

服务能力简介

量化分析 · 风险管控 · 算法交易系统

Alpha & Beta 归因分析

尾部风险 管控框架

期权与 期货系统

Python 自动化 及 API 对接

欣安量化 是一家量化分析与技术咨询公司，专注服务小型对冲基金、家族办公室及活跃自营交易者。

我们将实验物理的研究方法引入金融市场——将用于稀有事件探测的统计严谨性、假设检验与系统化验证，应用于投资组合分析、风险管控与交易系统设计。所有交付物均达到生产级标准：模型严谨、代码可靠、分析结果可直接落地执行，无黑箱。

01 服务内容

01 量化投资组合分析

Alpha/Beta分解、夏普与索提诺比率分析、因子敞口归因及基准相对表现报告，覆盖股票、期权与期货。

02 风险管控与对冲

尾部风险管控框架、动态对冲触发机制（均线交叉、VIX 体制信号）、保护性期权结构设计，适用于纯多头及杠铃型投资组合。

03 算法交易系统

覆盖信号生成、策略回测至实盘执行的完整开发流程，支持 IBKR、Alpaca 及定制券商 API 对接。

04 期权策略构建

备兑开仓、保护性看跌、Wheel 及价差策略。含 Greeks 管理、GEX 分析与系统化自动展期。

05 宏观环境与市场体制监测

地缘政治事件建模、美联储政策仪表盘、收益率曲线分析及大宗商品/外汇叠加信号，整合至投资框架。

06 定制研究与回测

基于假设驱动的策略研究，配合滚动前向验证、蒙特卡洛压力测试与机器学习信号构建。

02 交付成果

每次合作均产出真实可用的交付物，而非束之高阁的报告。代码附完整文档并移交客户。模型逻辑清晰透明，无依赖，无黑箱。

📅 月度风险报告

涵盖绩效归因、Greeks 敞口、市场体制指标、对冲有效性评估及前瞻情景分析。

📊 实时监控仪表盘

实时追踪盈亏、Delta 敞口、对冲状态与宏观叠加信号，多端适配。

⚡ 事件预警通知

可配置的 VIX 骤升、均线交叉、地缘政治触发及持仓超限预警，自动推送。

🤖 生产级自动化脚本

附完整文档与单元测试的 Python 系统，含 API 集成与监控钩子，完整移交。

📖 策略研究备忘录

涵盖研究假设、方法论、样本内外测试结果及实施建议，达到学术级严谨标准。

🎓 入职培训与知识传递

系统化知识传递，确保客户团队深入理解每一个模型与参数，实现独立运营。

03 工作方法

01 诊断与梳理

对现有投资组合进行全面审计，梳理风险敞口与策略逻辑。理清现状，方能规划下一步。

02 量化建模

统计分析、信号研究与因子构建，全部经过样本外验证。成本与滑点假设保守审慎，结果可信。

03 系统化实施

Python 自动化、API 集成与实时监控仪表盘，交付生产级代码，覆盖延迟优化与容错处理。

04 持续校准

市场环境持续演变，系统亦需同步迭代。定期重新校准模型，结合实时绩效归因与系统化复盘周期。

04 收费方案

所有合作均从一次免费的 30 分钟策略通话开始。费用透明固定，无按小时计费的不确定性。

诊断评估

\$2,500

一次性服务

- 全面投资组合风险审计
- Alpha / Beta / Sharpe / Sortino 报告
- 回撤与尾部风险分析
- 书面建议备忘录
- 60 分钟结果汇报电话

月度顾问

\$4,500

每月 · 随时可取消

- 含诊断评估全部内容
- 月度风险归因报告
- 对冲监控与实时预警
- 每月 1 个生产级自动化脚本
- 期权策略审核
- 宏观体制监控仪表盘
- 每周例行沟通

定制开发

\$15,000+

按项目计费，范围按 SOW 约定

- 定制化策略研究与回测
- 完整算法开发及实盘部署
- 仪表盘与监控基础设施
- 团队培训与完整交接
- 上线后 90 天技术支持

05 服务对象

小型对冲基金

系统化策略开发、API 自动化、风险归因、尾部风险对冲叠加

家族办公室

杠铃型组合管理、期权收益策略、多账户整合看板、宏观环境监控

活跃自营交易者

NQ/ES 期货分析、Greeks 监控、GEX 与期权流分析、定制执行脚本

06 关于欣安量化

欣安量化由实验粒子物理领域的研究人员创立，团队具备稀有事件探测的专业背景——在这一领域，统计严谨性是基本要求，而非可选项。同样的科学方法论，现在应用于投资组合分析、策略验证与风险建模。

欣安量化以技术与分析咨询公司身份运营，并非注册投资顾问。所有交付物均为分析工具与系统，投资决策权完全由客户自主掌握。

专业背景	实验物理 / 稀有事件探测 / 统计建模
市场方向	股票、期权、NQ / ES / CL 期货、ETF
技术栈	Python · NumPy · SciPy · Pandas · IBKR API · Alpaca API
核心方法	系统化 · 模型驱动 · 体制感知 · 样本外验证
机构类型	技术与分析咨询公司（DBA：欣安量化 / Shion Quant）
所在地	美国圣地亚哥 · 远程服务全球

重要声明

欣安量化为技术与分析咨询公司，所提供服务包括量化工具、模型、代码及研究报告。本文件及任何交付物均不构成投资建议、证券买卖推荐或投资顾问服务。所有投资决策完全由客户自主做出。欣安量化并非注册投资顾问。

准备好开始了吗？

每次合作均从一次免费的 30 分钟策略通话开始。

电子邮件

contact@shionquant.com

官方网站

shionquant.com