**加密貨幣動能策略**

**1.挑選三年以上的幣種 (e.g:BTC ETH XRP LTC EOS ADA DOGE TRX XLM ZEC ZRX ETC VET DASH IOTA NEO QTUM KNC MANA XMR BNB ICX LINK ATOM ALGO BAT OMG REP ARDR SNT BTS ) 共30隻幣種。   
  
2.使用20週線MA判斷比特市場多空方向，若價格大於20週線MA，判斷多頭 反之。  
  
3.若市場多頭，使用週報酬挑出30隻幣種裡最好的5隻做多  
 反之空頭則挑最差的5隻幣種做空  
  
4.檢驗不同觀察期(J)及持有期間(K)何者為佳  
 (e.g:7/7、15/15、30/30)  
  
5.每週更新一次，投資組合週報酬。  
  
1.找文獻支撐理論 好比說20週ma 以及為什麼用動能(支撐單邊趨勢強的條件)  
2.回歸模型 找相關文獻 時間序列他們怎麼用 或是找三因子CAPM模型驗證我這個策略的可行性，(規模 動能(每天) 市場報酬(選出來30之幣種的平均報酬))**