選擇市值、動能、價值(PB ratio)因子：  
市值：大排到小

動能：大到小

價值：小到大(PB ratio小，代表價值被低估?)

因子權重為1:1:1。

剩下都照原程式提供者的邏輯未更改。

**In sample: 2018/01/01 ~ 2020/12/31**

一張含有 文字, 螢幕擷取畫面, 行, 圖表 的圖片

自動產生的描述

市值因子五爪圖

一張含有 文字, 螢幕擷取畫面, 行, 繪圖 的圖片

自動產生的描述

動能因子五爪圖

一張含有 文字, 行, 螢幕擷取畫面, 圖表 的圖片

自動產生的描述

價值因子五爪圖

**Out sample: 2019/01/01 ~ 2021/12/31**

一張含有 文字, 螢幕擷取畫面, 行, 繪圖 的圖片

自動產生的描述

Sum of Abs Residual Error 1.0825024042063673

Annual Tracking Error 0.031559354030072415

Annual Tracking Difference 0.043968877535418116

一張含有 文字, 螢幕擷取畫面, 繪圖, 行 的圖片

自動產生的描述

一張含有 文字, 行, 繪圖, 螢幕擷取畫面 的圖片

自動產生的描述

累積超額報酬(%): 6.808654843540467%