



富邦金控

初階XS程式交易教學手冊-3

富邦證券



以下內容為教學範例非投資建議，內容僅供參考。

投資並非全無風險，投資人開戶、交易前應了解自身財務
狀況及風險承受度，並詳閱投資相關說明文件。

The background of the slide is an aerial photograph of a city, showing various buildings, roads, and green spaces. A large, solid blue diagonal shape covers the right half of the image, creating a modern, corporate aesthetic.

財報選股

財報資料

除開高低收量之外，其他資料都用**Getfield**抓。

由於資料很多，請用

• **Getfield(插入)**

1 Getf

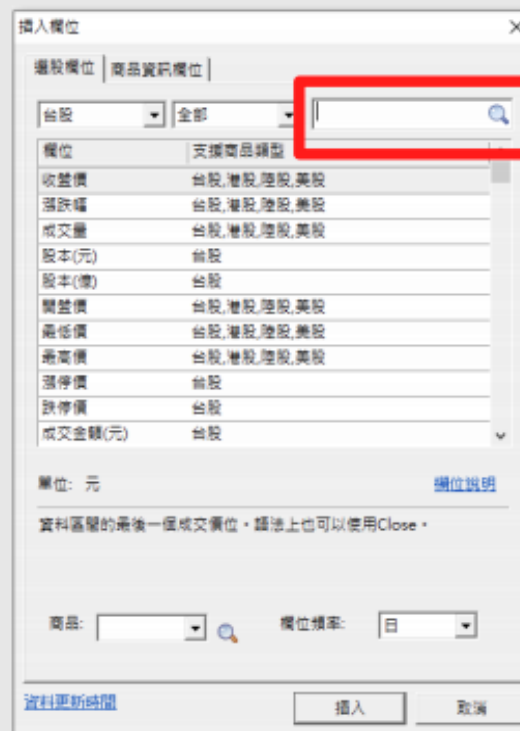
GetField

GetField(插入)

GetFieldDate

GetFieldDate(插入)

GetFirstBarDate



搜尋

An aerial photograph of a city, likely Taipei, showing a mix of urban development, green spaces, and a large stadium. A large, solid blue diagonal shape covers the right half of the image, creating a modern, graphic design.

穩定收益選股

穩定收益選股

- ◆ 會賺錢的公司
- ◆ 股東報酬好
- ◆ 有量
- ◆ 過去長期沒賠錢

會賺錢的公司

//連續3年EPS>3

value1= Getfield("每股稅後淨利(元)", "Y");

condition1=trueall(value1>3, 3);

//3年中EPS至少有2年成長

condition2=countif(value1>value1[1],3) >= 2;

if condition1 and condition2 then ret=1;

股東報酬好

//連續3年股東權益報酬率在15%

Value1= Getfield("股東權益報酬率", "Y");

Condition1=trueall(value1>=15, 3);

//5年平均報酬率10%以上

Condition2=average(value1, 5) >= 10;

If condition1 and condition2 then ret=1;

有量

//考慮絕對量

condition1=v>500;

//考慮平均量

condition2=average(v, 5) > 500;

if condition1 and condition2 then ret=1;

過去長期沒賠錢

```
value1= Getfield("每股稅後淨利(元)", "Y");  
condition1=trueall(value1[3]>0, 6);  
  
if condition1 then ret=1;
```

An aerial photograph of a city, likely Taipei, showing a dense urban landscape with various buildings, roads, and green spaces. A large, solid blue diagonal shape overlays the right half of the image, creating a modern, graphic design. The text '營收創高選股' is centered within this blue area.

營收創高選股

營收創新高

//要判斷到value1[12], 所以要13根資料

Settotalbar(13);

value1=GetField("月營收", "M");

value2=highest(value1[1], 12);

condition1=value1>value2;

if condition1 then ret=1;

營收連續同期創高

```
settotalBar(50);  
value1=GetField("月營收", "M");  
var:i(0),iHigh(0);  
iHigh=0;  
for i=1 to 3 begin  
    if value1[12*i]>iHigh then iHigh=value1[12*i];  
end;  
condition1=value1>iHigh;  
if trueall(condition1,12) then ret=1;
```

An aerial photograph of a city, likely Taipei, showing a dense urban landscape with various buildings, roads, and green spaces. A large, solid blue diagonal shape overlays the right half of the image, creating a modern, graphic design. The text '跨頻率問題' is centered within this blue area.

跨頻率問題

產生跨頻率題

將各單一策略合併為一個腳本，
若單一策略的資料頻率不相同時，
即會產生跨頻率問題。

加入選股策略時，
預設資料頻率為使用到資料的最小頻率。

序列資料

```
value1= Getfield("每股稅後淨利(元)", "Y");
```

此時 **value1[1]** 並不一定代表去年的EPS,
若資料頻率

日頻率 代表昨天的年EPS

季頻率 代表上一季的年EPS

年頻率 才代表去年的年EPS

可使用

```
value2= Getfield("每股稅後淨利(元)", "Y")[1];
```

會賺錢公司(跨頻)

//連續3年EPS>3

condition1=

 trueall(Getfield("每股稅後淨利(元)", "Y")>3, 3);

//EPS成長

condition2=Getfield("每股稅後淨利(元) ", "Y")

 > Getfield("每股稅後淨利(元) ", "Y")[1];

condition3=countif(condition2, 3) >=2;

股東報酬好(跨頻)

//連續3年股東權益報酬率在15%

condition11=

 trueall(Getfield("股東權益報酬率", "Y") >=15, 3);

//5年平均報酬率10%以上

condition12=

 average(Getfield("股東權益報酬率", "Y"), 5) >= 10;

If condition11 and condition12 then ret=1;

過去長期沒賠錢(跨頻)

//3年前往前6年都沒賠過錢

condition21=

trueall(Getfield("每股稅後淨利(元)", "Y")[3]>0, 6);

If condition21 then ret=1;

營收創新高

```
value31=highest(GetField("月營收", "M")[1], 12);
```

```
condition31= GetField("月營收", "M")>value31;
```

```
if condition31 then ret=1;
```

跨頻選股建議

- 儘量利用系統選股條件
- 不同資料頻率分開寫，再組合成同一策略
- 利用`getfield()[]` 寫在同一腳本
- 資料讀取筆數要注意

The image features a background of an aerial cityscape, showing various buildings, roads, and green spaces. A large, solid blue diagonal shape cuts across the image from the top-left towards the bottom-right. The text '預估EPS' is centered within the blue area.

預估EPS

預估原則

目標值 = 已實現的值 + 未實現的值

只有未發的部份才需要預估

當日預估量 = 當日當時量 + 剩餘時間預估量

年EPS = 已發生季EPS和 + 未發生季的預估EPS和

未發生季EPS = 已實現月份 + 未實現月份預估和

季預估EPS = 月營收和*營業利益率/股本

參考案例

符合文章: 預估EPS

我是我的分析師之四: 如何預估EPS

發表日期: 2019-09-25

我曾經寫過一篇文章: 如何預估EPS 跟大家分享在預估了營收, 毛利率及營業費用的變動幅度之後, 如何透過一個函數來算出預估的EPS, 作為一個沒有在投研機構工作的民間小小投資人, 我們不大可能幫每一檔股票建構一個EPS的完整試算表, 但我們可以透過收集各種數據及公司給的預估數字, 來給定未來營收的預估年增... [繼續閱讀 »](#)

分類: 操作心得

私房秘技之如何預估EPS

發表日期: 2019-06-03

最近公司的小朋友問了我一個問題: “你都怎麼挑標的及喊目標價?”, 為什麼你敢站在台上直接喊XX股票未來會到XX元? 剛泡好咖啡, 對著電腦, 路上無車無人, 我就花點時間來回答這個問題, 文章會又臭又長, 想要馬上發大財的朋友請直接飄過去。話說當年我剛開始當研究員的時候, 要開始推薦股票, 有天大師兄把我叫進... [繼續閱讀 »](#)

預估EPS

搜尋

指標

選股

大盤產業

投資思潮

程式語法

XQ功能說明

美國股市

資產配置

固定收益

交易策略

An aerial photograph of a city, likely Taipei, showing a mix of urban development, green spaces, and a large stadium. A large, solid blue triangle is overlaid on the right side of the image, pointing towards the center. The title '跨頻率序列' is written in white Chinese characters within this blue area.

跨頻率序列

Average(價格序列,期數)

Average(c, 5)

日K		5分K	
C	今日收	C	5分收
C[1]	昨日收	C[1]	前5分收
C[2]	前日收	C[2]	前前5分收
C[3]	前前日收	C[3]	前前前5分收
C[4]	前前前日收	C[4]	前前前前5分收

跨頻率資料

CloseW 週收盤價

CloseW(0)

本週收盤價

CloseW(1)

上週收盤價

CloseW(2)

上上週收盤價

CloseW(3)

上上上週收盤價

CloseW(4)

上上上上週收盤價

Average跨頻率資料

Average(CloseW(0), 5)

CloseW(0)

K的週收盤價

CloseW(0)[1]

前根K的週收盤價

CloseW(0)[2]

前二根K的週收盤價

CloseW(0)[3]

前三根K的週收盤價

CloseW(0)[4]

前四根K的週收盤價

Average跨頻率資料

~~Average(CloseW(0), 5)~~

五週的平均價，是要這些資料

CloseW(0)

這週收盤價

CloseW(1)

上週收盤價

CloseW(2)

上上週收盤價

CloseW(3)

上上上週收盤價

CloseW(4)

上上上上週收盤價

Average跨頻率資料

Average(getfield(“收盤價”, “W”), 5)

getfield(“收盤價”, “W”)	週收盤價
getfield(“收盤價”, “W”)[1]	上週收盤價
getfield(“收盤價”, “W”)[2]	上上週收盤價
getfield(“收盤價”, “W”)[3]	上上上週收盤價
getfield(“收盤價”, “W”)[4]	上上上上週收盤價

An aerial photograph of a city, likely Tokyo, showing a dense urban landscape with various buildings, roads, and green spaces. A large, solid blue diagonal shape overlays the right half of the image, creating a modern, graphic design. The text '雷達回測調校' is centered within this blue area.

雷達回測調校

KD腳本

```
settotalbar(100);  
variable:rsv1(0),k1(0),d1(0);  
stochastic(9,3,3,rsv1,k1,d1);  
condition1 = k1 crosses over 20;  
if condition1 then ret=1;
```

KD策略雷達

回測

雷達設定

手機	下單	名稱	來源	腳本	多空	頻率	執行商品
		KD脫離賣超區策略	自訂	KD脫離賣超區	多	日	台股上市
		KD法人移動停利	自訂	KD法人移動停利		日	鉅象(329)
		一長一短波段_空方...	自訂	一長一短波段策略警示_單次警示	空	30分鐘	台股上市
		一長一短波段_多方...	自訂	一長一短波段策略警示_單次警示	多	30分鐘	台股上市
		一長一短(單次警示用)	自訂	一長一短(單次警示用)		30分鐘	台股上市
		KD脫離賣超區	自訂	KD脫離賣超區	多	日	指數成在
		成交量突破N倍均量	自訂	成交量突破N倍均量		5分鐘	指數成在
		建軍盤中	自訂	建軍盤中		日	指數成在
		誠懇哥近期大量警示	自訂	誠懇哥近期大量警示		日	台股上市

腳本設定 KD脫離賣超區

參數名稱 值

屬性設定

參照商品: ☐ 基準商品參照...(B)

多空方向: 多方 觸發設定: 啟動後只觸發一次

指定頻率: 日

資料讀取: 100 筆 2019 4/10

執行商品: 組合 台股上市種類股-普通股全部(組合)

KD雷達回測

執行回測[策略](Beta版) : KD脫離賣超區策略

回測5年

作多 作空

執行頻率：日

開始日期：2014/7/8 結束日期：2019/7/8

組合：台股上市櫃類股-普通股全部(組合) 設定

進場設定

☒ 脚本：KD脫離賣超區

參數名稱	值
資料讀取筆數	100
模擬逐筆洗價	<input checked="" type="checkbox"/>
最大同時進場次數	1

進場價格：○ 下期開盤價 ○ 當期收盤價

簡單停損停利

出場設定

☐ 脚本：

資料讀取筆數	200	模擬逐筆洗價	<input type="checkbox"/>
停利：股票：	10 %	期貨：	50 點
停損：股票：	10 %	期貨：	50 點
最大持有時間：	1 期		

出場價格：○ 下期開盤價 ○ 當期收盤價

交易設定

交易費用：股票：0.2 % 期貨：100 元 期貨保證金成數：13.5 %

☐ 啟動脚本內Print指令 ? 開始回測 取消

KD雷達回測

執行回測[策略](Beta版) : KD脫離震盪策略

作多 **作空**

執行頻率: 日
開始日期: 2014/7/8
結束日期: 2019/7/8
組合: 台股上市櫃類股-普通股全部(組合) 設定

進場設定
☒ 腳本: KD脫離震盪區
參數名稱 值
☒ 資料讀取筆數: 100 ☒ 模擬逐筆洗價
☒ 最大同時進場次數: 1
進場價格: ☐ 下期開盤價 ☒ 當期收盤價

出場設定
☐ 腳本:
☐ 資料讀取筆數: 200 ☐ 模擬逐筆洗價
☒ 停利: 股票: 10 % 期貨: 50 點
☒ 停損: 股票: 10 % 期貨: 50 點
☐ 最大持有時間: 1 期
出場價格: ☐ 下期開盤價 ☒ 當期收盤價

交易設定
交易費用: 股票: 0.2 % 期貨: 100 元 期貨保證金成數: 13.5 %

☐ 啟動腳本內Print指令 ? 開始回測 取消

最大同時進場次數

KD雷達回測

執行回測[策略](Beta版)：KD脫離賣超區策略

執行頻率：日
 開始日期：2014/ 7/ 8
 結束日期：2019/ 7/ 8
 組合：台股上市櫃類股-普通股全部(組合)

進場設定

☒ 腳本：KD脫離賣超區

參數名稱	值
資料讀取筆數	100
<input checked="" type="checkbox"/> 模擬逐筆洗價	
<input checked="" type="checkbox"/> 最大同時進場次數	1
進場價格： <input type="radio"/> 下期開盤價 <input checked="" type="radio"/> 外盤最低價	

出場設定

☐ 腳本：

資料讀取筆數	200
<input type="checkbox"/> 模擬逐筆洗價	
<input checked="" type="checkbox"/> 停利：股票：10 % 期貨：50 點	
<input type="checkbox"/> 停損：股票：10 % 期貨：50 點	
<input type="checkbox"/> 最大持有時間：期	
出場價格： <input type="radio"/> 下期開盤價 <input checked="" type="radio"/> 當期收盤價	

交易設定

交易費用：股票：0.2 % 期貨：100 元
 期貨保證金成數：13.5 %

☐ 啟動腳本內Print指令

模擬逐筆洗價

KD雷達回測

月K：以日K模擬洗價

周K：以日K模擬洗價

日K：以1分K模擬洗價

分K：以1分K模擬洗價

回測報表



勝率、報酬不佳

增加法人籌碼條件

```
settotalbar(100);  
variable:rsv1(0),k1(0),d1(0);  
stochastic(9,3,3,rsv1,k1,d1);  
condition1 = k1 crosses over 20;  
value1 = GetField("外資買賣超");  
value2 = GetField("投信買賣超");  
condition2 = value1>100 and value2>100;  
if condition1 and condition2 then ret=1;
```

再回測



短線調整停損停利

執行回測[策略](Beta版) : KD脫離賣超區策略

作多 **作空**

執行頻率: 日
開始日期: 2014/7/8
結束日期: 2019/7/8
組合: 台股上市櫃類股-普通股全部(組合) 設定

進場設定

☒ 脚本: KD脫離賣超區

參數名稱	值
資料讀取筆數	100
模擬逐筆洗價	<input checked="" type="checkbox"/>
最大開進次數	1

進場價格: ☐ 下期開盤價 ☒ 當期收盤價

出場設定

☐ 脚本:

參數名稱	值
資料讀取筆數	100
模擬逐筆洗價	<input type="checkbox"/>
停利: 股票	5 %
停損: 股票	5 %
期貨	50 點

最大持有時間: 1 期

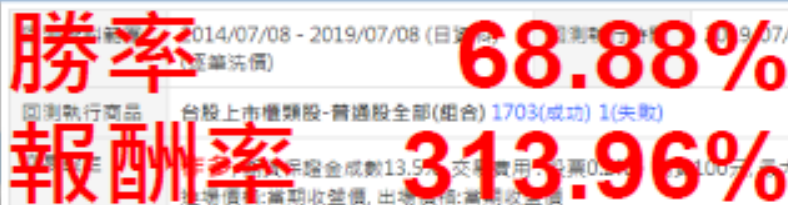
出場價格: ☐ 下期開盤價 ☒ 當期收盤價

交易設定

交易費用: 股票: 0.2 % 期貨: 100 元 期貨保證金成數: 13.5 %

☐ 啟動脚本內Print指令 ? 開始回測 取消

調整停損停利



檢視商品

回報報告[策略](Beta版)KD策略賣超買策略 (執行時間:00:01:57) (未儲存)

<input type="checkbox"/>	商品名稱	總交易次數▼	勝率	獲利次數	虧損次數	總報酬率	平均報酬率
<input type="checkbox"/>	廣亞科 (2408.TW)	6	100.00%	6	0	31.27%	5.21%
<input type="checkbox"/>	扶康 (2376.TW)	6	100.00%	6	0	28.99%	4.83%
<input type="checkbox"/>	備德 (1476.TW)	6	83.33%	5	1	21.15%	3.53%
<input type="checkbox"/>	聯益 (6153.TW)	5	20.00%	1	4	-18.33%	-3.67%
<input type="checkbox"/>	先聲 (5349.TW)	5	80.00%	4	1	14.07%	2.81%
<input type="checkbox"/>	和碩 (4938.TW)	5	100.00%	5	0	26.47%	5.29%
<input type="checkbox"/>	聯發 (2811.TW)	5	60.00%	3	2	12.41%	2.48%
<input type="checkbox"/>	華新科 (2492.TW)	5	60.00%	3	2	3.52%	0.70%
<input type="checkbox"/>	友達 (2409.TW)	5	60.00%	3	2	3.19%	0.64%
<input type="checkbox"/>	鴻海 (2317.TW)	5	80.00%	4	1	14.06%	2.81%

個別商品股性不合

排除股性不合的商品

```
if symbol="6153.TW" then raiseruntimeerror("刪");  
if symbol="6269.TW" then raiseruntimeerror("刪");  
  
settotalbar(100);  
variable:rsv1(0),k1(0),d1(0);  
stochastic(9,3,3,rsv1,k1,d1);  
condition1 = k1 crosses over 20;  
.....
```


爆量偵測

比昨天量大兩倍

```
condition1 = v > v[1] * 2;  
if condition1 then ret=1;
```

比昨天5日均量大3倍

```
value1 = average(v[1], 5);  
condition1 = v > value1 * 3;  
if condition1 then ret=1;
```

創10日最大量

```
value1 = highest(v[1], 10);  
condition1 = v > value1;  
if condition1 then ret=1;
```

估計量

```
//預估今日的收盤成交量  
value1 = GetQuote("估計量");  
//value1 = q_EstimatedTotalVolume;  
condition1 = value1 > v[1] * 3;  
condition2 = v[1] > 500;  
if condition1 and condition2 then ret=1;
```

估計量爆量倍數

```
value1 = GetQuote("估計量");  
condition1 = value1 > v[1] * 3;  
condition2 = v[1] > 500;  
if condition1 and condition2 then  
begin  
    value2 = value1 / v[1];  
    retmsg = "爆量" + numtostr(value2,1)+"倍";  
    ret = 1;  
end;
```

瞬間大單

```
value1 = q_TickVolume;           //單量  
condition1 = value1 > 10;  
if condition1 then ret=1;
```

連續大單

//宣告變數，記錄連續次數

var : times(0);

//控制變數數值在執行時的變化邏輯

var : intrabarpersist times(0);

判斷即時資料

//判斷即時資料才記錄

Getinfo("IsRealTime")	=0	歷史資料
	=1	即時資料

if Getinfo("IsRealTime") = 0 then return;

連續大單

```
var : intrabarpersist times(0);  
if Getinfo("IsRealTime") = 0 then return;  
value1 = q_TickVolume;           //單量  
if value1 > 10 then times = times + 1  
else times = 0;  
condition1 = times >= 3;  
if condition1 then ret=1;
```

連續大單參數化

```
Input : v1(5,"單量"), N(3,"連續次數");  
var : intrabarpersist times(0);  
if Getinfo("IsRealTime") = 0 then return;  
value1 = q_TickVolume;           //單量  
if value1 > V1 then times = times+1  
else times = 0;  
condition1 = times >= N;  
if condition1 then ret=1;
```

連續大單且外盤

```
Input : v1(5,"單量"), N(3,"連續次數");  
var : intrabarpersist times(0);  
if Getinfo("IsRealTime") = 0 then return;  
value1 = q_TickVolume;           //單量  
value2 = q_BidAskFlag;  
if value1>V1 and value2=1 then times = times+1  
else times = 0;  
condition1 = times >= N;  
if condition1 then ret=1;
```

An aerial photograph of a city, likely Hong Kong, showing dense urban development, roads, and green spaces. A large, solid blue diagonal shape covers the right half of the image, creating a modern, graphic design. The text '早盤關鍵價' is centered within this blue area.

早盤關鍵價

限定資料頻率

```
if barfreq <> "Min"  
    then raiseruntimeerror("資料頻率不對!");  
if barinterval <> 1  
    then raiseruntimeerror("資料頻率不對!");
```

換日判斷

```
Variable : ihigh(0), ilow(9999);  
if date <> date[1] then  
begin  
    ihigh = 0;  
    ilow = 9999;  
end;
```

固定時間內關鑑價

```
if time < 091500 then  
begin  
    if h > ihigh then ihigh = h;           //最高點  
    if L < ilow  then ilow = L;           //最低點  
end;
```


設定條件

//開高

condition1 = o > c[1];

//振幅

value1 = (ihigh - ilow) / ilow * 100;

condition2 = value1 <= 2;

//量

value2 = q_PreTotalVolume;

//昨日量

condition3 = value2 >= 500;

穿越高點警示

```
If time>=091500 and condition1 and condition2
then begin
    if c > ihigh then          //穿越關鍵高價
    begin
        retmsg="穿越早盤高點";
        ret=1;
    end;
    //跌破關鍵低價
end;
```

跌破低點警示

.....

//穿越關鍵高價

if c < iLow then

//跌破關鍵低價

begin

retmsg="跌破早盤低點";

ret=1;

end;

end;

以上內容為教學範例非投資建議，內容僅供參考。

投資並非全無風險，投資人開戶、交易前應了解自身財務狀況及風險承受度，並詳閱投資相關說明文件。

富邦證券提醒您，本報告所載內容僅限「本公司客戶」使用，於您具備本公司客戶資格期間均適用，位經富邦證券同意，不得複製、轉載、張貼、重製或為其他使用，謝謝您的合作。



正向力量 開創價值

© 富邦綜合證券股份有限公司

服務信箱：service.sec@fubon.com

許可證字號：110年金管證總字第0015號

服務專線：0800-073-588/02-8178-3018

總公司地址：台北市大安區仁愛路四段169號3、4樓