

網路選股秘笈

~從網路資源找尋可
執行的交易策略~

江加宏

自我介紹

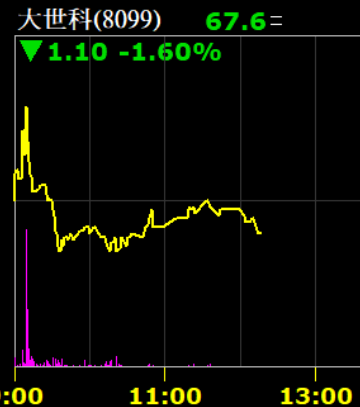
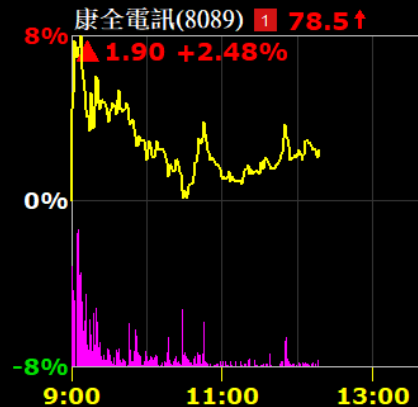
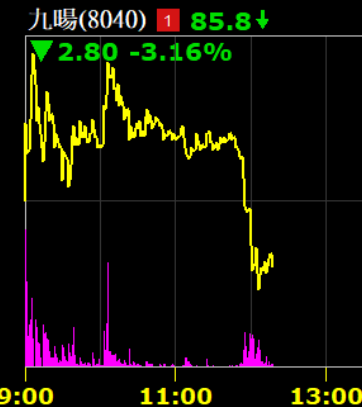
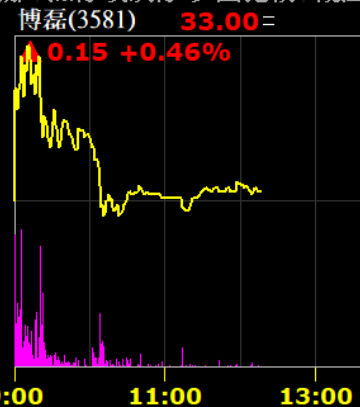


- 清華大學研究所
- 新竹科學園區半導體廠主任工程師
- 程式交易經驗15年 HTS, Multicharts, XQ
- FB社團-XQ策略技術討論及分享-版主





富邦 華南 元富-江加宏 元富-李法郁 漲停或跌停 多圖比較 觀注 多圖比較



加權指數 走勢圖

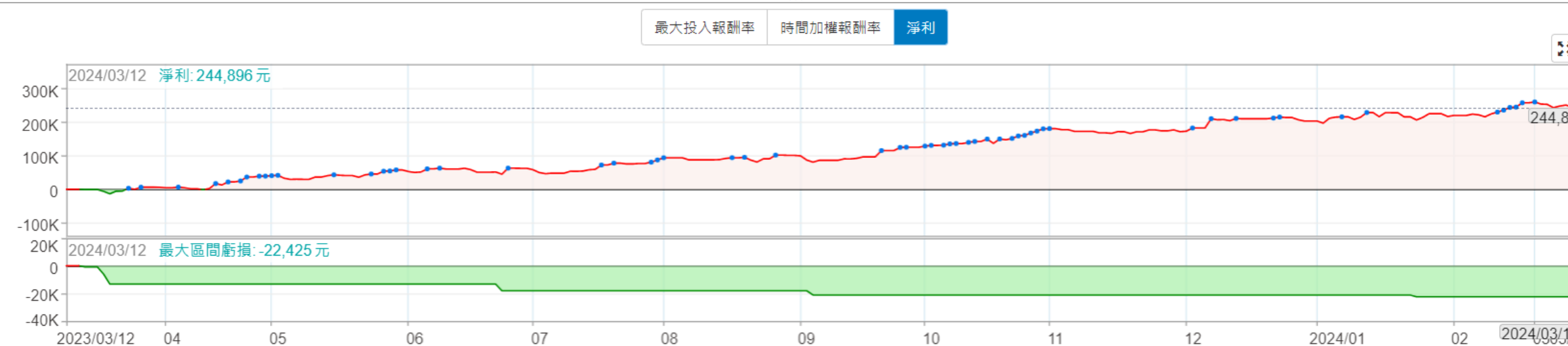


櫃買指數 走勢圖



回測資料範圍	2023/03/12 - 2024/03/12 (1分鐘資料) (逐筆洗價) (觸發即判斷成交)	回測執行時間	2024/03/13 11:51 (費時43秒)
回測執行商品	預選-S01[台股](選股) 1795(成功) 9(失敗)		
交易設定	安控: 單一商品最大部位:無限制, 單一商品每日最多進場次數:無限制 初始資金: 100萬元 交易費用: 股票0.2%(成交金額)、期貨100元(口) 每日部位歸零: 關閉		

全部 做多 做空 % \$			
腳本設定	淨利	24.49%	毛利 68.43%
S01_print(每筆交易金額(萬)=10)	獲利因子	1.56	毛損 -43.94%
	總交易成本	13.36%	最大投入金額 798,838
	總交易次數	477	獲利交易次數 295
	勝率	61.84%	虧損交易次數 182
	平均交易	0.05%	平均獲利交易 0.23%



常見網路資源

1. [H ttps://www.xq.com.tw/xstrader/category/交易策略/](https://www.xq.com.tw/xstrader/category/交易策略/)



2. [H ttps://aplus.trading](https://aplus.trading)



3. XQ量化積木



量化積木

Case 1

好公司業績開始開出來

XQ 全球贏家

——XQ官方部落格 投資實戰心法

var: OH(0),OS(0),OM(0),HH(false);
// O > C[1] then OH = intportion(100*O/C[1]-100);
//我們把跳空開高的百分比取整數計,這樣一來0.XX %的就都變成0而被去掉
OS = summation(OH,20); //開高整數的20天總和
OM = (highest(OS,20)+Lowest(OS,20))/2; //計算20天來的高低中線
HH = true else HH = false; //如果是創新高則HH=true //開高整數的總和

首頁 指標 選股 策略 大盤 筆記 語法 XQ介紹 美股 投資配置 固定收益

好公司業績開始開出來

By 發財橘子 | 2024-01-23

讚 1

分享

我在尋找一種股票，這種股票過去獲利不差，連續5年都可以賺到兩元以上，但目前股價跌到60元以下，代表過去一段時間，前景展望可能不大好，但累計營收年增率又大於15%且大股東開始買超，這種公司可能屬於好公司而且業績又重新回到上升軌道，我會特別留意這樣的公司。





選股條件

選股條件/腳本



編輯條件 +

調整參數 



- ☒ 季 營業毛利率大於 15 % 
- ☒ 年 連續 5 年每股稅後淨利(元)都大於 2 元 
- ☒ 月 累計營收年增率大於 15 % 
- ☒ 日 收盤價小於 60 元 

在下面條件中必須符合 1 項以上

- ☒ 日 近 1 日關鍵券商合計買超合計佔成交量 2 % 以上 
- ☒ 日 近 1 日關聯券商合計買超合計佔成交量 2 % 以上 

選股回測



選股回測的問題

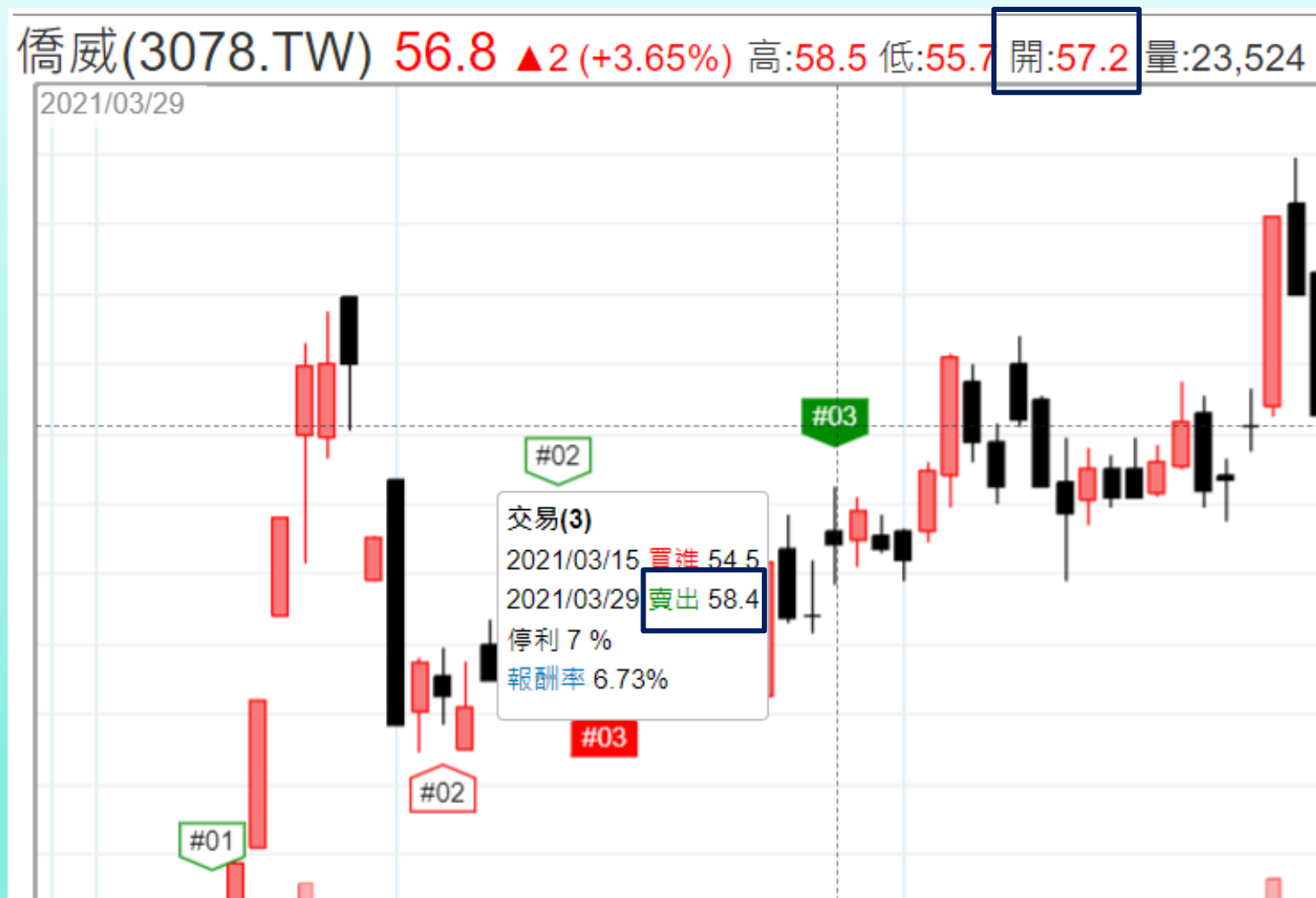
1. 時間加權報酬

- 100%資金投入
- 每日自動再平衡

2. 短停損，短停利

- 交易誤差對回測績效影響極大

選股回測出場 錯誤



交易回測
固定金額進場
同樣出場條件



階梯出場



交易回測

階段出場



SAR



SAR 出場回測



Case 2

江湖傳說解密系列(6)：低價轉機股怎麼挑？

By 發財橘子 | 2024-03-05



行情走到這裡，好多股票價位都不低，市場有一派的作法是專挑低價轉機股，但這種股票要怎麼挑呢？今天來跟大家討論這個議題。

首先我們先定義什麼是低價轉機股。

我設了最基本的三條件：

一、股價低於30元

二、月營收成長

三、毛利率大於10%。因為低毛利率的公司，月營收要有大成長，才能貢獻到EPS，所以加了這個條件。

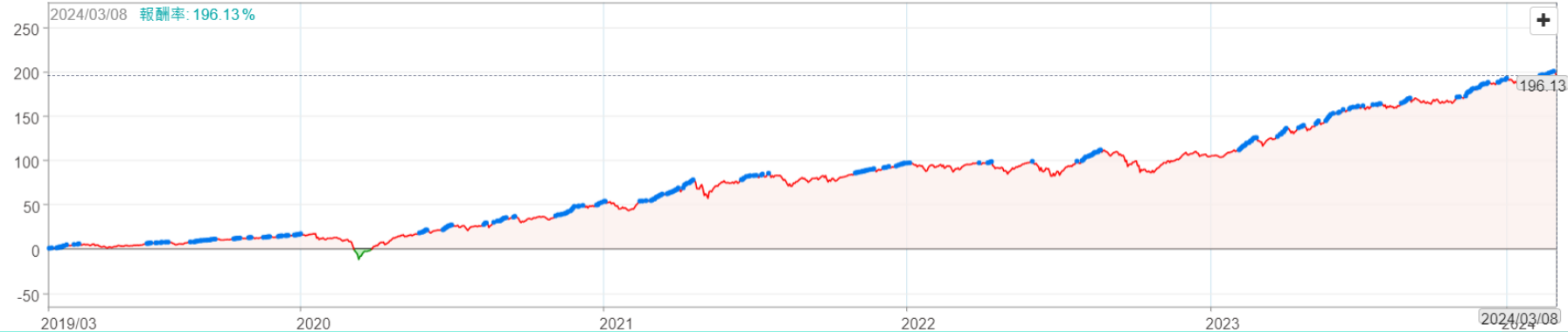
選股條件

選股條件/腳本

- ☒ 日 收盤價小於 30 元✎
- ☒ 季 營業毛利率大於 15 %✎
- ☒ 月 月營收年增率大於 5 %✎
- ☒ 月 月營收月增率大於 0 %✎
- ☒ 季 營業利益成長率大於 3 %✎
- ☒ 日 總市值(元)小於 150 億元✎
- ☒ 日 股價淨值比小於 1.5 倍✎
- ☒ 季 營業利益率大於 3 %✎

選股回測

回測資料範圍	2019/03/08 - 2024/03/08 (日資料)	回測執行時間	2024/03/09 17:29 (費時18秒)		
回測執行商品	台股 - 普通股全部(系統) 1783(成功) 21(失敗)				
交易設定	作多, 股票0.2%(成交金額), 最大同時進場無限制次 進場價格: 下期開盤價, 出場價格: 下期開盤價				
進場設定		總交易次數	32985	勝率%	64.70%
<div>日</div> 收盤價小於 30 元	<div></div>	獲利次數	21341	虧損次數	11644
<div>季</div> 營業毛利率大於 15 %		時間加權報酬	196.13%	平均報酬率%	0.01%
<div>月</div> 月營收年增率大於 5 %		最大獲利率%(單筆)	16.93%	最大虧損率%(單筆)	-15.92%
<div>月</div> 月營收月增率大於 0 %		最大連續獲利率%	10.39%	最大連續虧損率%	-18.51%
<div>季</div> 營業利益成長率大於 3 %		最大區間獲利率%	239.64%	最大區間虧損率%	-24.59%
<div>日</div> 總市值(元)小於 150 億元					
<div>日</div> 股價淨值比小於 1.5 倍					
<div>季</div> 營業利益率大於 3 %					
出場設定					
停利: 股票7%					



交易回測



亞力(1514.TW) 17.65 ▼-0.1 (-0.56%) 高:17.9 低:17.5 開:17.65 量:1,078



21% 停損利 回測

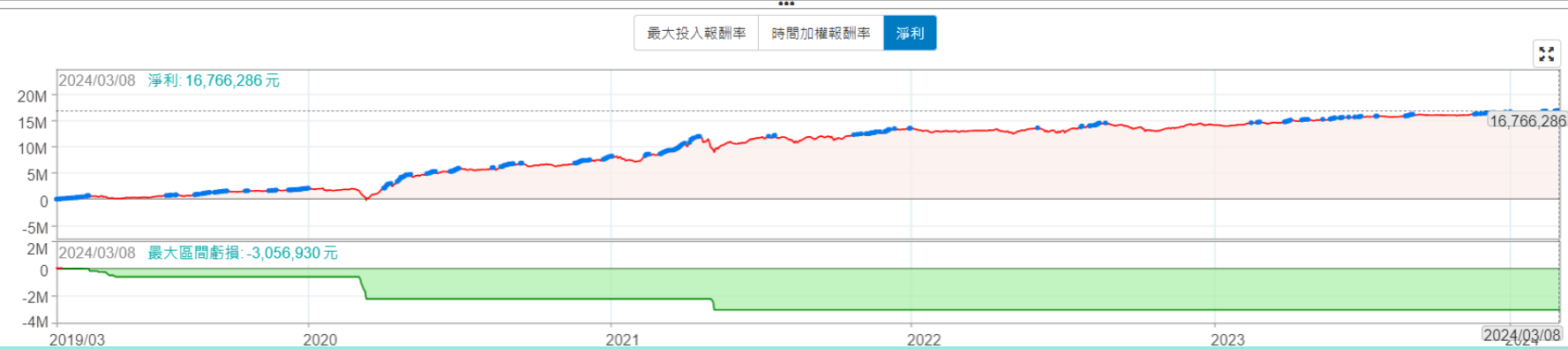


商品名稱	序號	進場時間	進場價格	出場時間	出場價格	持有區間▼	報酬率	交易數量	獲利金額	累計獲利金額	累計報酬率
台產 (2832.TW)	1	2019/06/11 09:01	買進 20.45	2023/11/02 09:01	賣出 24.75	1074	51.47%	9	94,726	94,726	9.47%
冠好 (8354.TW)	4	2020/01/13 09:27	買進 18.8	--	--	1008	-5.06%	1	-952	-21,790	-2.18%
冠好 (8354.TW)	5	2020/01/13 09:27	買進 18.8	--	--	1008	-5.06%	1	-952	-22,742	-2.27%
冠好 (8354.TW)	6	2020/01/13 09:27	買進 18.8	--	--	1008	-5.06%	1	-952	-23,694	-2.37%
冠好 (8354.TW)	7	2020/01/13 09:27	買進 18.8	--	--	1008	-5.06%	1	-952	-24,646	-2.46%
德昌 (5511.TW)	1	2019/03/11 09:01	買進 29.05	2023/04/14 09:06	賣出 35.25	999	59.89%	6	104,383	104,383	10.44%
長佳 (4550.TW)	2	2019/11/11 09:01	買進 28.4	2023/03/14 09:01	賣出 31	813	33.88%	4	38,488	20,184	2.02%
宏普 (2536.TW)	6	2020/09/07 09:01	買進 24.05	2023/11/21 10:22	賣出 29.15	782	30.41%	8	58,518	96,947	9.69%
長佳 (4550.TW)	3	2020/03/19 09:49	買進 22.15	2023/03/14 09:01	賣出 31	729	71.71%	3	47,653	67,838	6.78%
長佳 (4550.TW)	4	2020/03/19 09:49	買進 22.15	2023/03/14 09:01	賣出 31	729	71.71%	2	31,768	99,606	9.96%
鉅椽 (8074.TW)	12	2021/04/09 09:01	買進 22.3	--	--	711	7.16%	2	3,194	35,848	3.58%

階段出場

回測資料範圍	2019/03/08 - 2024/03/08 (日資料) (逐筆洗價) (觸發即判斷成交)	回測執行時間	2024/03/09 17:56 (費時39秒)
回測執行商品	江湖傳說6-低價轉機股[台股](選股) 1783(成功) 21(失敗)		
交易設定	安控: 單一商品最大部位:無限制, 單一商品每日最多進場次數:1 初始資金: 100萬元 交易費用: 股票0.2%(成交金額)、期貨100元(口) 每日部位歸零: 關閉		

		全部 做多 做空		% \$	
腳本設定	淨利	16,766,264	毛利	31,976,612	
波段進出場_移動損利	獲利因子	2.10	毛損	-15,210,345	
	總交易成本	4,137,457	最大投入金額	23,277,771	
	總交易次數	29190	獲利交易次數	7484	
	勝率	25.64%	虧損交易次數	21668	
	平均交易	574	平均獲利交易	4,273	



全部交易的平均持倉K線根數	9.18
---------------	------



階段出場 –
 20天不再進場



宏亞(1236.TW) 12.9 ▲0.05 (+0.39%) 高:12.9 低:12.85 開:12.9 量:22



SAR 出場



Super Trend 指標



Super Trend 出場



Case 3



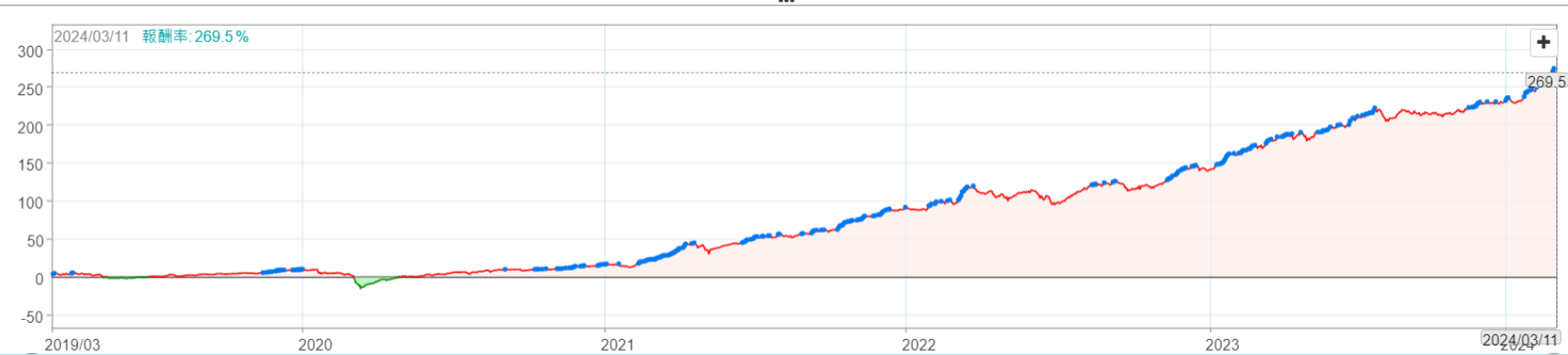
XQ的這個估值因子策略應該是很多人會有興趣的，這個策略主要在估計未來的合理價值與現在價值的差異，如果現在的價值是低於未來的合理價值，這樣的股票，其股價在未來就有增長的可能性，這樣的觀念應該還滿適合可以找到長期投資的股票，而XQ用了爆量起漲來找進場的時機，讀者可以用估值因子當主條件，試著用其他方式找到更好的進場時機

原文回測

這邊用原文章的參數搭配量化積木做回測，我覺得回測結果算是不錯的，權益曲線算是一直向上的，報酬率雖然只有13.25%，但主要原因是交易次數少，而且停損利為7%所造成的

選股回測

回測資料範圍	2019/03/11 - 2024/03/11 (日資料)		回測執行時間	2024/03/12 19:00 (費時6秒)	
回測執行商品	台股 - 上櫃普通股全部(系統) 714(成功) 99(失敗)				
交易設定	作多, 股票0.2%(成交金額), 最大同時進場無限制次 進場價格: 下期開盤價, 出場價格: 下期開盤價				
進場設定		總交易次數	394	勝率%	78.43%
<div><div>日</div> 阿爾發09-估值因子(假設未來十年營業利益年成長率=3, 未來十年平均年利率=2, 未來獲利折現合計淨值與市價比=150)</div> <div><div>日</div> 爆量剛起漲(日期區間=20, 區間最大漲幅%=15)</div> <div><div>日</div> 收盤價小於 30 元</div>		獲利次數	309	虧損次數	85
		時間加權報酬	269.50%	平均報酬率%	0.68%
		出場設定		最大獲利率%(單筆)	30.98%
停利: 股票20% 停損: 股票20%		最大連續獲利率%	10.63%	最大連續虧損率%	-14.35%
		最大區間獲利率%	344.25%	最大區間虧損率%	-23.10%



交易回測
- 固定損利



階段出場



移動停利



Super Tend 出場



SAR 出場



Auto Pilot



結果分析

出場方法	固定20%	階梯	移動	SuperTend	SAR	AutoPilot
淨利(萬)	197	55	217	69	37	85
獲利因子	3.57	1.68	3.96	1.75	1.42	1.96
勝率	65%	36%	55%	38%	47%	41%
最大投入(萬)	423	271	463	271	327	327
平均持倉天數	156	21	146	27	32	34
MDD(萬)	68	13	63	27	18	26
MDD(%)	35%	24%	29%	39%	49%	31%



Q & A