

## 5/5 會議記錄 – 主題探索

議程: 專案主題、資料討論

產品暫定: 股票報酬率預測

產品對象: 一般民眾

產品貢獻: 幫助大眾選股

分類預測專案:

應變量(y): 各股報酬率分級, 共分 4 級, 依據未定

分級舉例: 3%以上非常好。0~3%好....

自變量(x): 各類股的  $\beta$ 、波動度、成交量、法人買賣超

作法:

1. 透過 TEJ 獲取上述資料, 並且手動計算波動度
2. 依照與大盤方向是否相同( $\beta$  的正負)各挑出一個類股
3. 針對  $\beta > 0$  的類股建模
4. 針對  $\beta < 0$  的類股建模
5. 結論敘述

hw:

1. 撈出上述資料
2. 思考其他自變量
3. "盡可能"理解上述指標