

实习基地运营情况报告

报告日期：2019 年 10 月 28 日

成都正福金融工程应用研究院

目录

一、社会实践基地介绍.....	1
二、实习生基本情况.....	2
三、实习项目.....	2
四、实习生交流会.....	3
五、研究成果.....	6
六、实习生的未来发展.....	7
七、研究院亟待解决的问题.....	7
附录一：	8
附录二：	12

一、社会实践基地介绍

成都正福金融工程应用研究院社会实践基地于 2018 年 12 月 13 日正式运营，社会实践基地位于高新区孵化园盈创动力金融科技大厦内，社会实践基地与地铁孵化园站相邻，室内宽敞明亮，为实习生们提供了良好的学习环境。成都正福金融研究院一直致力于为寻求务实经验和量化金融知识的求学者提供一个学习的机会和实践平台，进而能够为中国金融科技行业的发展注入新的能量。在成都高新区管委会、成都市政协、成都市民进市委会、高新区财政金融局的支持下，社会实践基地的落成使得成都正福金融工程应用研究院吸纳了更多的优秀人才，同时也使得更多的求学者获得了机会了解金融科技的前沿。

研究院现已与西南财经大学、四川大学、电子科技大学、西南交通大学、四川师范大学等高校达成院校合作关系，为实习生提供公益的实习岗位。四川师范大学MBA教育中心、电子科技大学“国家大数据研究中心”、西南财经大学经济数学学院、西南交通大学“金融大数据研究院”、四川大学就业中心等已在研究院社会实践基地挂牌。





授权实验室挂牌

二、实习生基本情况

研究院全力开展金融科技人才的培养和储备工作，大力推动金融工程在年轻一代中的影响。研究院项目管理办公室设置专人负责开展院校教培实习工作，免费接纳全球各院校的学生参与学习和研究院工作。到目前为止研究院已收到 270 多份来自海内外高校在校大学生的实习申请，其中已有 82 人在研究院完成学习实践工作，完成实习的同学中其中有 16 位同学来自海外各大高校，如新南威尔士大学、澳大利亚国立大学、巴黎高等商学院、英属哥伦比亚大学、南加州大学等；其余的同学来自国内省内外各大高校，如四川大学、西南财经大学、电子科技大学、江西财经大学、中国人民大学、北京工商大学、武汉大学、香港城市大学、浸会大学等。

三、实习项目

研究院目前主要开展的实习项目有为大宗商品市场提供风险管理服务的期货交易与量化分析，以及使用人工智能技术开展的大数据分析中国优秀上市公司现状和投资者情绪热度相关的 A 股市场智能投顾项目。面向的专业为：经济学、金融学、金融工程、金融数学、应用数学、统计以及计算机等

专业，实习的主要内容有：大数据建模学习、风险管理模型构建、风险管理策略模型评估、数据挖掘及数据分析，计算机深度学习中的参数回测及优化，以及市场实盘应用一致性保障和程序化研究等。实习项目时长由2个月到9个月不等，由研究院的资深导师进行授课，导师们有着扎实的专业知识和丰富的从业经验，通过让学员进行一些金融大数据基础分析方法的学习，培养实习生对金融、统计、数学、计算机编程、大数据分析等金融工程相关专业的兴趣，了解这些知识的应用场景，掌握简单的大数据分析方法和程序化模型编写。实习结束之后，研究院出具注明学员参与专业基础知识学习内容的实习证书。

四、实习生交流会

第一次实习生交流会

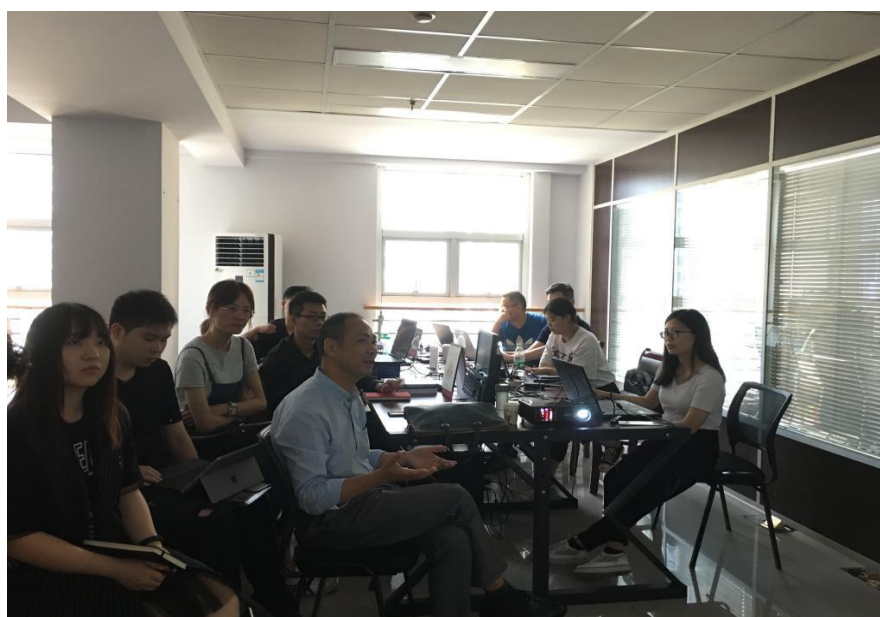
第一次实习生交流会于2019年4月12日在研究院社会实践基地召开，此交流会主讲人为高宇、罗晓慧、张彬彬、王涵、陈可逸等同学，其目的旨在了解实习生们的研究进度，研究策略模型的成果展示以及探讨策略模型成果中的不足之处以及解决办法。此次实习生交流会，郑刚院长、苗东老师以及邓文兵老师亲自为实习生们答疑解惑，分享自己从业以来的一些交易经验和宝贵建议。



第一次实习生交流会：院长为罗晓慧同学指导策略模型

第二次实习生交流会

第二次实习生交流会于2019年7月10在研究院社会实践基地举行，此次交流会的主要目的在于了解实习生们的实习进度同时也为新来的实习生指明实习方向和提供策略模型思路。主讲人为李明煌、廖悦含、廖炯臣、周书威等同学，此次交流会通过对同学的自己的策略模型讲解，不仅加深了对策略模型的理解，也为其他同学的策略模型提供了新的思路。



第二次实习生交流会：院长点评实习生的策略模型

第三次实习生交流会

第三次实习生交流会于2019年7月18日在研究院办公室举行，此次交流会的主讲人为来自美国天普大学福克斯商学院的王振俊同学，该同学在研究院实习期间，开展利用Python语言爬虫工具对气象信息大数据进行收集整理，并将气象数据导入金字塔决策交易系统开展对相关农产品期货价格变化影响的研究工作。研究院郑刚院长和吴旭老师对王振俊同学的系统构建给了许多的优化建议。

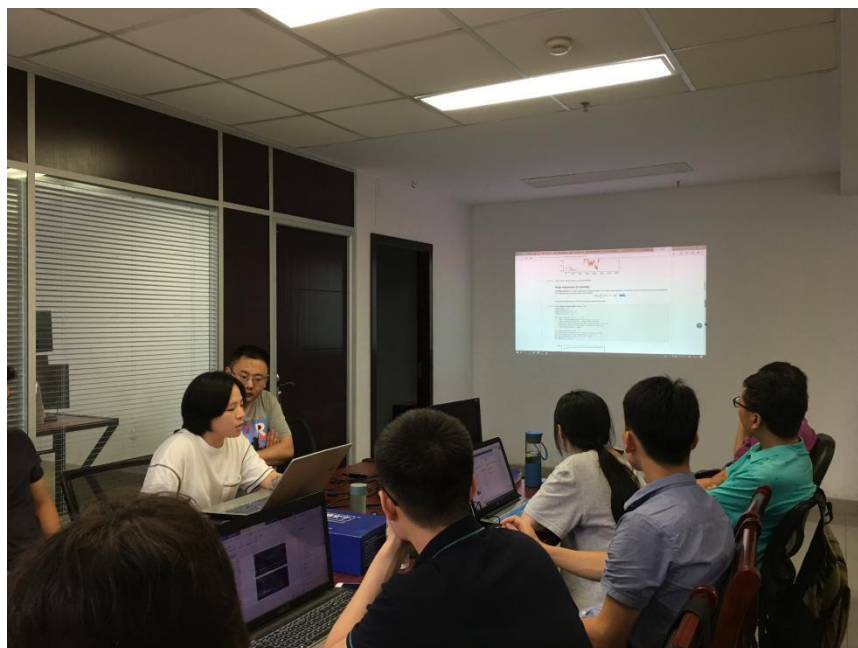


第三次实习生交流会：王振俊同学的策略分享

第四次实习生交流会

第四次实习生交流会于2019年8月21日在研究院社会实践基地召开，此次交流会的主讲人为来自西南财经大学的杜谦、李元凯、马冰蕊同学以及来自四川大学的罗羽萱同学和来自北京工商大学的张俊方等各大高校的优秀青年翘楚。李元凯、马冰蕊、孙天奇、罗羽萱、许智伟同学向我们展示了基于传统布林通道、唐奇安通道改进的量化分析策略模型；杜谦同学向大家展示了统计学中的线性回归方程在A股市场中的应用；谢慧玲同学向大家展示

了基于爬虫技术分析上市公司在投资者中讨论热度对股票的影响；张俊方同学也在此次交流会中向大家介绍了他基于Python在资产配置中的研究成果。



第四次实习生交流会：杜谦同学正在讲解自己的策略模型

此次交流会的主要人员还有郑院长、白晓毅教授、苗东老师，两位老师分享了自己从业二十多年来对国内大宗商品期货市场、A股市场以及外汇市场的感受和经验，同时还分享了写期货分析决策系统量化交易策略模型的思路。在交流会开展过程中，三位老师单独的对每位同学的策略模型进行了指导，指出了同学们的策略模型一致性不足之处并给出了解决问题的办法，同时还给同学们分享了一些最佳策略模型组合的经验，此次实习生交流会同学们受益匪浅，不仅了解到了一些新的风险管理策略模型方法，还解决了自己的写量化分析策略模型中所遇到的瓶颈。

五、研究成果

1. 同学们根据自己对二级市场的一些理解和结合在学校学习的知识，通过PYTHON语言开展大数据分析研究并编写出了自己的风险管理量化分析策略模型。

2. 同学们根据自己所学知识以及自己的研究兴趣，在基于Python语言的基础上成功研究出了气象的变化对农产品价格的影响的相关性。

3. 顺利完成“A股智能投顾项目”的一期工程架构工作，对项目进行分布式服务器布局，各算法模块的构架以及对项目的设计

4. 对一期工程系统架构进行服务器算力分布式布局管理及代码的编写。通过 MYSQL 数据库构建分布式数据保存和采集模式，通过导入使用数据库的工具，扩展在金字塔系统工具的研究工作。

六、实习生的未来发展

实习生们在研究院实习结束之后，有的同学则参加工作，成为优秀的风险管理专业人员、大数据分析建模工程师，有同学的继续回高校深造，何子秋同学去了英国国王大学学习数据分析，贾舒雅同学在上海财经大学攻读金融硕士研究生，许鑫同学去了英国杜伦大学，周星运同学在美国南加州大学攻读博士学位。同学们在研究院实习了一段时间之后，对金融工程以及大数据分析有了深刻的了解和认识，对自己的职业生涯有了更明确地规划。

七、研究院亟待解决的问题

1. 与研究院合作的大专院校在假期推荐学生来研究院实习的同学较多，研究院的社会实践基地学习场地紧张，盼望高新区政府能继续给予政策支持，为实习生们创造一个更好的学习条件，研究院培养更多的金融科技人才，为高新区的金融科技人才培养和储备工作作出更大的贡献。

2. 随着假期实习的同学增多以及研究院的研究工作越来越深入，研究院的研究设备和设施也非常紧缺，希望政府能给予一定的资金支持，帮助研究院建设更完善的人才培养基地，以推动成都市的金融科技的发展！

附录一：

实习生名单					
序号	姓名	实习项目	学校	专业	实习时间
1	周星运	期货交易与 量化投资	南加州大学	应用数学	2018.2.2—2018.4.27
2	许鑫	期货交易与 量化投资	财大金服	杜伦大学 (durham)	2018.3.1—2018.4.20
3	黎茜茹	期货交易与 量化投资	西南财大金工	金融工程	2018.7.2—2018.8.3
4	李上垣	期货交易与 量化投资	四川大学锦江 学院	金融	2018.7.3—2018.8.24
5	陈俊宏	期货交易与 量化投资	电科信息与计 算科学	电子科技大学金 融学	2018.6.4—2018.8.31
6	郑又铭	期货交易与 量化投资	西南财大金工	金融工程	2018.7.2—2018.8.3
7	许旭	期货交易与 量化投资	西南财经大学	数理金融硕士	2018.7.23—2018.8.22
8	王珂	期货交易与 量化投资	西南财经大学	数理金融硕士	2018.7.23—2018.8.23
9	刘峻琳	期货交易与 量化投资	四川理工学院	投资学	2018.7.31—2018.8.31
10	郭廷	期货交易与 量化投资	电子科技大学	电子科学	2018.8.13—2018.10.12
11	邓攀	期货交易与 量化投资	西南财经大学	经济学基地班	2018.8.16—2018.9.8
12	张林	期货交易与 量化投资	西南财经大学	国际商务	2018.8.16—2018.10.19
13	张大循	A股市场智能 投顾	香港城市大学	应用经济学硕士	2018.8.17—2018.12.14
14	何子秋	A股市场智能 投顾	浸会大学	金融数学	2018.8.27—2018.12.14
15	王琢	期货交易与 量化投资	新南威尔士大 学	金融规划	2018.12.10—2019.1.11
16	童云昶	期货交易与 量化投资	东南大学	统计	2018.12.3—2019.2.1
17	叶生杰	期货交易与 量化投资	淮阴师范学院	经济学	2018.12.6—2019.2.1
18	杜诗琪	期货交易与 量化投资	西南财经大学	金融院（硕士）	2019.1.21—2019.2.22
19	向夏佳	期货交易与 量化投资	西南财经大学	金融学（本科）	2019.1.2—2019.2.1
20	肖维	期货交易与 量化投资	澳大利亚国立 大学	金融（硕士）	2018.12.17—2019.2.15
21	贾舒雅	期货交易与	上海对外经贸	保险学（本科）	2019.1.21—2019.2.21

		量化投资	大学		
22	罗晓慧	期货交易与 量化投资	宁波大学	国际商务(硕士)	2018. 1. 3-2019. 07. 12
23	黄来兮	期货交易与 量化投资	华东师范大学	数学与应用数学	2018. 12. 17-2019. 1. 25
24	牛钰	期货交易与 量化投资	西南财经大学	金融学 (本科)	2019. 1. 16-2019. 3. 1
25	林潇	期货交易与 量化投资	(海外) 阿德 莱德大学	金融学(硕士)	2018. 12. 24-2019. 2. 21
26	李瑞鑫	期货交易与 量化投资	哈尔滨金融学 院	投资学 (本科)	2019. 1. 2-2019. 3. 8
27	赖端	期货交易与 量化投资	巴黎高等商学 院	金融学(硕士)	2019. 1. 3-2019. 3. 29
28	陈可逸	A股市场智能 投顾	西南财经大学	金融学 (本科)	2019. 1. 7-2019. 4. 26
29	文爱娜	期货交易与 量化投资	电子科技大学	金融学 (硕士)	2019. 1. 21-2019. 2. 22
30	高震	期货交易与 量化投资	江西财经大学	资产评估(硕士)	2019. 1. 16-2019. 2. 22
31	王 涵	A股市场智能 投顾	西南财经大学	金融工程(本科)	2019. 1. 16-2019. 4. 26
32	许潭	期货交易与 量化投资	云南财经大学	金融工程(本科)	2019. 1. 16-2019. 3. 15
33	但昭文	期货交易与 量化投资	西南财经大学	金融学 (本科)	2019. 4. 8-2019. 5. 17
34	张雨童	A股市场智能 投顾	四川大学	金融工程(本科)	2019. 2. 11-2019. 6. 6
35	邱勇	期货交易与 量化投资	西南财经大学 天府学院	金融学 (本科)	2019. 2. 11-2019. 3. 29
36	高宇	期货交易与 量化投资	西南财经大学	金融学 (本科)	2019. 3. 4-2019. 5. 17
37	杜芷仪	期货交易与 量化投资	湖南大学	金融学 (本科)	2019. 2. 11-2019. 4. 12
38	张彬彬	期货交易与 量化投资	西南财经大学	信用管理(本科)	2019. 2. 18-2019. 4. 19
39	彭佳雯	期货交易与 量化投资	江西理工大学	金融工程(本科)	2019. 2. 18-2019. 4. 26
40	陈楠	期货交易与 量化投资	成都信息工程 大学	国际经济与贸易 (本科)	2019. 3. 4-2019. 4. 29
41	吕琳	期货交易与 量化投资	四川大学	机械工程(本科)	2019. 3. 1-2019. 5. 31
42	凌世宸	期货交易与 量化投资	西南交通大学	机械工程(本科)	2019. 3. 1-2019. 5. 31
43	张麟嘉	期货交易与 量化投资	成都信息工程 大学	金融工程(本科)	2019. 3. 1-2019. 5. 31

44	黄伟儒	期货交易与 量化投资	四川大学经济 学院	金融学（本科）	2019.3.1-2019.5.31
45	裴付升	期货交易与 量化投资	西南财经大学	金融学（硕士）	2019.3.4-2019.4.26
46	周善禹	期货交易与 量化投资	西南财经大学	金融学（硕士）	2019.3.5-2019.4.30
47	徐杰	期货交易与 量化投资	山西大学	数学与应用数学 （本科）	2019.3.5-2019.4.30
48	公子琪	A股市场智能 投顾	四川大学	金融工程（本科）	2019.3.12-2019.6.14
49	刘思淇	期货交易与 量化投资	成都信息工程 大学	金融工程（本科）	2019.3.18-2019.5.17
50	宗卓哲	期货交易与 量化投资	武汉理工大学	经济学（本科）	2019.7.2-2019.8.1
51	鲜怡晖	期货交易与 量化投资	西南财经大学	金融学（本科）	2019.7.29-2019.8.29
52	张福祥	期货交易与 量化投资	成都理工大学	通信工程（本科）	2019.4.22-2019.6.21
53	袁骁	期货交易与 量化投资	莫纳什大学	风险管理（硕士）	2019.7.16-2019.10.18
54	王振俊	期货交易与 量化投资	美国天普大学 福克斯商学院	金融分析研究生	2019.5.29-2019.8.1
55	柳智超	A股市场智能 投顾	中国人民大学	金融学（本科）	2019.6.12-2019.8.29
56	廖炯臣	期货交易与 量化投资	西南财经大学	经济学（本科）	2019.5.27-2019.7.12
57	谢慧玲	期货交易与 量化投资	四川农业大学	财务管理（本科）	2019.7.15-2019.8.22
58	倪赵义	期货交易与 量化投资	四川农业大学	金融学（本科）	2019.7.16-2019.8.16
59	廖悦含	期货交易与 量化投资	宾夕法尼亚州 立大学	金融统计双专业 （本科）	2019.5.13-2019.7.12
60	杨思成	期货交易与 量化投资	罗格斯大学	数学金融（硕士）	2019.6.24-2019.8.1
61	李杨	A股市场智能 投顾	成都理工大学	金融学（硕士）	2019.6.17-2019.8.19
62	周书威	期货交易与 量化投资	英属哥伦比亚 大学	经济学（本科）	2019.6.17-2019.7.18
63	马金凤	期货交易与 量化投资	四川大学锦城 学院	金融学（本科）	2019.7.8-2019.8.30
64	李明煌	期货交易与 量化投资	美国特拉华大 学	金融学（本科）	2019.6.27-2019.8.9
65	白之玉	期货交易与 量化投资	麦吉尔大学	金融学（本科）	2019.7.22-2019.8.9
66	许智伟	期货交易与	西南科技大学	金融学（硕士）	2019.7.8-2019.8.30

		量化投资			
67	张峻方	期货交易与 量化投资	北京工商大学	金融学(本科)	2019.7.8-2019.8.30
68	谢艾玲	期货交易与 量化投资	西南财经大学	国际商务(硕士)	2019.7-2019.9.6
69	舒馨	A股市场智能 投顾	电子科技大学	电子信息工程- 金融学复合专业	2019.7.10-2019.8.20
70	马冰蕊	期货交易与 量化投资	西南财经大学	数学与应用数学 (本科)	2019.7.15-2019.8.30
71	赵启钰	期货交易与 量化投资	西南财经大学	数理金融学(硕 士)	2019.7.29-2019.9.12
72	Yann Aymar	期货交易与 量化投资	西南财经大学	金融工程(本科)	2019.7.15-2019.9.27
73	杜谦	期货交易与 量化投资	西南财经大学	数学专业, 计算 机方向(硕士)	2019.7.15-2019.8.27
74	李元凯	期货交易与 量化投资	西南财经大学	管理科学与工程 (硕士)	2019.7.15-2019.8.30
75	周波	期货交易与 量化投资	重庆工商大学 荣智学院	金融CFA专业 (本科)	2019.7.16-2019.8.23
76	郑翔	期货交易与 量化投资	加州大学戴维 斯分校	统计学(本科)	2019.7.22-2019.10.25
77	胡兴悦	期货交易与 量化投资	西南科技大学	经济学(本科)	2019.7.23-2019.8.15
78	罗羽萱	期货交易与 量化投资	四川大学	金融工程(本科)	2019.8.5-2019.8.30
79	王宇博	期货交易与 量化投资	西南财经大学	金融工程(本科)	(大四答辩实习) 2020.3
80	孙天奇	期货交易与 量化投资	UIC	电子商务与信息 系统管理(本科)	2019.8.5-2019.8.30
81	郭思辰	期货交易与 量化投资	西南财经大学	经济学与数学 (本科)	2019.8.12-2019.9.10
82	宋婉瑜	期货交易与 量化投资	西南财经大学	国际商务(本科)	2019.9.11-2019.9.30
83	王涵宇	期货交易与 量化投资	四川工商学院	金融工程(本科)	2019.10.14-2020

附录二：

实习报告（一）

从6月17日至7月19日，我在研究院实习了大约五周的时间。我用了前两周的时间把《期货市场技术分析》这本书读了一遍，然后在第三周开始研究自己的交易策略。通过对这本书的学习和在金字塔上的模拟交易，我对期货市场与其价格变化有了了解。并且从模拟操作中积累了一些经验，让我对交易操作从陌生到了解，再到之后每一次交易都会形成自己对市场的想法和判断。

在设计自己的交易策略之前，我对《金字塔初级教程》进行了学习，一边读一边编写自己的公式，并且在写自己的公式的同时在网上查一些书上没有介绍的指标和交易思想。在用金字塔自带的公式之前，搞懂其背后的原理。在写策略的过程中，有一段时间钻了牛角尖，导致自己卡壳了几天都没有进展，但是我随后在郑老师组织的实习生技术策略分享会上受到了老师和同学的启发，最后在短短一两天内我的策略就有了很大的进步。最后做到了MAR比率提高到超过了1，交易次数超过了500次，回撤在13%左右，利润率在300%左右。我的策略还需要更深入的研究与思考，使交易次数越大越好，回撤越小越好，而且在启动程序化交易运行中，出现了不能执行交易的情况，也就是一致性的问题，这一点还有待改善。

在研究院实习的时间虽然很短，但是收获颇丰。不仅是学到了知识，思想也有一定提高。因为郑老师在交给我们知识和技术的同时也传授给

我们了关于做期货的思想和一些人生的觉悟，对我也有深刻的影响。比如做期货不能眼里只盯着利润，而是做好风控，剩下的自然是利润；或者是人在有能力之后不能只想着自己的利益，也要想着为这个社会做点什么。此外，我在实习期间也感受到了团队合作带来的好处。在最后一两周，我在写策略的时候经常和同事交流，互相提供思路，最终达到了一加一大于二的效果。并且后来我会根据自己的经验给新同事提供力所能及的帮助，在这个过程中既能让别人少走不必要的弯路，又能让自己把知识记得更牢固，理解的更深入。所以我认为，选择在正福金融工程研究院实习是一个很好的决定，更让我学习到了很多学校里学不到的知识与经验。

周书威

07/19/2019

实习报告（二）

一、 实习目的

- 1、 锻炼自己的动手能力，将学习的理论知识运用于实践当中，反过来检验书本上理论的正确性。将自己的理论知识与实践融合，培养自己发现问题、解决问题的能力，加强对所学专业的认识。
- 2、 了解二级市场，更广泛地接触金融行业，了解目前金融行业的大环境，加深行业认识，培养自己的实践能力，为今后进一步进入社会打下坚实的基础。
- 3、 了解金融行业目前的发展走向，为自己未来的职业规划起到关键的指导作用。
- 4、 通过与同事的交流明晰大家在做什么，以此为参考制定自己下一阶段的学习目标。

二、本次实习主要完成了两个方面的学习：

1、 程序化交易策略的编写

在金字塔软件进行模拟交易后初步感知、了解了二级市场。学习了《期货市场技术分析》，系统地了解了整个期货市场及分析市场的模型和相关技术指标。在完成基础学习后通过金字塔 PEL 语言进行编程，形成了自己的基于肯特纳通道和 RSI 指标组合的基础模型。

2、自学了《SQL 必知必会》，对数据库的基本操作和功能有了初步认知。将程序分块完成，将不同板块放于不同服务器上运行，同时用数据库建立起各个板块的连接，充分利用远程服务器端的效率，降低单台服务器宕机风险。（具体过程涉及保密协议不再赘述）

在这 6 周的实习过程中，我也遇到了很多大大小小的困难和问题，比如

数据库的连接问题、由数据不全导致的程序运行问题、python 和 mysql 语言结构协调问题。最初遇到这些问题的时候比较头疼，但是经过一点一点的查询、试错，一步一步解决好这些问题。经过这一阶段的实习，我发现自己解决问题的能力明显提高，遇到问题首先不是急躁，而是寻求解决问题的方法。同时在周围优秀同学的影响下，我进一步明确了自己的目标，学会放平自己的心态，善于向他人学习。善于与他人合作交流也是我此次实习过程比较顺利的一个重要原因。与此同时，在这次的实习过程中我明白了学习和运用的重要性。从前在学校学的东西都很抽象，知道 camp 模型，知道货币政策，知道基础 python 知识，知道边角料问题如何用建模然后用运筹学软件解决，可是我从没如此真切地感受到自己在学校所学地知识能带来什么价值——无论是于我个人来说还是对整个社会而言。这次实习让我感受到“知识就是财富”，在学校学的东西只是很基础的知识，我们不能寄希望于课堂上的那点知识带给我们多大的回报。课堂上的东西只是“扫盲”，为我们提供一个思维方式，真正要学到些什么，主要还是靠自己的学习能力和解决问题的能力。这次一起实习的有很多优秀的同学，美国的本科生、加拿大的本科生、川大的本科生、西财的研究生等等。他们有的是文科生却自学编程，有非常优秀的编程能力；有的是数学专业，有很好的运用数学知识构建模型的能力；有的已经拿到了澳大利亚的硕士 offer；有的在学习 ACCA, CFA 准备考取相关证书。这次实习，我不但学到了很多金融领域的知识，还从优秀同学的身上学习到了很多，进一步对自己的未来有了更明确的规划。

舒馨

2019 年 8 月 21 日

实习报告（三）

一、行业方面

通过在正福金融工程实验室近一个月的实习，我对公募，私募以及基金经理这个岗位的现状以及未来的发展趋势有了更深入的了解。

二、技术方面

技术方面是我实习一个月中感触最深的一点，首先是对 K 线的分析，K 线是市场参与者的行为记录，四个价格在机器进行操作时的顺序设置；K 线密集的区域对之后价格走势的影响以及怎么在盘中让机器进行分析操作。其次，是对道氏理论与波浪理论的应用，也是对趋势的分析。通道的上轨与下轨如果被击破要开始判断是否趋势开始转变以及通道是否会变大，第五浪与 ABC 浪结束以后走势可能会怎样都是需要考虑的问题（在之后的学习中会自己深入研究这些问题）。重中之重，就是对数据的分析，数据的一致性是一再强调的问题，也是很多基金经理最终失败的坑。一年的交易量一定要在 500 次以上！足够多的数据才能支持大数定律，得到正的期望收益。

三、金融模型

无论是股票还是期货，都离不开很多基础的模型，其中时间序列模型是最重要的模型，对时间序列要有正确的认识（分清楚动态与静态），对时间序列的不正确认识也是很多策略看似合理一直涨不回头但现实中无法操作的原因。其次就是 MACD, MA 等模型的分析，认识多个模型的本质以及结合多个模型做出决策提高胜率也是非常重要的一点。

四、风险管理

“我们的本职工作是做好风险管理，收益是自然产生的”，在院长

对市场的分析，观摩了机器的多次交易以及学习了很多风险管理的案例以后，我非常认可这句话。做好风险管理在任何交易中都是首要的任务，在策略中一定要体现出风控点，净值曲线有因为风控带来的小幅下跌也是 OK 的，期货公司极短的寿命也说明了很多人在风险管理这方面做不好栽了跟头。而且根据自己在大学里对目前我国对风险管理的重视程度来说，确实这一块做的不是很好，企业对此也不是很重视（我们金融行业目前的风险敞口也很大），风险管理也将成为日后较有潜力的发展方向之一。

五、社会认知

院长反复强调我们要做对社会有贡献的人，而不是拿着高学历与高薪却做着危害社会的事情。为期一个月的实习不仅仅教会了我很多交易技术的知识，更多的也让我见识了成功的投资者的品行与对社会进步的推动。

贾舒雅

2019 年 2 月 23 日