

Bloomberg

#

Hackathon

#Top_of_the_Quants

D

E

F

對話臺灣 2021 黑客松大賽冠軍得主 — Gamma Paradigm 專訪

<

"

"

>

+

=

"

@

"

(

x

+

y

)

彭博在全球各地區舉辦的黑客松大賽決出了二十餘組頂尖量化高手，為創新的投資 app 點燃了燦爛的火花，當然，臺灣也不例外。共有十多個團隊參與此次黑客松，展示了金融服務公司如何善用 BQuant、彭博的開源科技套裝工具，以及彭博終端數據，來解決業界最迫切的問題。

最後，由來自 Gamma Paradigm 的三人團隊，贏得了臺灣區的比賽。該團隊構建的應用程式，使用了「選擇權最痛理論」（Maximum Pain Theory）來密切掌握市場動向。其應用程式與所有參賽項目一樣，皆借助於 BQuant 賦予數據新生命。

我們最近訪問了 Gamma Paradigm 團隊，對其獲獎的 app、他們參與黑客松的斬獲，以及 BQuant 為金融服務公司帶來的益處，均有了更進一步的瞭解。



Gamma Paradigm 團隊

您是否能描述一下，您在量化高手黑客松大賽所建立的應用程式？

我們開發了一個名為「主力佈局水晶球」（Option Force Crystal Ball）的應用程式，目的在提供未平倉合約分析的計量解決方案。它是根據「選擇權最痛理論」（Maximum Pain Theory (MPT)），並使用機器學習技術，以 MPT 強度指標來參透市場大戶的心理走向，掌握市場的「脈動」（即市場主力的佈局）。

黑客松對貴公司有何吸引力？

Gamma Paradigm 是一家年輕的公司，善用科技作決策，向來是我們的優勢之一。因此，我們始終樂於接受新概念和新挑戰。對我們而言，參加彭博黑客松大賽並嘗試 BQuant，是挑戰自我並開拓視野的絕佳機會。

您決定參加黑客松大賽的動機為何？又如何獲得貴團隊參賽所需的資源？

我們的團隊成員來自公司的不同部門，這正是我們能夠集思廣益共同開發應用程序界面，並建構計量模型的原因。黑客松大賽為時不到一個月，因此，我們充分利用工作外的時間提出解決方案，並密切溝通協調，以確保個人進行方向均正確無誤。我們竭盡所能地在指定截止日期之前，完成了我們的應用程式。這讓本團隊有更充裕的時間，將簡報資料精益求精，確保我們在 10 分鐘的時間範圍內，呈現最精確的內容。

您從此參與的經驗中學到了什麼？

我們進一步瞭解到，彭博可提供的計量分析功能，這包括了功能強大的 BQuant 和彭博資料庫。此外，與同業的相互切磋，並與業界專業導師的合作，都是無可取代的寶貴經驗。

總之，BQuant 的整體經驗是非常美好的。BQuant 本身具備了許多功能，加上彭博提供完整的協助與指引，讓使用過程簡單明瞭。此外，彭博提供整合數據的全面資訊，大大縮減了我們的開發時間。

在黑客松活動之後，您是否對公司進行了任何改變？

參加黑客松之後，我們更加重視數據整合。彭博終端機將市場上的即時資料集中彙整，並為更深一層的专业分析與研究，提供了強大的服務。這種組合能協助我們對自身的作業流程結構和資料庫的規模，有更深刻的瞭解。

您對於引進科技來增強資產管理功能有何想法？

我們認為，引進科技可大幅提高資產管理的效率。因為科技不僅改善了各種數據的可使用性，還能節省處理資料的大量時間。這使公司可專注於資產管理的研究。

歡迎您來了解 Gamma Paradigm 公司。我們致力於巧妙運用各種科技，這向來是我們的關鍵優勢之一。BQuant 的便利性在於：我們可以執行垂直整合，並找出讓我們的資產管理更有效率的方法。