

A股短周期量化研究与风控系统

AI 协作工程案例

材料核对日期：2026-09-18。作者：宇飞。

网站：<https://personal-portfolio-yufei.pages.dev/works/a-share-quant-research>

本项目是一套用于检验研究假设的工程系统。它不提供买卖建议，不连接券商自动下单。已实现的代码、通过的账户检查、未完成的策略比较和未来真实前向验证分别记录，不能互相替代。

目标与演进

旧系统探索过数据接入、评分和展示，现作为已冻结的历史原型保存。新版 quant_v2 独立重建，围绕数据可追溯、策略可比较、资金可对账和结果可复查建立主链。保留旧错误与失败记录，不把历史原型成绩混入新版结论。

研究规格采用 100 万元初始模拟资金，典型持有期 1 至 20 个交易日，最多 5 个持仓、80% 总仓位；15% 最大回撤是待检验的目标，不是已达到的业绩。基准和压力情景统一记录成交延迟与摩擦。结果统一称为“零显性费用、含成交摩擦的模拟收益”。

人与 AI 的责任

宇飞负责提出目标、提供已有资料、确定边界、反馈问题并审核交付要求。AI 辅助实现模块、整理数据、生成实验与文档，不代表用户独立完成所有复杂编程，也不是无人参与的自动投资系统。

协作按照总负责人整合、数据任务、策略任务、独立复核与报告任务拆分。实现者提交可检查的文件和运行收据，独立复核重建账目或使用反例检查，再由总负责人汇总供人工验收。任务数量或模型名称本身不构成质量证明。

系统架构

数据与来源证明 → 决策时可见的特征 → 固定策略意向 → 延迟及成交约束 → 连续账户与风险状态 → 只读报告与独立审计。

数据层区分原始价格、复权特征、事件发生时间、公告时间与可得时间。只在有依据的范围内规范字段，未知状态保留未知。回顾性数据依据不冒充严格的历史实时可得性证明。

策略层只收到决策时可见的数据与账户视图。四个固定价量假设为 TREND_20、TREND_60、PULLBACK_03、PULLBACK_05；与现金和 LIQUIDITY_TOP5 简单对照分别运行基准、压力情景，共 12 个模拟账户。完整比较未完成，不发布局部排名。

执行与账户层使用 Decimal 金额和 SQLite 持久账本，处理 T+1 持仓、现金冻结、应收股息、送转到账、部分成交、延迟、量能限制和风险状态。报告层只读导出，不是交易服务。

六项工程成果

1. 数据整理：核对 5,788 份日线 CSV、1,032 份 5 分钟 Parquet；研究区间 484 个计划交易日文件存在。阶段记录包含 4,143,850 行规范日线及 119,913,829 行目标沪深分钟基础结构检查。范围与检查层级明确，不等于逐证券无缺口或所有语义验收。
2. 策略实验：四策略与两个对照共用成交和风险框架，参数、数据绑定和结果收据共同记录。5 日、12 账户试跑的账目及时间覆盖已完成独立检查；不代替 484 日完整比较。
3. 风控与执行：用统一的延迟、量能、部分成交和仓位约束处理策略意向；风险与资金状态保存到持久账户。验收目标与实际结果分开，不声称规避全部风险。
4. 公司行动：特征用复权价，模拟交易用原价，现金分红和送转单独记账。已核对具体现金、送转样本与重启一致性；后续限定回顾研究准入不等于全市场严格 PIT 认证。
5. 断点恢复：31 日暂停后接续 9 日，40 日累计账目、1,920 条估值与历史前缀通过独立检查，现金多 1 元的负对照被发现。不证明单进程不间断 40 日稳定性。
6. 只读交付：中文 HTML 报告、权益及订单等 CSV、本机只读看板和摘要收据已实现。本网站只公开整理后的文档与汇总图表，不部署研究后台。

三个问题定位案例

样本范围误判：验证入口曾使用 16 日小样本，不能由它推断原始数据缺失。核对真实目录与文件元数据后确认 484 个计划交易日文件存在，再完成全量接入。保留旧判断与纠正依据。

价格精度：源 Float32 的 11.800000190734863 可能让向上取价多跳一档。先核对源列类型及误差预算，再规范为 11.80；来源不明或超预算报价拒绝处理。原值、规范值和来源摘要均保留，旧记录不静默改写。

账户恢复：接续前固定代码、数据与账户快照，接续后核对现金、持仓、估值和历史前缀。人工暂停、进程异常和完成状态分开保存，不靠重置账户或重跑覆盖旧记录来获得通过。

研究边界与下一阶段

补充的旧版 H5/H10 研究实现 Top100 / Top20 候选筛选；两期限各占 50%，并结合最近 20 个评分日稳定性等信息。三只研究优先标的来自 Top20 排名第 1、9、16，不是机械选前三，也不是新版四策略账户的候选。

用户补充了一次模拟炒股软件中的人工跟踪：2026-08-24 买入，至 2026-09-10 分批卖出，截图内三只买卖数量闭合、2 盈 1 亏。已成交买入额合计 766,350 元，卖出额合计 774,190 元，价差盈利 7,840 元，占

买入金额 1.0230%。这是未扣费用的单次模拟交易价差，不是真实资金实盘，不是账户整体收益率或稳定盈利证明。旧名单与新截图名称一致，但原名单的生成时刻早于委托未独立证明。原始截图和逐笔个人记录不公开。

工程验证有阶段性成果，完整历史策略比较尚未完成。2025 冻结候选接续检验、真实 20 日与 120 日前向验证尚未完成，没有实盘业绩或通过验收的盈利策略。运行器已实现不等于实时数据源准入和真实前向运行通过。

后续只有在实际完成对应实验并核对终态后才更新结论；网站不自动启动或继续任何研究。具体进度与真实诊断曲线见配套《验证与进度报告》。

资料与隐私

本说明依据 E01 新版主文档、E02 完整历史复盘、E03 数据范围核对、E04 数据规范化说明、E05 40 日恢复记录、E06 已导出的账户汇总、E07 独立复核收据、E08 正式比较进度记录整理。原件由作者本地保存，未随网站公开。

不公开源代码、原始行情、数据库、调用日志、账户信息、个人交易记录、密钥、本机路径或内部任务链接。本文件是脱敏工程说明，不是完整可执行研究包或投资建议。

图示附录（示意与实测区分）

SYSTEM ARCHITECTURE / IMPLEMENTED MODULES

数据、决策、执行与证据分层

模块已实现，不意味着完整历史收益或真实前向验证已经通过。

01

数据与来源

时间与字段校验
版本、来源和异常

02

策略意向

固定价量假设
仅用当时可见信息

03

执行与风控

延迟、T+1、量能
部分成交与风险状态

04 / SQLITE + DECIMAL

连续模拟账户

现金 · 持仓 · 订单 · 公司行动 · 事件 · 估值

05 / READ ONLY

报告与独立审计

只读导出 · 账本重建 · 历史前缀核对 · 反例测试

宇飞 / AI 协作工程案例

EVIDENCE SNAPSHOT / 2026-09-18

HUMAN + AI / RESPONSIBILITY & REVIEW

不是让 AI 给结论，而是让证据可核对

用户提出目标与边界，AI 分工实现；复核结果必须落到可检查的记录。

01

用户定义

目标、资料、约束
反馈与验收要求

02

AI 分工

数据、策略、账户
报告与集成实现

03

独立复核

账目与时间重建
差分检查与负对照

04

人工验收

核对范围和局限
决定后续研究方向

文件、配置、运行记录与检查收据形成证据链；口头“通过”不能替代实际验收。

宇飞 / AI 协作工程案例

EVIDENCE SNAPSHOT / 2026-09-18