因子

(1)用現金損益表示比較好，因為今天賺5%跟明天賺5%，因為股價不同，所以代表不同意思。

(2)可以篩掉各個有outlier發生的index，因為之後的時間outlier可能也不會發生。

(3)Y可以放下3個報酬有變動的時間(Y不固定時間沒關係，反正我們只要知道要進場、出場就好)，r-squared會上升。

(4)資料可以只放有成交量的時間，r-squared會上升。

(5)資料的呈現：報酬(或是現金損益)走勢、註記賺錢的區段、各個時間點的drawdown、股價報酬累積走勢圖、各個時間點buy/sell(上三角形、下三角形顯示)、每日的現金損益圖。

<https://www.itread01.com/content/1547192895.html>