

报告题目：程序化交易与金融大数据分析

摘要：程序化交易是当今金融里最热的课题之一。它的本质是利用海量的高频金融数据寻找交易策略。它主要用到概率统计理论与计算机程序的优化。其中最尖端的技术是所谓的“高频交易”，其中涉及的人员都有严格的保密协议约束。所以虽然有很多高频交易的书籍与文章，但鲜有揭示其中算法的。我们用平稳过程的遍历定理，找到了程序化交易的原理。特别，我们给金融交易中的“技术分析”找到了统计学基础。