



富邦金控

<彬彬哥『交易工具』系列課程(四)>

進階選股-策略開發的必經流程

富邦證券 程式交易科 林致彬(彬彬哥)



林致彬 期貨分析師CFTA

現任：富邦證券 程式交易科 副理

經歷： 群益期貨-經理
日盛期貨-資深研究員
大昌證券-IB研究員
銘傳大學-雙師課程之業界講師

專長： XQ個股程式化交易
財務工程、API相關開發
台指期當沖、突破策略開發
選擇權策略佈局
海外期貨指數趨勢、農產品供需

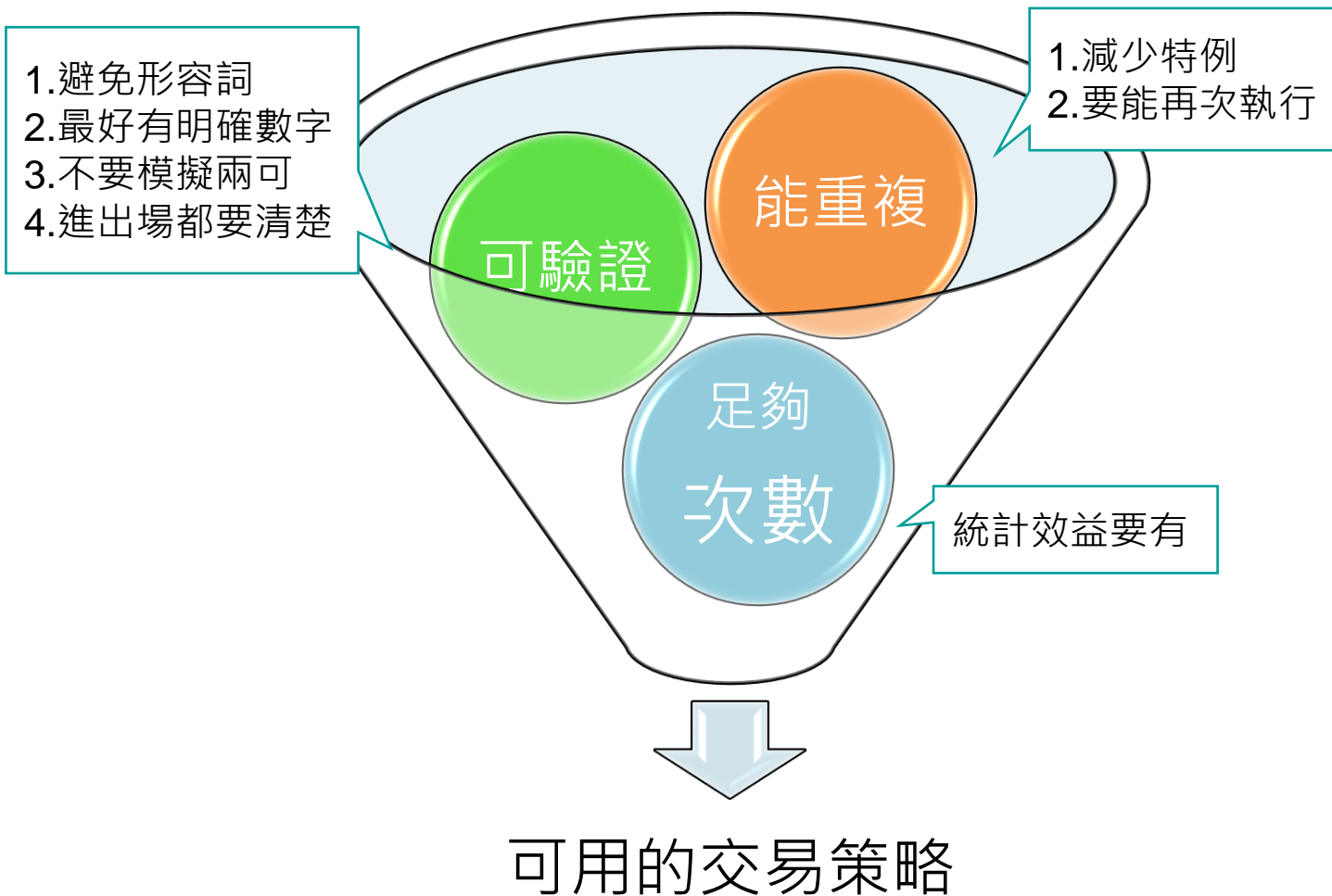


策略發想

- 1.看『老師』怎麼做？
- 2.查『Google』看方法
- 3.聽『隔壁朋友』跟你說
- 4.都不要!!給我『明牌』
- 5.自己來，努力做研究



小孩子才做選擇 我全都要!!!





看『老師』怎麼做？



驗證『老師方法』的歷史績效 + 『Google』

一、4項基本參考資料

→ 不確定性 → 量能？

1. 產業類股：選當下熱門的產業類股

2. 股本：50億以下的中小型股主力比較喜愛

股本 < 50億

3. 營收：成長，盈餘獲利及預估全年績效

4. 籌碼：法人買賣超 → 沒有比較數值



看『老師』怎麼做？



驗證『老師方法』的歷史績效

二、10條技術面篩選條件

1.趨勢：多、空、盤(日、週)

2.位置：打底、反轉、初升、主升、末升、
起漲、上漲中、高檔、回檔、支撐、壓力、
盤頭、初跌、主跌、末跌、起跌、下跌中、
低檔、反彈(日、週)

3.均線：3線多排、4線多排、6線多排、3線空
排、4線空排、6線空排(日、週)

4.K線：日、週K線的強弱變化

5.成交量：打底量、起漲量、高檔量、遇壓量、
頭部量、起跌量、低檔量、支撐量、換手量、
騙線量(日、週)

6.型態：底部型態、頭部型態、中繼型態(日、週)

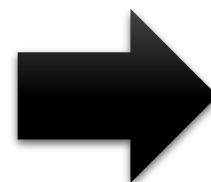
7.支撐壓力：向上的壓力，向下的支撐(日、週)

8.指標：MACD、KD(日、週)

9.背離：量價背離、指標背離(日、週)

10.獲利目標與操作定法：

短中長線目標、短中長線定法(日線操作)



果斷進入下一步



先簡化

加條件

逼近



看『老師』怎麼做？



驗證『老師方法』的歷史績效 + 『Google』



日K、月K



突破前高



突破過去N根高



拉回



當日黑K，但不破前一日低點
跌破前一日低點



強勢走紅，且越強



當月紅K，且當根紅K比前一根紅K實體長



看『老師』怎麼做？



驗證『老師方法』的歷史績效

2. 營收成長

2022年屬於空頭年
預期明年的景氣
會比今年好

在此前提下
今年營收還能不錯的企業
明年股價
有機會更上一層樓

月份	2022			2021
	營收(億)	年增(%)	累積年增(%)	營收(億)
1	1.87	9.9%	9.9%	1.70
2	1.25	-14.7%	-1.5%	1.46
3	2.23	19.0%	6.2%	1.88
4	1.85	-8.4%	2.0%	2.02
5	2.24	20.2%	5.8%	1.87
6	2.39	20.0%	8.4%	1.99
7	2.59	36.2%	12.5%	1.90
8	2.35	30.9%	14.8%	1.80
9	2.70	42.9%	18.0%	1.89
10	2.75	43.2%	20.6%	1.92
11	-	-	-	1.92
12	-	-	-	1.98
累計	22.22	-	-	22.33



月營收年增率



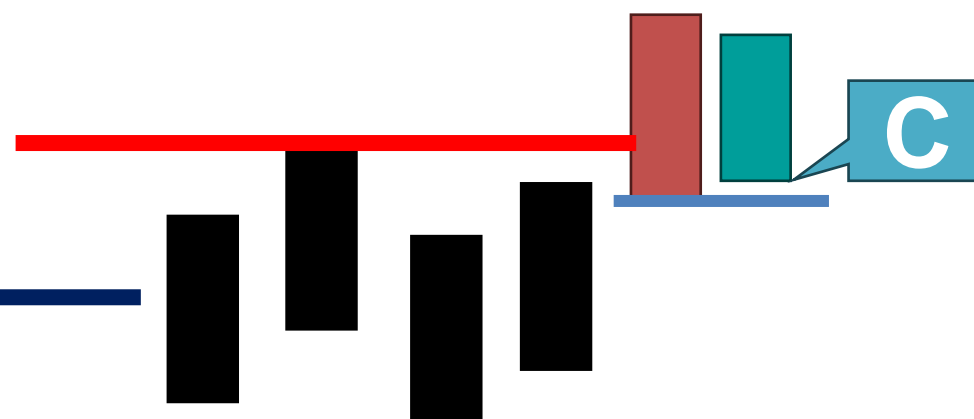
突破過去20根高

(1)當日黑K，但不破前一日低點

(2)跌破前一日低點

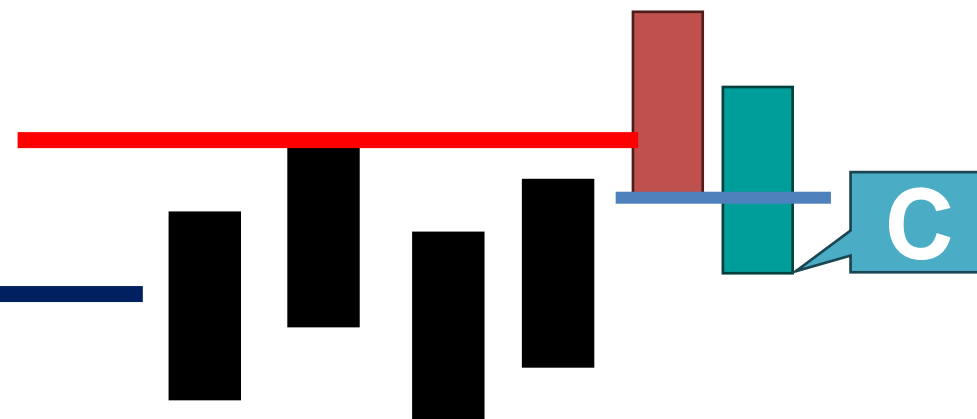
1

20根



2

20根





技術分析



1

回測資料範圍	2011/09/03 - 2023/09/03 (日資料)	回測執行時間	2023/11/16 14:00 (費時23秒)
進行商品	台股 - 普通股全部(系統) 1782(成功) 9(失敗)		
交易設定	作多 , 股票0.2%(成交金額), 最大同時進場1 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	71252	勝率%	56.38%
<input checked="" type="checkbox"/> 日 XS四(len1=20)	獲利次數	40175	虧損次數	31077
出場設定	時間加權報酬	74.27%	平均報酬率%	0.00%
停利: 股票10%	最大獲利率%(單筆)	24.90%	最大虧損率%(單筆)	-34.10%
停損: 股票10%	最大連續獲利率%	15.15%	最大連續虧損率%	-18.57%
	最大區間獲利率%	129.52%	最大區間虧損率%	-29.68%





回測範圍

2

2011/09/03 - 2023/09/03 (日資料)

回測執行時間

2023/11/16 14:01 (費時21秒)

商品

台股 - 普通股全部(系統) 1782(成功) 9(失敗)

交易設定

作多, 股票0.2%(成交金額), 最大同時進場1
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

48305

勝率%

56.73%

☐ XS四(len1=20)

獲利次數

27405

虧損次數

20900

出場設定

時間加權報酬

127.18%

平均報酬率%

0.00%

停利: 股票10%

停損: 股票10%

最大獲利率%(單筆)

20.89%

最大虧損率%(單筆)

-25.25%

最大連續獲利率%

17.16%

最大連續虧損率%

-19.75%

最大區間獲利率%

192.37%

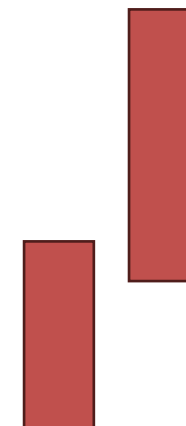
最大區間虧損率%

-27.85%





當『月』紅K
且當根紅K比前一根紅K實體長



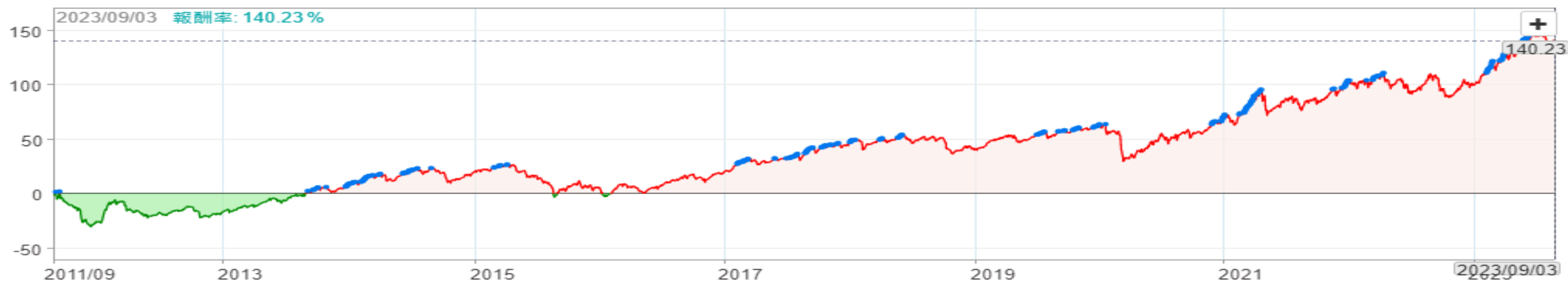
```
value1=getField("收盤價", "M")-getField("開盤價", "M");  
value2=getField("收盤價", "M")[1]-getField("開盤價", "M")[1];
```

condition2= value1>0 and value2>0 and value1>value2;



回測資料範圍	2011/09/03 - 2023/09/03 (日資料)	回測執行時間	2023/11/16 14:04 (費時19秒)
回測執行商品	台股 - 普通股全部(系統) 1782(成功) 9(失敗)		
交易設定	作多, 股票0.2%(成交金額), 最大同時進場1 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	11497	勝率%	56.61%
<input checked="" type="checkbox"/> 日 XS四(len1=20)	獲利次數	6509	虧損次數	4988
出場設定	時間加權報酬	140.23%	平均報酬率%	0.01%
停利: 股票10%	最大獲利率%(單筆)	20.41%	最大虧損率%(單筆)	-19.29%
停損: 股票10%	最大連續獲利率%	17.26%	最大連續虧損率%	-15.82%
	最大區間獲利率%	258.61%	最大區間虧損率%	-31.94%





Value3=GetFiled(“月營收年增率”, “M”)

➔得到每月月營收年增率數值

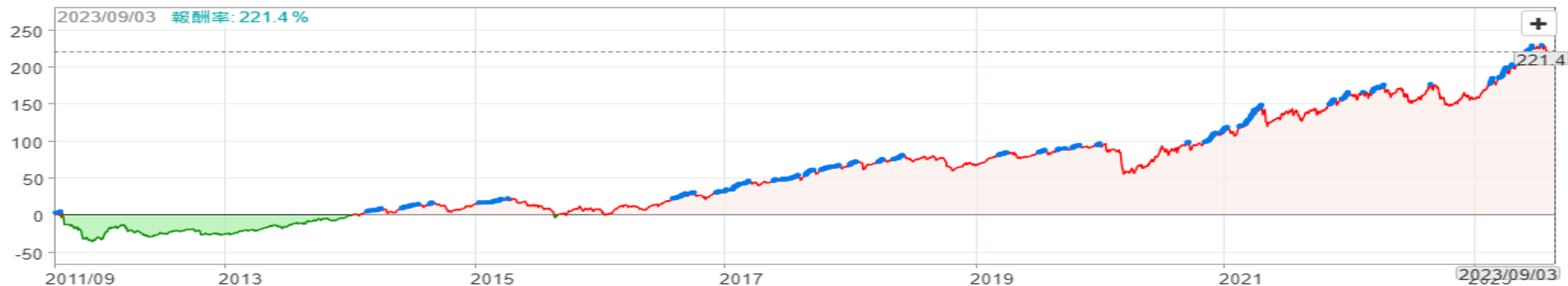


月營收年增率>0



回測資料範圍	2011/09/03 - 2023/09/03 (日資料)	回測執行時間	2023/11/16 14:03 (費時20秒)
回測執行商品	台股 - 普通股全部(系統) 1782(成功) 9(失敗)		
交易設定	作多 , 股票0.2%(成交金額), 最大同時進場1 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	6967	勝率%	58.73%
<input type="checkbox"/> 日 XS四(len1=20)	獲利次數	4092	虧損次數	2875
出場設定	時間加權報酬	221.40%	平均報酬率%	0.03%
停利: 股票10%	最大獲利率%(單筆)	20.10%	最大虧損率%(單筆)	-19.24%
停損: 股票10%	最大連續獲利率%	13.15%	最大連續虧損率%	-16.47%
	最大區間獲利率%	414.10%	最大區間虧損率%	-38.80%





加權、台灣50 VS 策略





- a.資源與知識 → 投資決策有參考價值
- b.長期投資 → 反映公司長期發展的價值
- c.績效壓力 → 尋找趨勢產業中最具成長潛力的股票
- d.中小型成交量少 → 需要連續性買超
- e.連續性買超 → 價格產生一定的影響



股價發動指標

投信的連續買超

Value4=GetFiled("投信買賣超", "D");

→ 得到每日投信買賣超數值



TrueAll(條件,期數);

→條件連續成立N期

```
Condition3=TrueAll(Value4>0,3);
```



回測資料範圍	2011/09/03 - 2023/09/03 (日資料)	回測執行時間	2023/11/16 14:07 (費時11秒)
回測執行商品	台股 - 普通股全部(系統) 1782(成功) 9(失敗)		
交易設定	作多 , 股票0.2%(成交金額), 最大同時進場1 進場價格: 下期開盤價, 出場價格: 下期開盤價		

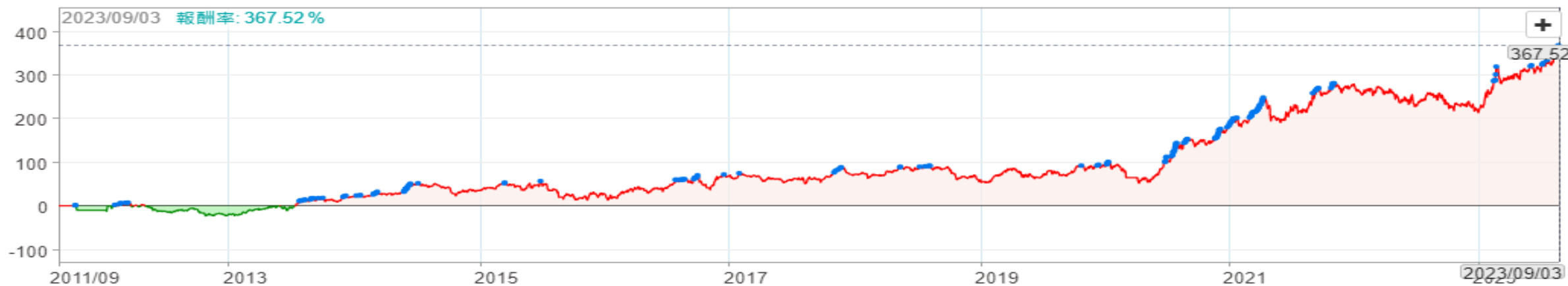
進場設定	總交易次數	452	勝率%	57.52%
<input type="checkbox"/> 日 XS四(len1=20)	獲利次數	260	虧損次數	192
出場設定	時間加權報酬	138.54%	平均報酬率%	0.31%
停利: 股票10% 停損: 股票10%	最大獲利率%(單筆)	17.84%	最大虧損率%(單筆)	-15.88%
	最大連續獲利率%	22.04%	最大連續虧損率%	-19.23%
	最大區間獲利率%	382.92%	最大區間虧損率%	-39.08%





回測資料範圍	2011/09/03 - 2023/09/03 (日資料)	回測執行時間	2023/11/16 14:08 (費時10秒)
回測執行商品	台股 - 普通股全部(系統) 1782(成功) 9(失敗)		
交易設定	作多 , 股票0.2%(成交金額), 最大同時進場1 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	611	勝率%	58.27%
<input type="checkbox"/> 日 XS四(len1=20)	獲利次數	356	虧損次數	255
出場設定	時間加權報酬	367.52%	平均報酬率%	0.60%
停利: 股票10% 停損: 股票10%	最大獲利率%(單筆)	18.96%	最大虧損率%(單筆)	-17.76%
	最大連續獲利率%	17.70%	最大連續虧損率%	-14.01%
	最大區間獲利率%	508.81%	最大區間虧損率%	-28.32%





小改一下





本次腳本贈送限富邦證券客戶，來信請
截圖富邦證券帳號

pm.trading.sec@fubon.com

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

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：112年金管證總字第 0010 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