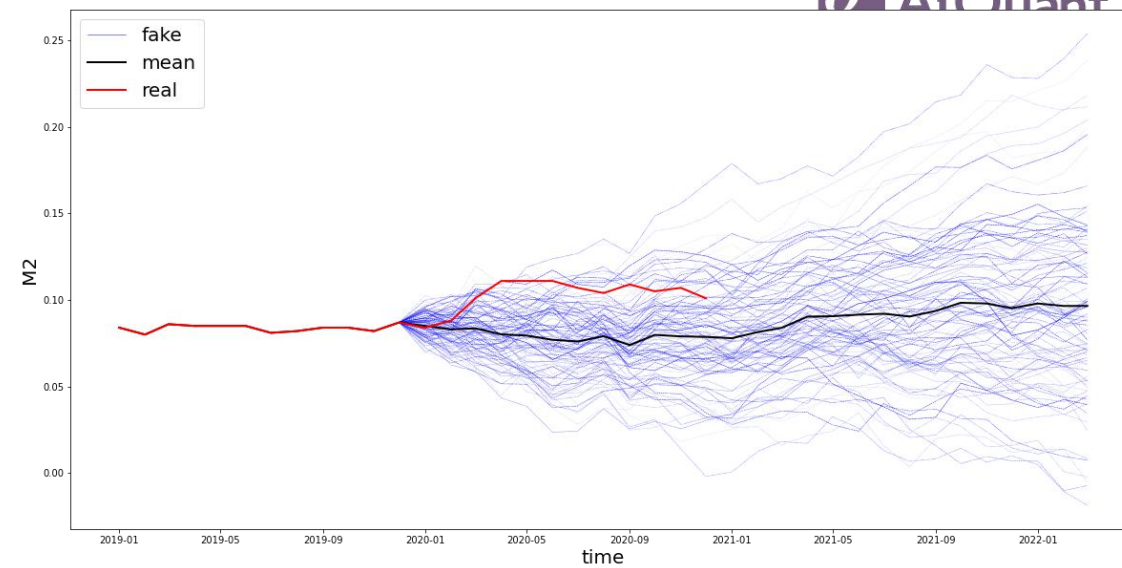
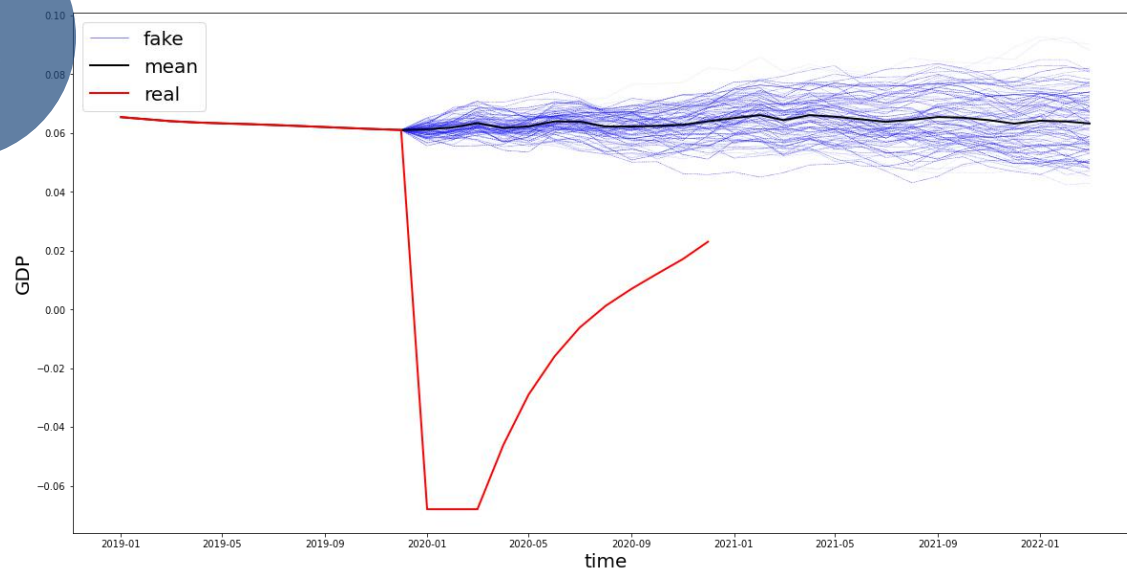
“在合成金融市场行情数据的实际应用中通过深度地学习训练数据内在的统计规律，生成了股票、期货、多周期、多资产、多指标时间序列数据。其中采用 NVIDIA A100 Tensor Core GPUs 大幅提升了训练和生成合成数据的效率。”

飞扬初创魅力,展示企业风采

2021 年 11 月 23 日



产品展示





产品展示

回测过拟合率
计算

策略参数筛选

策略市场表现

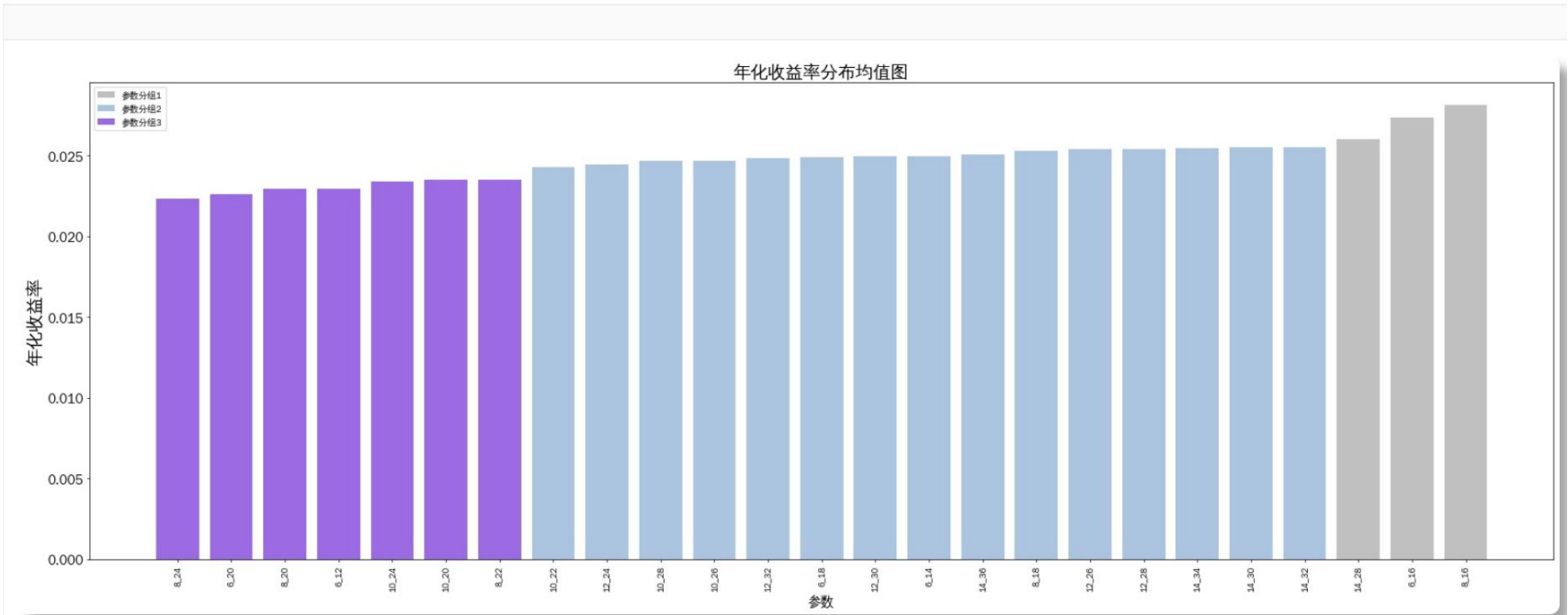
参数递进优化

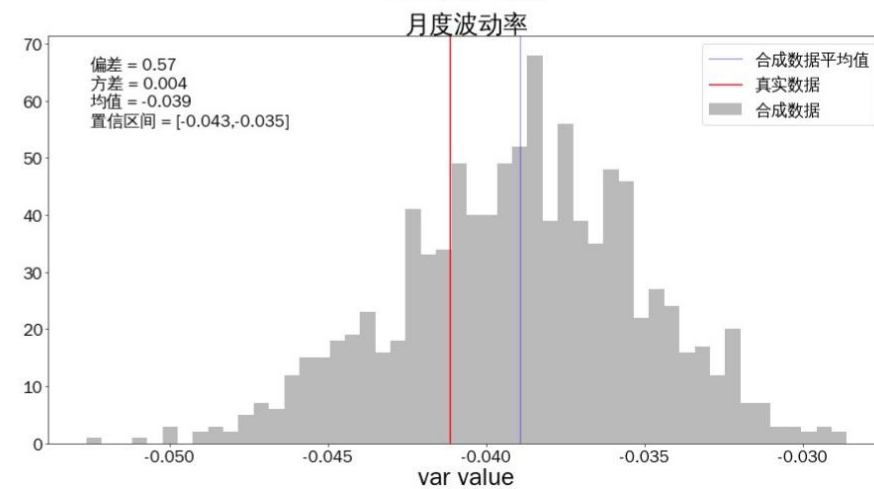
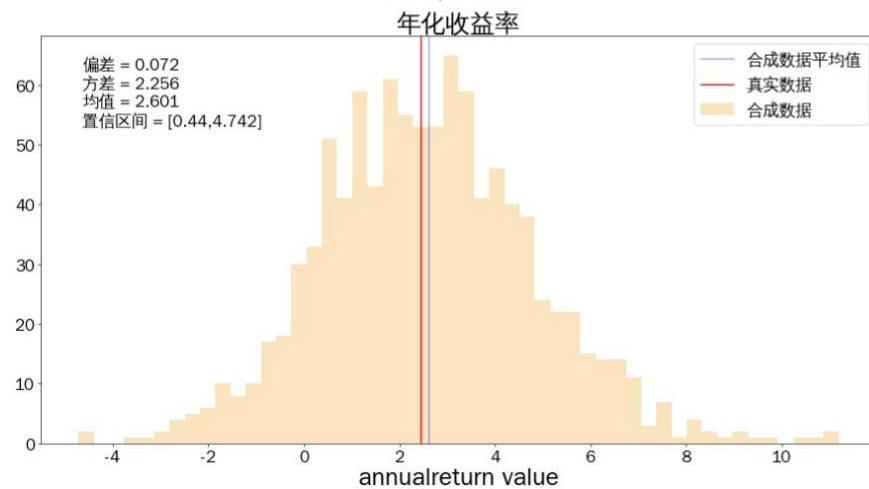
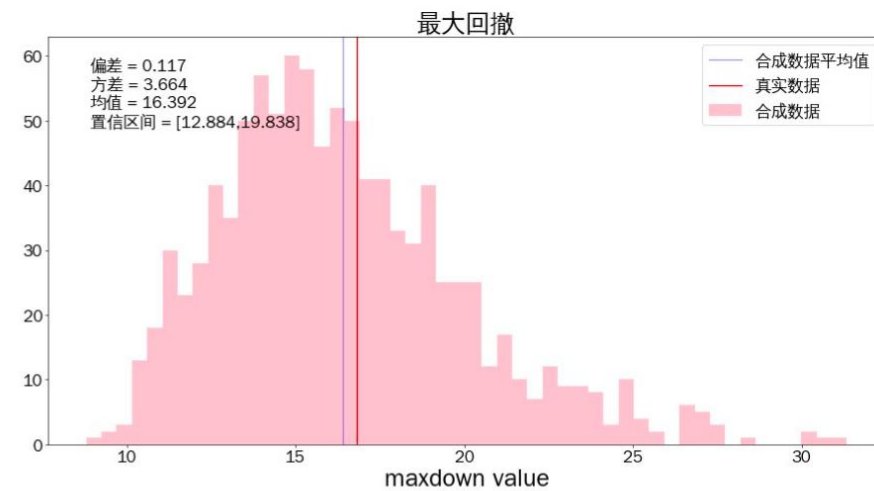
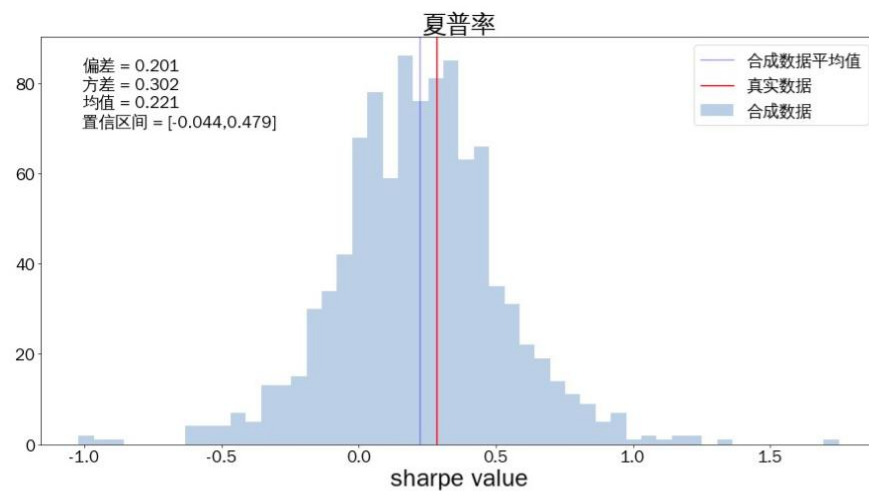
回测统计分布结果

策略MACD在合成数据集回测统计分布排序

以下三张图是策略在每组参数下回测结果的收益率、夏普率、最大回撤三个维度的统计分布均值排序，其中综合排名较好的参数组作为优选参数会在表中单独显示，您可以点击查看策略此参数下的具体表现；您也可以通过参数递进优化进一步优化优选参数；

策略名	优选参数	操作
MACD	6_16 8_16 14_28	参数优化





⊕ 回测过拟合率
计算



④ 策略参数筛选



📊 策略市场表现



🔍 参数递进优化

回测结果详情

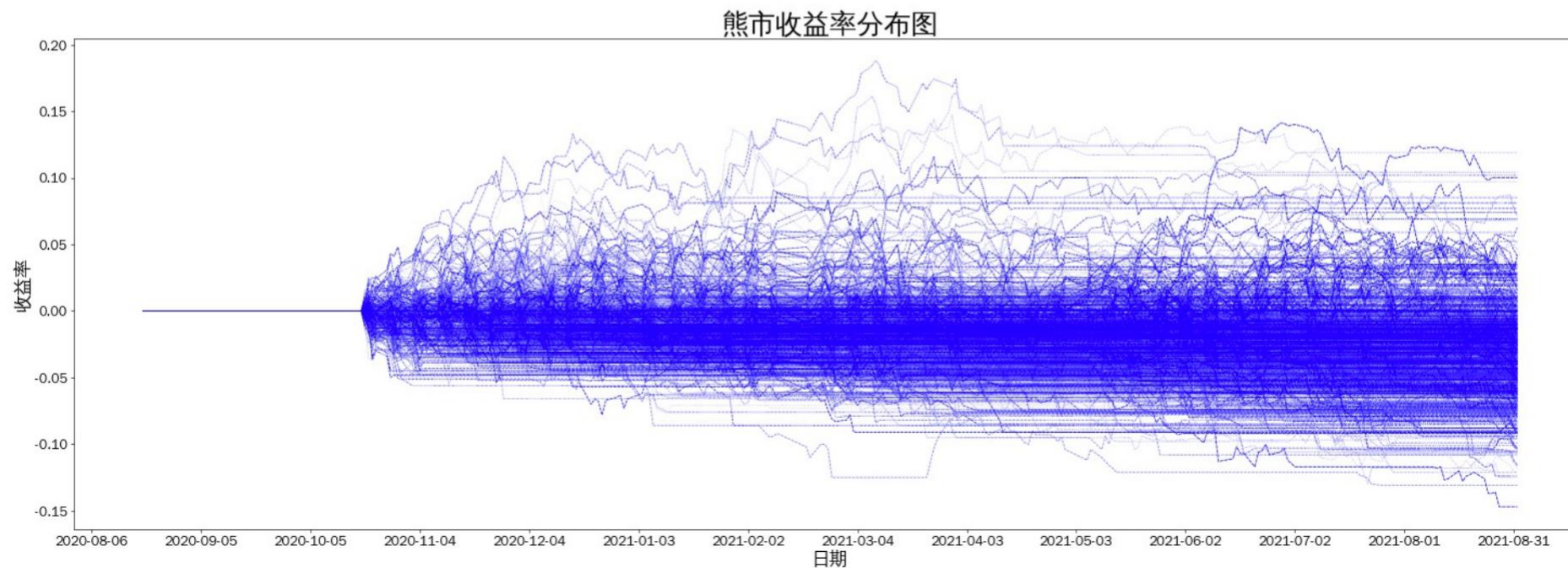
牛熊市场表现

压力市场表现

风险偏好

策略**MACD (14_28)** 在牛市、熊市的表现 (ks检验结果 $p=0.5353$ 牛市表现好于熊市)

牛市、熊市数据集是通过历史数据样本推演未来一年的牛市、熊市的合成数据



⊕ 回测过拟合率
计算



Ⓢ 策略参数筛选



📊 策略市场表现



🔍 参数递进优化

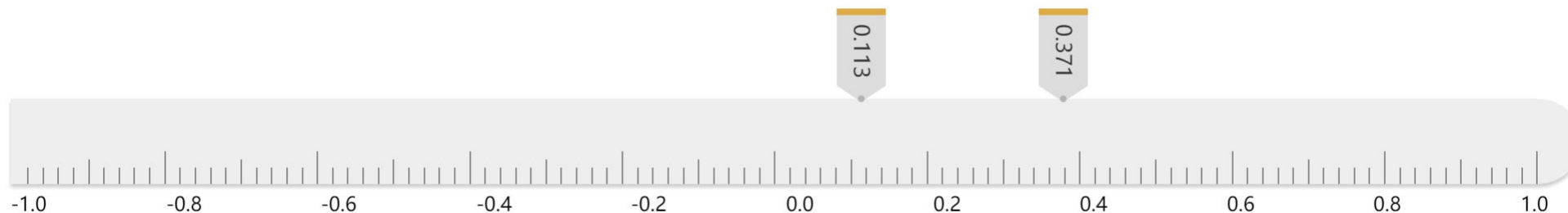
回测结果详情

牛熊市场表现

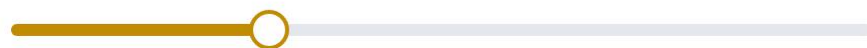
压力市场表现

风险偏好

策略**MACD (6_16)** 根据您的风险偏好设置最大回撤和置信区间来查看夏普率表现



* 最大回撤



* 置信区间



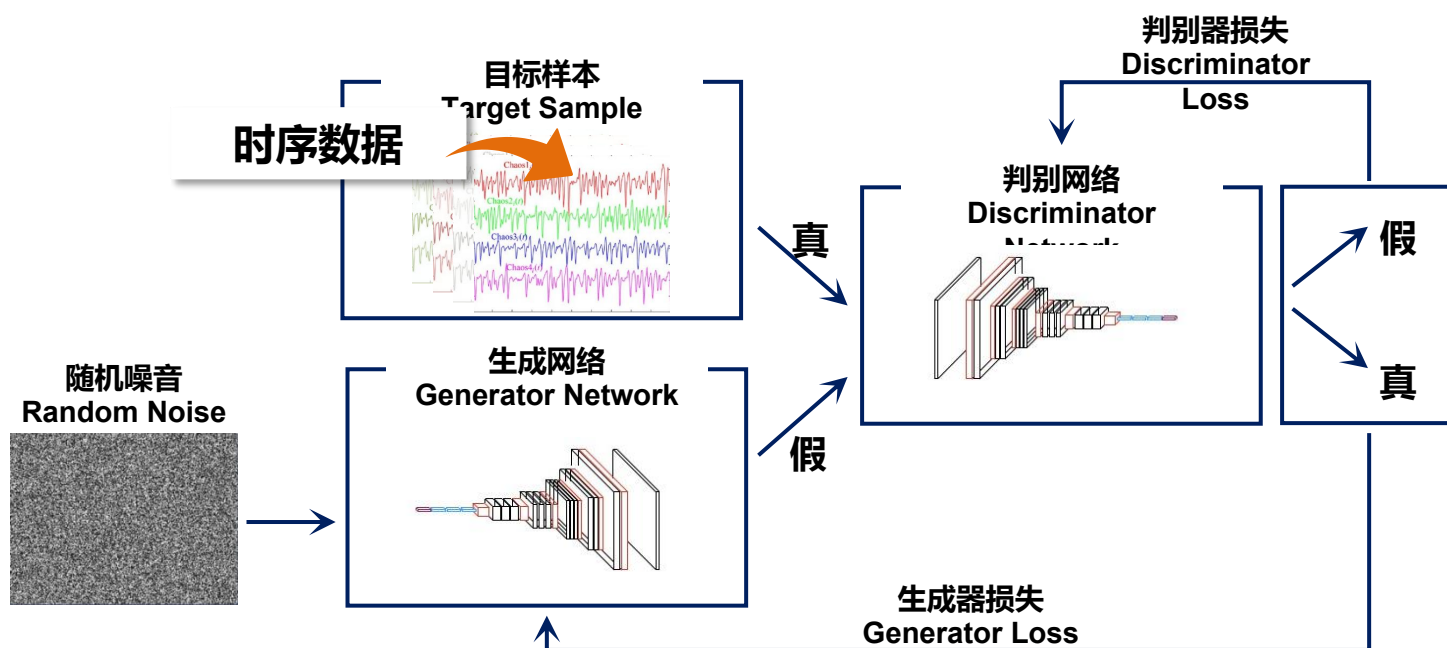
利用对抗网络技术+时序数据分析生成高保真多样跟踪合成数据

核心技术

跟踪方向

“技术成果覆盖前沿文献，达到国际一流水准”

生成对抗网络（GAN）结构



测试交易策略的稳健性

- GANs for testing trading strategies robustness.

投资组合构建方法比较

- GANs for comparing portfolio construction methods.

估计投资组合或策略的风险

- GANs for estimating the risk of a portfolio or a strategy.

期权和其他衍生品的替代定价和对冲

- GANs for alternative pricing and hedging of options and other derivatives.

生成真实的报价和交易序列

- GANs for generating realistic sequences of quotes and trades.

回报预测，或产生交易信号

- GANs for returns forecasting, or generating trading signals.

基础数据异常检测

- GANs for detecting anomalies in fundamental data.

插补缺失数据（例如，在替代数据集中）

- GANs for imputing missing data (e.g. in alternative datasets).

治理数据（例如异常值检测）

- GANs for curating data (e.g. outliers detection).

