

財金計量方法

以「總整理」的方式復習檢定

試圖連結：機率—統計—應用(財金)

- 檢定常用的四大分配: Z , t , χ^2 (卡方), F
- 最初階的比例檢定 (基於 Z 分配)

	單一母體 one population	兩個母體 two populations
proportion	$H_0: p = 0.5$ Z -統計量	$H_0: p_1 = p_2$ Z -統計量

- 基本核心四大檢定 (用到 t , χ^2 , F 分配)

	單一母體 one population	兩個母體 two populations
mean	$H_0: \mu = 5$ t -統計量	$H_0: \mu_1 = \mu_2$ t -統計量
variance	$H_0: \sigma^2 = 10$ χ^2 -統計量	$H_0: \sigma_1^2 = \sigma_2^2$ F -統計量

上述 2+4 種檢定對應「程式交易」策略中的績效評估方式
(以下取自姜林杰佑老師的投影片)

系統交易 \cong 量化交易 \cong 程式交易 \cong 客觀交易

▶ 系統交易

▶ 有明確的交易系統

▶ 量化交易

▶ 進出法則可以明確量化

▶ 程式交易

▶ 將量化交易法則程式化

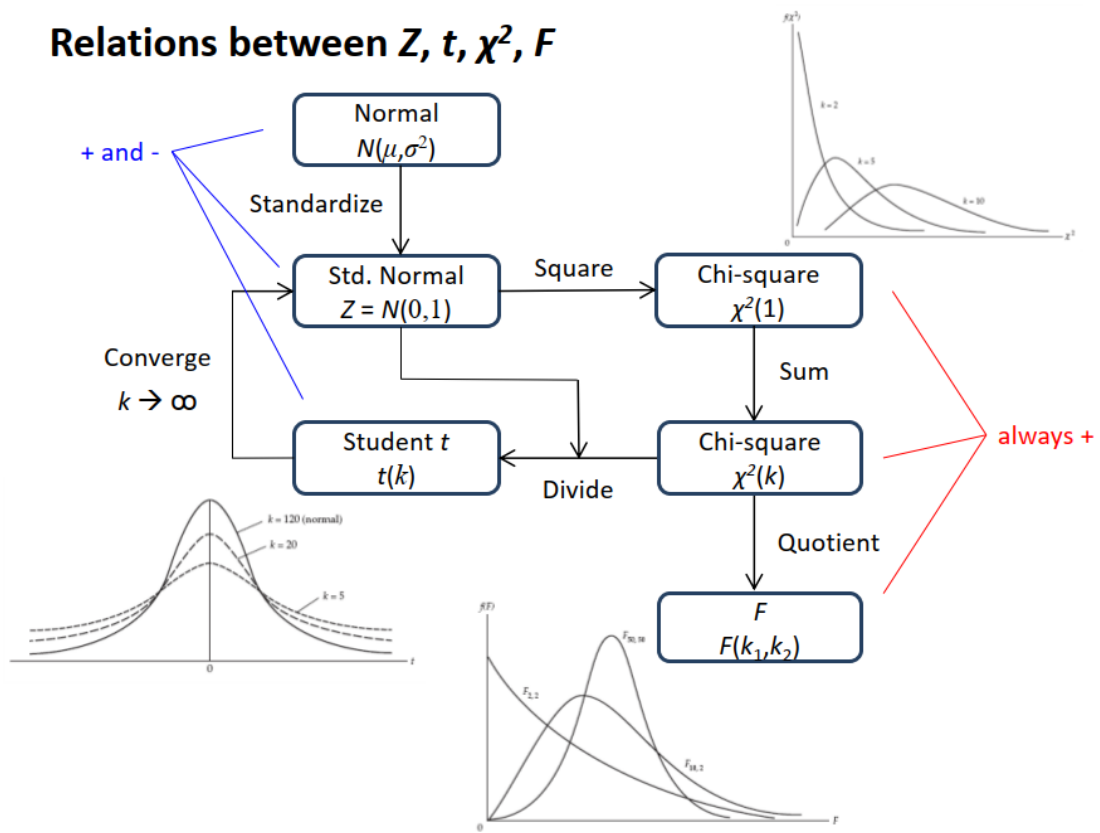
▶ 客觀交易

▶ 以科學程式透過統計方法驗證績效非偶然

▶ 報酬率(均值檢定)、風險指標(變異數檢定)、勝率(比率檢定)

- 四大機率分配的關連

Relations between Z , t , χ^2 , F



Questions: 那些常見的統計量遵守這幾個分配?