

# 爱玩特

## AINVEST

AI金融大数据分析量化投资系统



## 项目介绍



爱玩特是最初于**2016年**成立于北美波士顿的Fintech公司。核心成员由北美常春藤PhD，北美银业，和对冲基金管理人构成。进入中国市场后，吸引了国内互联网巨头，顶级券商精英人士加盟。

我司专注于为金融机构和个人带来**全自动AI分析引擎**。用户只需要输入行业经验，由AI引擎匹配**大数据和深度学习**技术，形成应用在具体智能金融场景的人工智能大数据定制化方案。

新一代主打产品“**一刀智投3.0**”，可提供投研选股+调仓风控+自动交易+监控报告的一站式**自动智能投资服务**。平台上有丰富的优质AI大数据投资策略，均由常春藤PhD开发，经过严苛优选才得以面世。投资者可自由选择、切换投资策略，并实现一键启停的全自动交易，无需盯盘，一键盈利。一刀小管家每日自动生成交易报告，投资者可随时监测盈亏，收益率，交易情况等。“一刀智投3.0”投研投资系统在C端服务于从中小股民到高净值专业投资者，在B端广泛服务于私募基金，家族办公室，信托等各类资管公司。

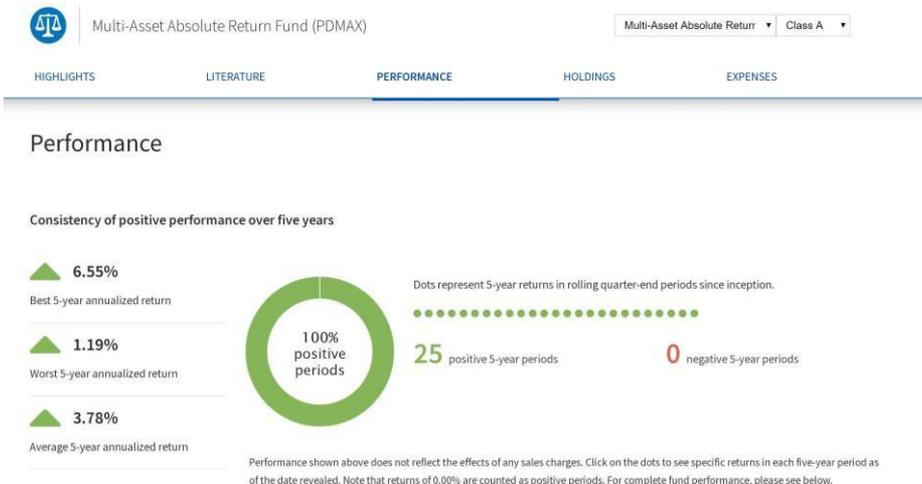
## 北美AI技术+本土金融经验的复合型团队



雷宗

背景	<b>门萨会员,FRM</b> 金融风险管理师 十年中美二级市场投资经验, 第三代AI智能投资的最早一批探索者 (2016)
经历	AInvest (爱玩特AI投资) 创始人; <b>美国Putnam Investments</b> 量化基金管理;
学历	美国华盛顿圣路易斯大学金融数学硕士 北大经济学学士

就职于波士顿Top3基金Putnam Investments时, 参与管理的多资产绝对收益基金 (“PDMAX”) 规模150亿美金, 业绩实现25年无论牛熊100%正收益, 多次被华尔街报道。要负责基金中的美股、大宗商品量化策略。





## 北美AI技术+本土金融经验的复合型团队



李斌-合伙人



Tim Li-首席AI科学家



Andi Zhang-AI科学家



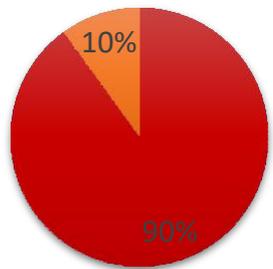
周依-运营经理

背景	<p>师从诺贝尔经济学奖获得者<b>罗伯特.席勒</b>教授，擅长大数据体系搭建、资产配置与风控</p>	<p>在<b>长短期记忆网络</b>、高维大数据降维、随机模拟等领域发表15篇文章</p>	<p>在<b>AutoML</b>机器学习模型优化，<b>NLP</b>自然语言处理等领域发表9篇文章</p>	<p>负责对接国内外大型机构客户、整合客户需求和解决方案</p>
工作经历	<p>海航集团创新金融事业群总经理； <b>京东金融证券事业部</b>总经理； 美国雷曼兄弟固定收益部量化； 耶鲁大学投资基金会资产配置</p>	<p><b>Fidelity AI</b>大数据技术总监，美国规模第二大资产管理公司； <b>NetBrain</b> 首席数据科学家</p>	<p><b>LexisNexis</b> 首席数据科学家； <b>Edwards Equifer</b> 算法工程师</p>	<p>美国高盛分析师 北京高华证券大客户经理</p>
学历	<p>美国耶鲁大学经济金融学PhD</p>	<p>美国波士顿大学物理学<b>博士</b> 美国东北大学博士后</p>	<p>美国佐治亚理工大学工程学<b>博士</b></p>	<p>美国杨百翰大学公共管理硕士</p>



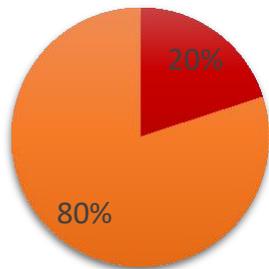
## 难题

中国基金比例



■ 主观投资 ■ 量化基金

美国基金比例



■ 主观投资 ■ 量化基金



美国的今天就是三年后的中国。如今美国量化基金占比80%以上，而国内量化不到10%

加强监管下，主观投资的内幕、庄股等旧手法难以继续，主观基金面临量化转型难题，缺技术缺人才，缺少数据库、缺少自动交易架构

## 量化转型整体解决方案

大数据数据库

量化投资策略

自动交易系统

量化人才团队

我们一站式解决量化投资技术问题，提供策略、数据、交易、人才培养，帮助主观投资机构实现量化转型



# 一刀智投 3.0

来自投资黑客的第三代智投技术革命

产品视频: <https://static.ainvestcn.com/yidao.mp4>



产品截图-用户报告



23.57%

累计收益

4.5%

最大回撤

沪深300指数增强



产品截图-交易日



23.57%

累计收益

4.5%

最大回撤

交易日志

10/30	+500.00	卖出万科股份200股, 价格27.50。
10/28	+1011.13	卖出合金股份500股, 价格4.75。
10/20	-203.12	卖出美的电器300股, 价格55.31。
10/18	+1320.13	卖出哈空调3000股, 价格5.01。
10/15	-375.00	卖出春风动力300股, 价格34.12。

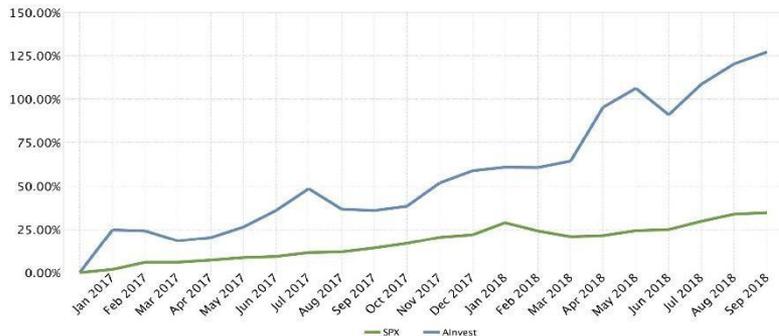
产品截图-策略商城





# 美股实盘表现

## Cumulative Benchmark Comparison



Date	SPX	AInvest
Jan 2017	1.90%	24.66%
Feb 2017	5.94%	24.04%
Mar 2017	6.07%	18.44%
Apr 2017	7.16%	20.22%
May 2017	8.66%	26.47%
Jun 2017	9.34%	35.82%
Jul 2017	11.59%	48.46%
Aug 2017	11.93%	36.65%
Sep 2017	14.24%	35.92%
Oct 2017	16.91%	38.40%
Nov 2017	20.49%	51.73%
Dec 2017	21.82%	58.86%
Jan 2018	28.79%	60.97%
Feb 2018	24.05%	60.67%
Mar 2018	20.90%	64.35%

## Key Statistics

Beginning NAV:	78.82
Ending NAV:	89.22
Cumulative Return:	127.06%
1 Month Return:	3.08% (Sep 2018)
3 Month Return:	18.91% (Jul 2018 - Sep 2018)
Best Return:	24.66% (Jan 2017)
Worst Return:	-7.95% (Aug 2017)
Deposits/Withdrawals:	0.00

2017.1到2018.9创始人用自有资金在美股  
实盘跑AI算法，获得累计回报**127%**。

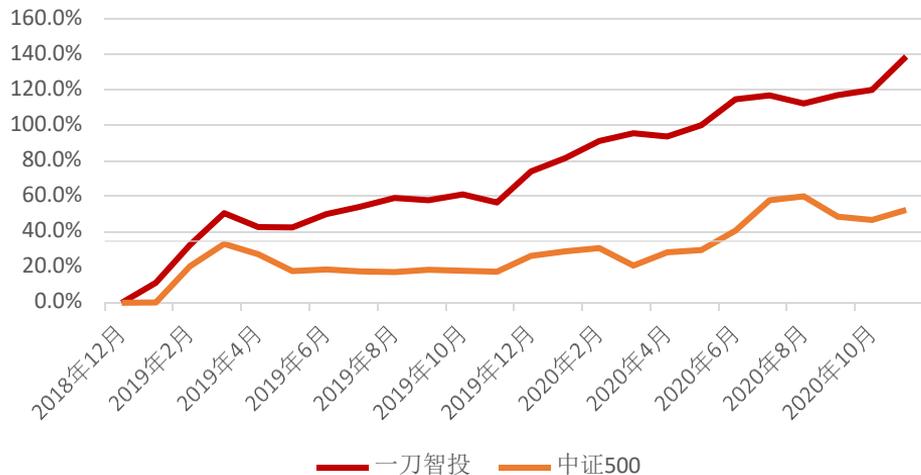
2018.10成立公司正式启动。

\*数据来自Interactive Brokers券商官方报告



## A股实盘表现

### 一刀智投v.s.中证500指数



	一刀智投	中证500
年化回报率	44.5%	25.7%
最大回撤	13.2%	21.7%
回报回撤比	3.37	1.19

从美股到A股，我们将原本的AI算法框架通过迁移学习，在中国A股数据上进行了二次开发和优化，2019.1至今实盘投资年化收益约为大盘1.7倍，并且最大回撤（风险）约为大盘的60%，投资效率（收益/风险）约为大盘的3倍。



## CTA期货策略实盘表现



### 一刀智投期货

年化回报率	38.9%
最大回撤	9.91%
回报回撤比	3.93
相关性	

\*我们从2018年底开始布局CTA期货量化策略，从主攻国际期货到同时覆盖国内期货，目前3年稳定实现年化回报率38.9%，，最大回撤为9.91%，连续三年实现正收益。

\*CTA策略对股票策略是很好的补充，相关性很低、仅为0.07，组合在一起能实现“1+1>2”的分散风险效果



## AI技术架构

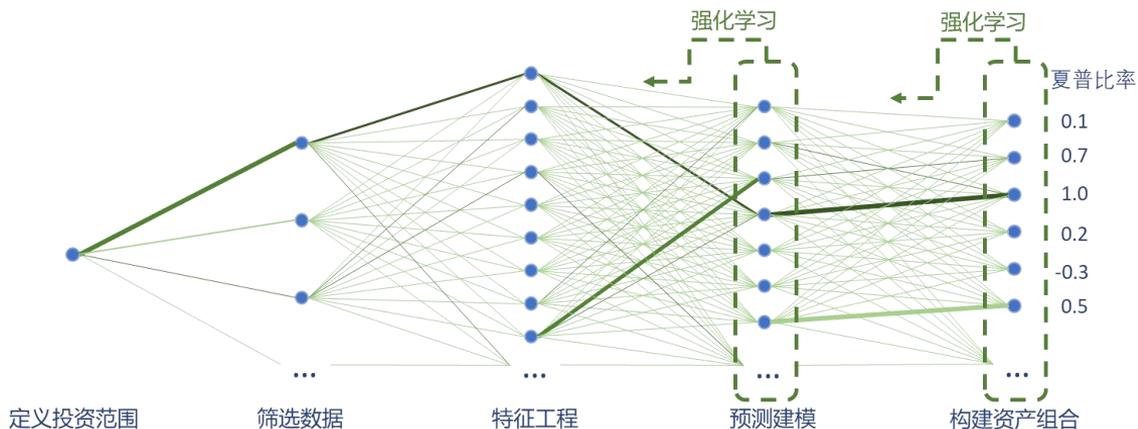
大数据和AI技术开启了主动研究、量化研究之后的第三代投研技术——AI智能投研。

一刀智投将大数据和深度学习结合应用在投研上，通过自动化流程的大数据分析技术，为不具备研发能力的机构和个人赋能量化投资能力。

	原始数据维度
基本面财报数据	213
技术面资金面指标	141
量化因子指标	428
另类数据	117
宏观经济指标	1413
总量	2099

### 高维度大数据

我们的大数据库涵盖传统金融数据、量化因子、宏观指标、另类数据等，全面、深入透析企业、行业、经济**360度画像**。这些不仅包括数字类数据，也包括通过自然语言处理NLP转化的文本类数据。



### 深度强化学习：策略博弈，优胜劣汰

我们通过使用强化学习，对手数据、模型和参数进行动态调整，让基于海量大数据的“投资基因”模型自我博弈，适者生存，进化为长期稳定有效的AI投资智慧。



## AI投资架构



我们的AI系统是按照对冲基金复杂投资决策架构搭建的，每个分模块训练出的AI引擎既可独立作用、又有协同效应

- 1、宏观经济预测决定牛熊整体仓位
- 2、资产大类预测决定股票与非股票资产配置
- 3、风格投资策略决定板块和策略轮动
- 4、个股择优区分好坏公司获得绝对收益
- 5、波段择时进行短期个股高低点判断
- 6、交易执行确定当日买卖点和日内T0



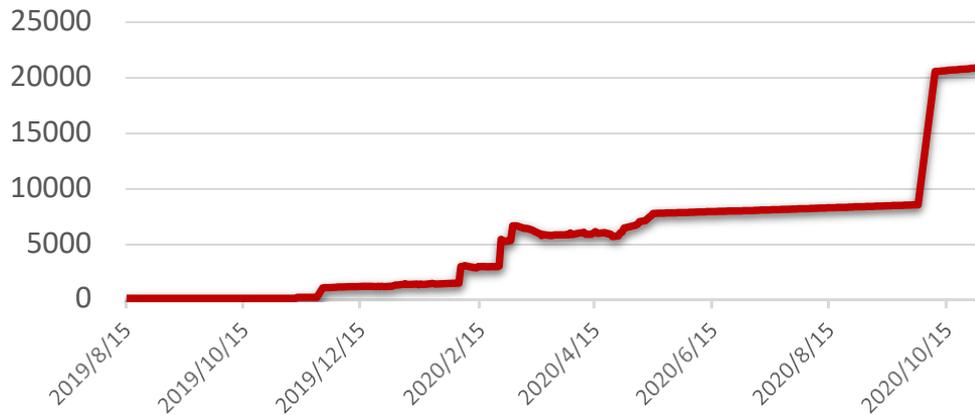
## 商业模式

合作模式——**我们用AI技术负责投资管理，对方专注于募资**。用技术价值换取合作方募资渠道，共同运营基金产品，私募基金股权绑定，业绩分成按比例

**收费方式 = 资产总规模 x 客户收益率 x 分成比例**

目前平台资产规模**8000万+**，利润率约为**5%**，净利润**400万+**。预计**2020年底**资产接近**2亿**，净利润**1000万+**

资金总规模（万）





AINVEST

## A股服务B端私募



2019.6开始陆续服务博润银泰、凯纳资本、古木投资、鸿大资本四家私募基金，累积资产规模50亿。

私募实盘表现（已备案）：平均年化收益**32%**，平均最大回撤**3.6%**，平均夏普比率**4.6**。

序号	产品名称	成立日期	最新累计净值	年化收益率	最大回撤	夏普比率
1	量化CTA策略1号	2018/4/9	1.56	50.22%	-1.58%	11.97
2	量化翼龙CTA2号	2018/9/28	1.59	75.47%	-0.23%	9.2
3	量化翼龙CTA3号	2018/9/28	1.56	72.61%	-2.32%	8.99
4	量化CTA策略4号	2018/5/8	1.09	7.05%	-2.58%	2.49
5	量化希望CTA5号	2019/1/24	1.07	15.03%	-0.70%	2.43
6	股票增强1号	2018/12/25	1.08	23.59%	-15.73%	0.46
7	艾泽拉斯1号	2019/1/23	1.07	11.51%	-2.93%	2.46
8	艾泽拉斯2号	2019/1/23	1.09	17.36%	0.00%	5.2
9	奥格瑞玛1号	2019/4/15	1.09	29.54%	-2.50%	1.21
10	量化多空对冲1号	2017/4/7	1.18	18.07%	-7.00%	1.18



AINVEST



## 2019年获得荣誉和技术专利

2019年获得的各类国家、省、市级荣誉——

- 团中央创青春中国青年创新创业大赛（互联网组）全国金奖
- 国家级高新技术企业
- 国家级人社部“2020中国留学人员回国创业启动支持计划”北京市代表
- 中关村U30-2019年度杰出人才
- 2019创富中国年度总决赛冠军
- 创客北京2019创新创业大赛海淀区一等奖
- 创客北京2019创新创业大赛北京市三等奖
- 2019第五届“海科杯”全球华侨华人创新创业大赛三等奖
- 全球青年创新大会“2019年度最具成长力创新企业Top50”
- 钱塘之星（第四届）创业创新大赛金融科技专场“金种子”奖
- 2019粤港澳大湾区中山青年人才创新创业大赛企业组季军
- 首届汕头创业之星大赛三等奖
- 2019创富中国“智能+”专场一等奖

.....





AINVEST



## 2019年获得荣誉和技术专利

2016年至今，雷宗逐渐完善、细化AI大数据技术，将北美顶尖技术落地中国市场。他的研究成果分为投资类、大数据类和自然语言处理类三部分，已经注册获得软著。它们分别为：

### 技术专利——

### 投资类——

- Alpha刀智能诊股系统 2019SR1088131
- AINVEST投资策略复制系统 2019SR1109885
- AINVEST一刀智投股票自动交易软件 2019SR1088468

### 大数据类——

- AINVEST大数据可视化及监测平台 2019SR1109871
- AINVEST另类数据投资指标平台 2019SR1109862

### 自然语言处理类——

- NLP多语种自然语言分析评估软件 2019SR1088279
- 聚类特征分析自然语言处理系统 2019SR1103506

.....





AINVEST



# 竞争格局

从**大数据分析能力**的角度，我们有别于仅提供数据的行情交易软件和策略研发平台；从**开放性合作**的角度，我们通过AI科技为机构赋能合作，有别于封闭式资管量化基金；

从**主动投资v.s.被动配置**角度，我们与**服务B端**的智能投顾不同。目前**竞争对手主要有1家**，而对方不是基于**深度学习和大数据的第三代量化技术**，而是基于量化因子的第二代量化技术。

量化基金



大数据分析能力

智能投资服务

主动投资:



AINVEST



盈首科技

被动配置:

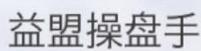


封闭式资管



开放性合作

各券商系统



行情&交易软件



仅提供数据

策略研发工具平台



## 发展历史



自2019年底产品上线, 资产规模迅速从200万增加到8000万, 10月底与博润银泰合作私募发行, 已认购规模1.2亿。



## 落地计划

为了抓住国内量化转型的黄金期，为基金、券商、银行、保险、自营机构等提供包括大数据、量化策略、自动交易架构、量化人才团队等全方位解决方案，我们需要在**数据中心、计算中心、高水平人才引进**上加大投入。未来从投资领域，将**AI**分析能力和基础设施向泛金融领域辐射，如信贷、保险、供应链金融等



### 2021

- 投入2000万建造IDC机房，支撑金融大数据数据库，以及私有金融云上AI算法优化的大量计算需求
- 累计引进10+名经验10年以上的海内外量化顶尖人才，加强AI量化专家团队
- AI服务资产管理规模突破10亿
- 按照总资产5%利润率，实现营收5千万
- 需要场地、租金、设备和人才补助



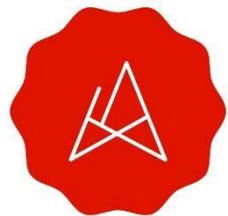
### 2022

- 追加投入1个亿扩容服务器，优化深度强化学习的并行计算效能（GPU/TPU/NPU），加强私有云数据隔离、金融算法保密
- 累计引进20+名经验10年以上的海内外量化顶尖人才
- AI服务资产管理规模突破50亿
- 按照总资产5%利润率，实现营收2.5亿
- 需要场地、租金、设备和人才补助



### 2023

- 追加投入3个亿扩容服务器，建立包括但不限于投资、信用评估、金融事件识别等各类泛金融场景的定制化AI分析服务
- 累计引进30+名经验10年以上的海内外量化顶尖人才
- AI服务资产管理规模突破200亿
- 按照总资产5%利润率，实现营收10亿
- 需要场地、租金、设备和人才补助



爱玩特  
AINVEST



版权声明：本档中所有内容均由AlInvest Group Inc提供，未经许可，不得抄袭、篡改、私自传播。