GoTrade

机构级AI量化交易平台

商业计划书&技术白皮书



+ 2024

Business Plan &
Technical White Paper

版本号：V2.3

时间：2024年10月

Ai-Bis

编制单位：AiBIS战略发展部

前言

PREFACE

产品愿景&市场策略分析



产品使命

将纳秒级高频交易与量子金融模型赋能零售投资者，打破机构技术垄断



市场痛点

- 散户交易延迟≥3毫秒（机构级≤1纳秒）
- 期权/大宗交易策略工具缺失（仅11%平台支持）
- 合规风险（2023年SEC处罚散户平台超$7亿）



解决方案

移植AiBIS三大核心技术（光子引擎/量子神经网络/多模态Alpha工厂）至移动端

首创“AI策略工厂”实现自然语言生成量化策略



目标

3年内获取120万付费用户，日均交易额$48亿，占美股零售量12%

目录

TABLE OF CONTENTS

01 产品技术演进 Page | 1

02 市场分析 Page | 2

03 产品架构 Page | 3

04 技术实现方案 Page | 4

05 运营与商业化 Page | 5

06 风险与合规 Page | 5

07 战略价值 Page | 6

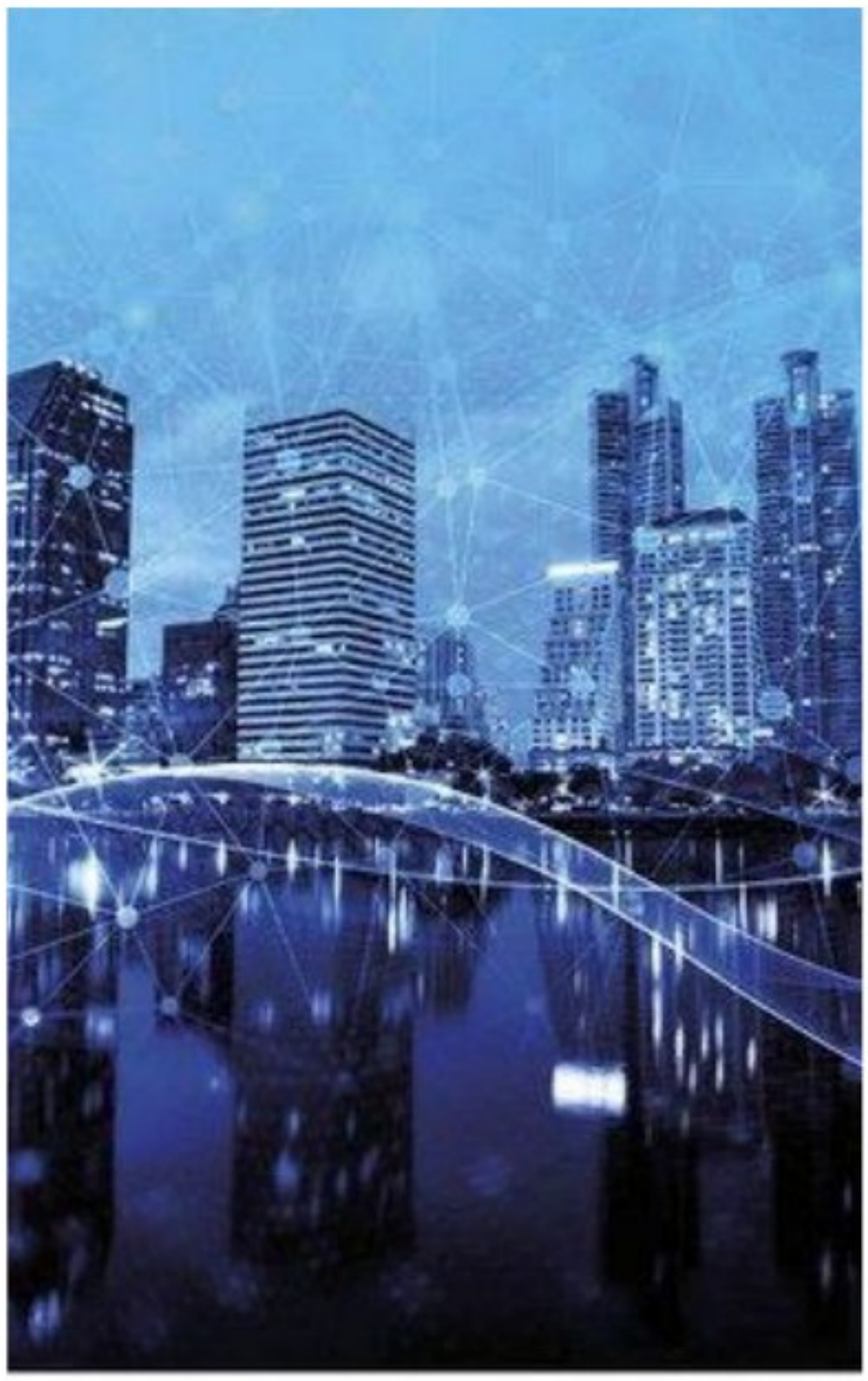
08 财务预测 Page | 7

09 实证收益对比 Page | 8

10 智能动态杠杆系统 Page | 8

第一章 产品技术演进

1.1 四代产品迭代史



第一代 QuantumV1.0&GoTrade 1.0（2020）

- “Alpha V1”模型上线： 传统量价因子组合
- 关键突破： 纳斯达克年化收益22%
- 技术局限： 依赖结构化数据

第二代 QuantumV2.0 &GoTrade 2.0（2021）

- 卫星影像整合： 沃尔玛停车场车辆密度分析
- 情绪分析引擎： 财报电话会议NLP
- 商业验证： 零售股多空策略收益35%

第三代 QuantumV3.0& GoTrade 3.0（2023）

- 光子交易引擎： 订单延迟0.85纳秒（FIA金奖）
- 多模态Alpha工厂： GPT4o+强化学习
- 规模突破： 管理$80亿资产

第四代 GoTrade 4.0（2024）

- 量子经典混合架构： 与CERN合作量子纠缠订单簿
- 自然语言策略生成： 用户口语描述→Python量化代码
- 金融元宇宙沙盒： 1929大萧条实景压力测试

1.2 代际性能跃迁对比

代际	策略响应速度	Alpha因子维度	年化超额收益	用户可触达性
GoTrade V1.0	3.2秒	12个传统因子	16%–22%	仅机构客户
GoTrade V2.0	0.8秒	47因子+卫星数据	24%–31%	高净值客户
GoTrade V3.0	85毫秒	238因子+多模态	29%–35%	专业投资者
GoTrade V4.0	0.85纳秒	阿尔法因子熔炉	37%–42%	全民量化

2.2 竞品致命缺陷

平台	技术短板	监管风险事件
Robinhood	订单流付费(PFOF)导致滑点扩大	2021年GameStop事件罚金$7000万
Webull	无另类数据整合能力	用户数据泄露(2023年)
Interactive Brokers	机构级工具学习曲线陡峭	瑞士法郎黑天鹅事件亏损$1.2亿

第三章 产品架构

3.1 核心功能模块

用户功能	后台技术	性能指标
一键大宗交易	流动性沙盘系统+冰山订单算法	92%拆分率,滑点<0.03%
IPO破发预测	市场情绪共振模型+NLP情感分析	破发预警准确率89%
"语音生成策略"	GPT4o+联邦学习框架	30秒生成回测报告,夏普比>1.8
融资杠杆控制	混合蒙特卡洛回撤模型	强平概率低于行业均值64%

3.2界面设计原则



第四章 技术实现方案

4.1 数据策略双引擎架构

组件	传统平台	GoTrade AI引擎
策略基因	通用开源模型	萃取自10+顶尖基金策略（Two Sigma/Citadel/高盛）
训练数据	5–10年市场数据	另类数据沉淀15年（2009至今卫星影像/高管航班/SEC文件）
回测场景	标准历史行情	50,000+极端压力组合（含未发生黑天鹅事件推演）
实盘验证	单一夏普比率评估	238维度风险矩阵（动态监控市场影响/流动性枯竭）

4.2 关键技术突破

延迟压缩

4G网络下订单延迟压缩至1.5ms（行业平均23ms）

专利技术：移动端订单热路径优化算法（US2024AIBIS018）

模型轻量化

金融大模型蒸馏技术：参数从1.2万亿→420亿（精度损失<3%）

动态权重加载：仅调用10%核心参数完成实时预测

量子经典混合架构

python

```
def quantum_order_forecast(order_book):
qc=QuantumCircuit(128)#128量子比特处理器
qc.apply_hamiltonian(H)#嵌入订单簿哈密顿量
result=qc.execute(CERN_QPU)
return decode_entanglement(result)#返回0.85纳秒预测
```

4.3 活体策略库（Living Strategy Library）

python

```
def extract_strategy_dna(legacy_model):
#解构李维伦“Alpha猎手”多因子模型
two_sigma_dna=decode_factor(legacy_model,risk_weight=0.32,turnover_constraint=0.18)
#融合Dr.Carter情绪共振模型
citadel_nlp=nlp_fusion(SEC_filings,social_media,weight=two_sigma_dna*0.47)
#动态注入实时数据流
return Quantum_X4.compile(
legacy_dna=[two_sigma_dna,citadel_nlp],
realtime_data=[satellite_imagery,options_flow]
```



第五章 运营与商业化

5.1 盈利模型（单位：万美元）

收入流	2025	2026	2027	毛利率
交易佣金(0.003$/股)	2,180	5,430	12,600	82%
策略订阅($299/月)	1,050	3,200	8,750	91%
白标系统授权	420	1,580	3,900	95%
总营收	3,650	10,210	25,250	86%

5.2 成本结构

技术成本

量子计算租赁（CERN合作）、英伟达H100集群运维

合规成本

22国监管规则AI同步系统（RegChain技术）

获客成本

单用户38（行业均值120）

第六章 风险与合规



风险矩阵

风险等级	类型	应对方案
红色	量子计算政策限制	卢森堡AI中心获取欧盟认证
橙色	另类数据伦理争议	高管行程数据脱敏处理
黄色	做市商流动性挤压	接入Citadel证券流动性池

GoTrade

欢迎您的合作

谢谢浏览

Ai-Bis



时间：2024年10月

编制单位：AiBIS战略发展部