



富邦金控

<彬彬哥『交易工具』系列課程(三)>

XQ選股密技-搶反彈

富邦證券 程式交易科 林致彬(彬彬哥)



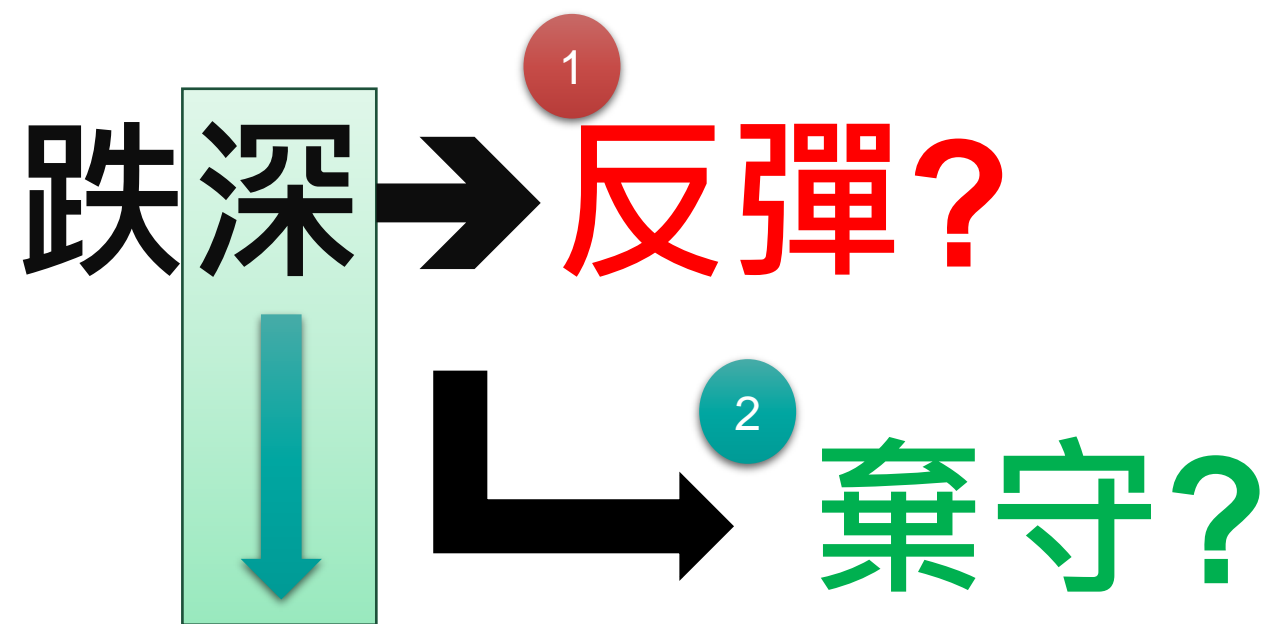
林致彬 期貨分析師CFTA

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

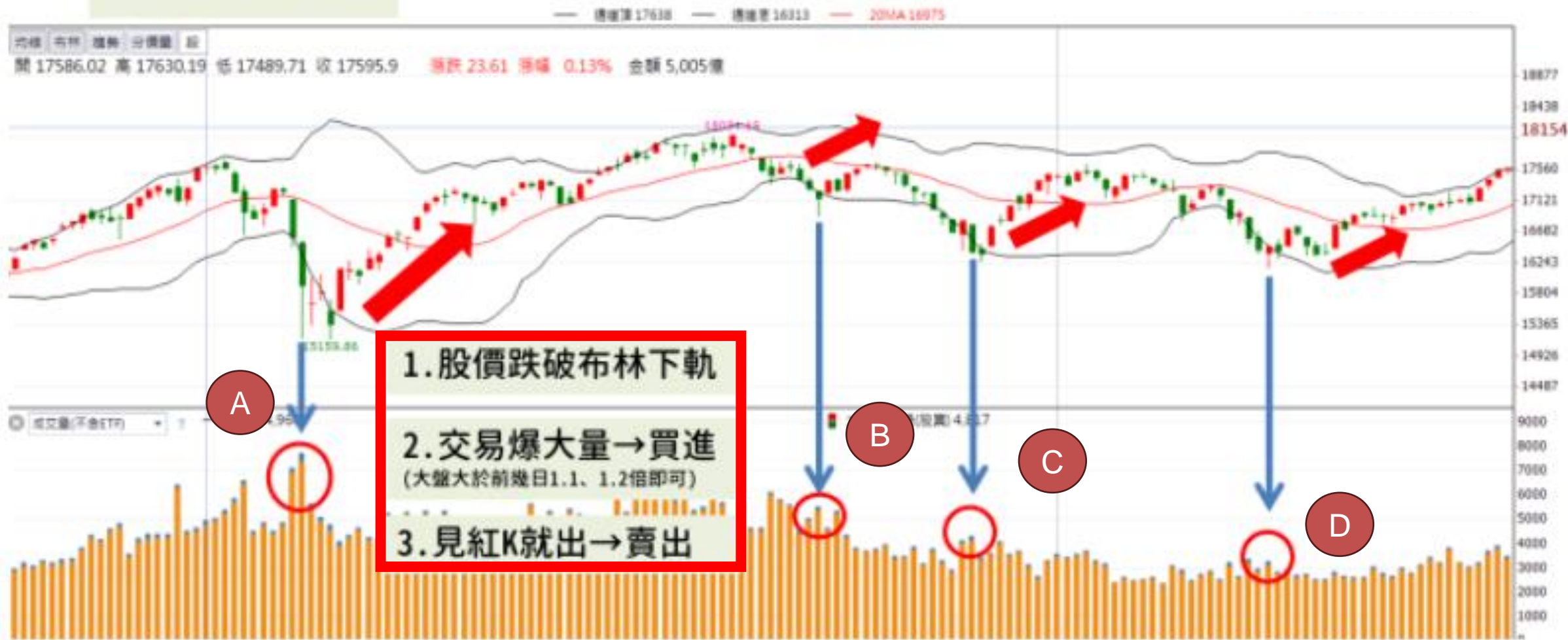
專長： XQ個股程式化交易
財務工程、API相關開發
台指期當沖、突破策略開發
選擇權策略佈局
海外期貨指數趨勢、農產品供需







搶反彈SOP





1402遠東新



遠東新(1402) 日線圖 ■ 2023/10/11 開 28.80 高 29.25 低 28.70 收 29.20 s 元 量 11520 張 +0.65 (+2.28%)

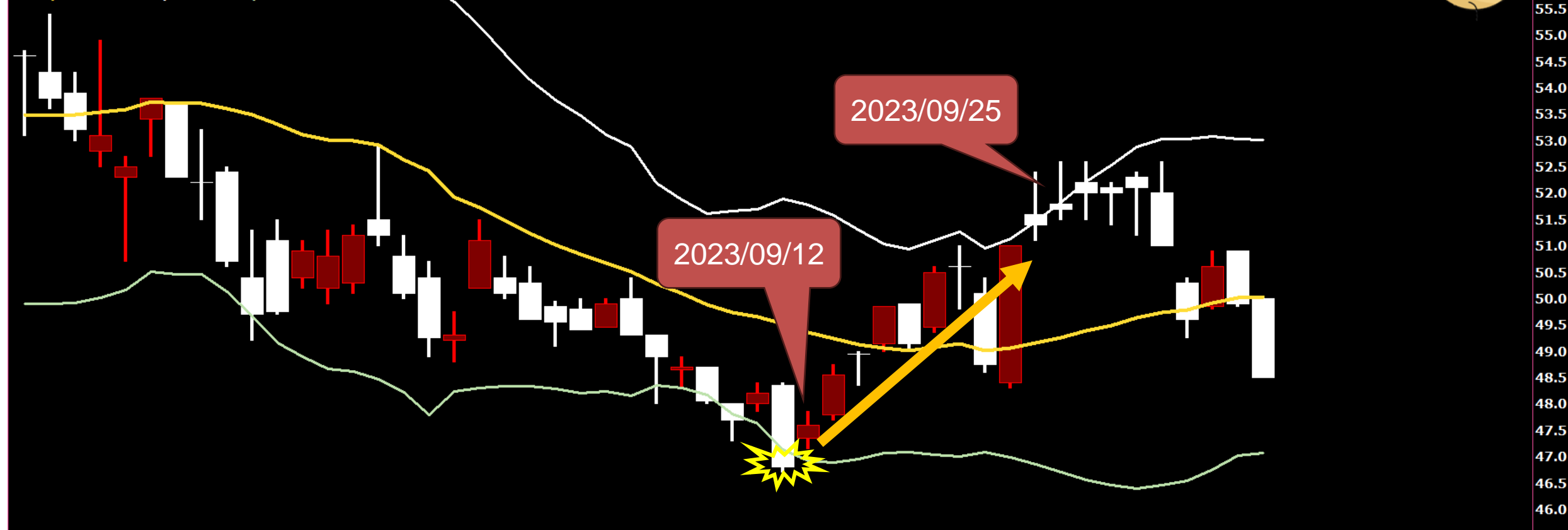
BB plot1 32.05 ↓ plot2 34.45 ↑ plot3 29.64 ↓



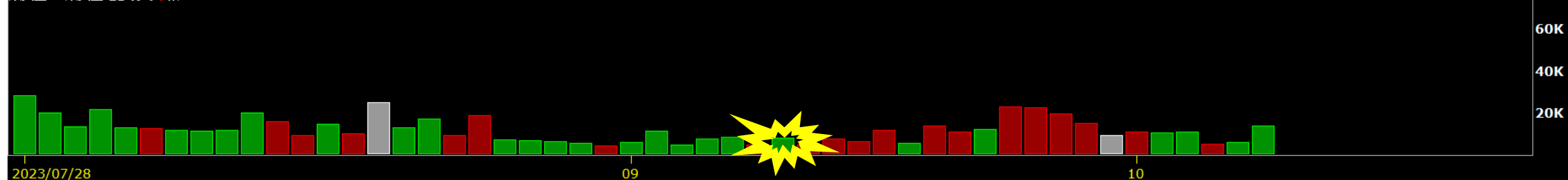


東元(1504) 日線圖 ■ 2023/10/11 開 50.00 高 50.00 低 48.50 收 48.50 s 元 量 13474 張 -1.40 (-2.81%)

BB plot1 50.03 ↑ plot2 53 ↓ plot3 47.06 ↑



成交量 成交量 13474 ↑張



2023/07/28

09

10



1. 幅度



2. 技術指標



(高點-收盤)/高點

回跌30%、大跌一半

a. 均線負乖離

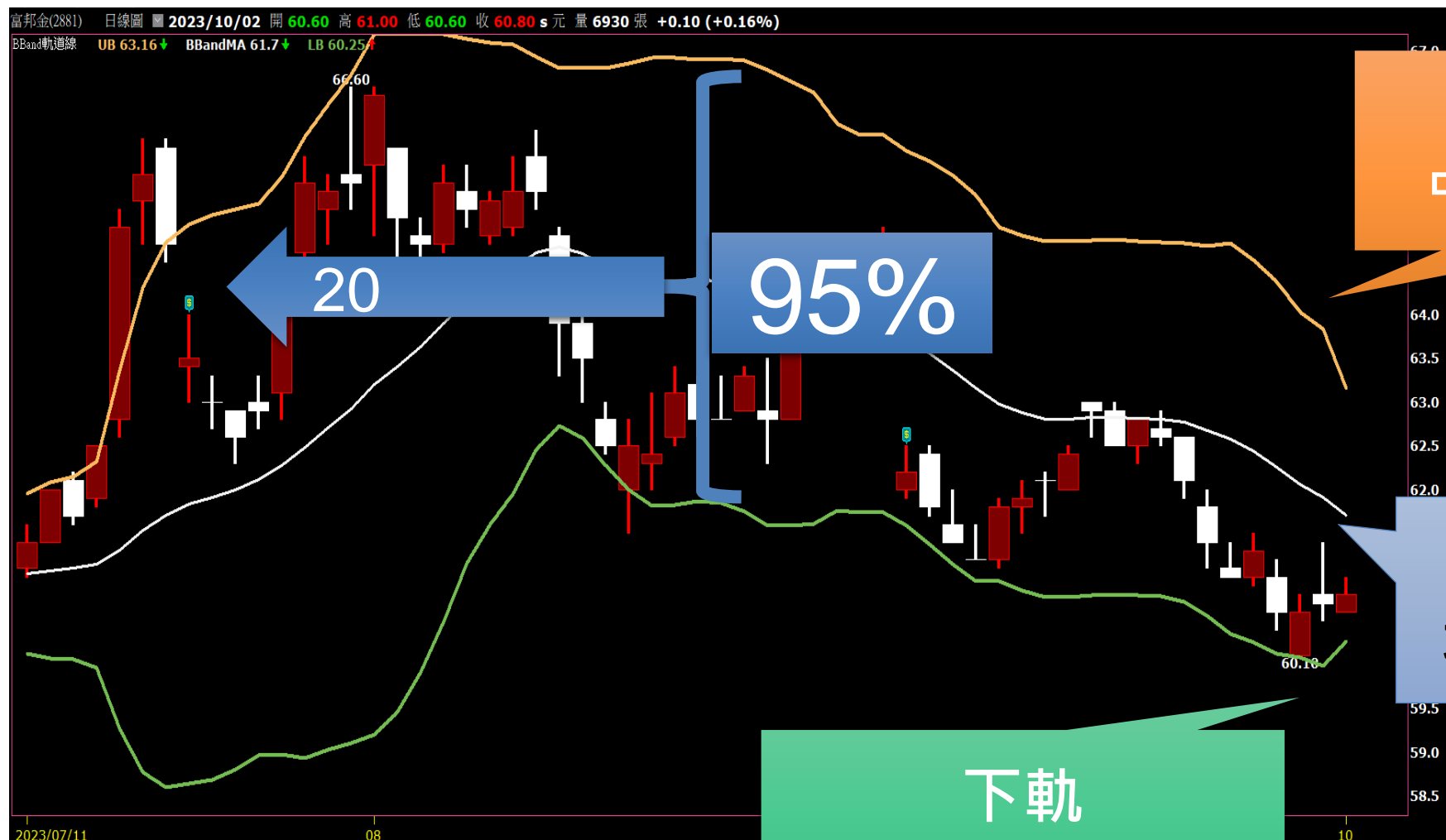
均線-收盤>

b. 跌破布林通道



c. 月線長黑K

月線格局，開盤-收盤>



上軌
中軸+2倍標準差

中軸
均線(通常用20日MA)

下軌
中軸-2倍標準差



計算中軌-20均

MA1=average(close,20);



函數

Average - 移動平均()

計算序列資料的移動平均。

回傳數值=Average(數列,期數)

傳入二個參數：

- 第一個參數是數列，通常是開高低收的價格數列。
- 第二個參數是期數。



計算上下軌(1)-標準差

Std=StandardDev(close,len1,1);



函數

StandardDev - 標準差()

計算數列的標準差。

回傳數值=StandardDev(數列,期數,母體或樣本)

傳入三個參數:

- 第一個參數是數列，通常是開高低收的價格數列。
- 第二個參數是期數。
- 第三個參數是指定計算是母體標準差(1)或樣本標準差(2)。



計算上下軌(2)-軌道本身

上軌道：

A

B

③ $UP = MA1 + 2 * Std;$

$$C = A + B$$

下軌道：

$$DN = MA1 - 2 * Std;$$

$$C = A - B$$



條件1-股價跌破布林下軌



股價

(1)收盤價(**C/Close**)

→收盤跌破(只看結果)

(2)最低價(**L/Low**)

→當日曾經跌破(注重過程)

**Condition 1 = C < DN;
L**



條件2-交易爆大量(通常為前一日的1.1、1.2倍)



交易量

當日

- V/Volume

前一日

- $V[1]/\text{Volume}[1]$

$$\text{Condition2} = V < V[1] * 1.2;$$



程式結果



```
1 inputs:len1(20,"布林通道日線天數");
2 inputs:P1(2,"布林通道倍數");
3 inputs:V1(1.2,"爆量倍數");
4
5 vars:MA1(0);           //布林通道中軸均線
6 vars:Std(0);           //標準差
7 vars:UP(0);            //布林通道上軌
8 vars:DN(0);            //布林通道下軌
9
10 MA1=average(close,len1);
11 Std=standardDev(close,len1,1);
12 UP=MA1+P1*Std;
13 DN=MA1-P1*Std;
14
15 condition1=close<DN and V>V[1]*V1 ;
16 if condition1 then ret=1;
```

網路選股策略-結果



Google搜尋-搶反彈



回測資料範圍	2011/10/10 - 2023/10/10 (日資料)	回測執行時間	2023/10/11 14:29 (費時2分44秒)
回測執行商品	台股 - 普通股全部(系統) 1786(成功) 2(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	58528	勝率%	54.07%
<input type="checkbox"/> 日 搶反彈(Google)(布林通道日線天數=20, 布林通道倍數=2, 爆量倍數=1.2)	獲利次數	31646	虧損次數	26882
出場設定	時間加權報酬	127.38%	平均報酬率%	0.00%
停利: 股票10%	最大獲利率%(單筆)	44.66%	最大虧損率%(單筆)	-27.09%
停損: 股票10%	最大連續獲利率%	15.59%	最大連續虧損率%	-23.75%
	最大區間獲利率%	196.23%	最大區間虧損率%	-31.51%



加入XQ特有條件優化

- 1.降低交易次數
- 2.提升整體績效



- 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

Value1=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(Value1>0,3);
```



搶反彈+投信連買三日



回測資料範圍	2011/10/10 - 2023/10/10 (日資料)	回測執行時間	2023/10/11 15:50 (費時1分26秒)
回測執行商品	台股 - 普通股全部(系統) 1781(成功) 7(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	1139	勝率%	60.49%
<input type="checkbox"/> 日 搶反彈(Google)(布林通道日線 天數=20, 布林通道倍數=2, 爆量倍數 =1.2)	獲利次數	689	虧損次數	450
	時間加權報酬	273.07%	平均報酬率%	0.24%
出場設定	最大獲利率%(單筆)	17.49%	最大虧損率%(單筆)	-18.11%
停利: 股票10% 停損: 股票10%	最大連續獲利率%	11.82%	最大連續虧損率%	-22.68%
	最大區間獲利率%	352.54%	最大區間虧損率%	-26.42%





每月10號以前公布上個月營收
營收成長率是指本月營收相較於去年同期或上個月的增減幅度
穩定且來自本業的月營收成長率，代表企業整體的成長動能強，未來更有機會在產業中脫穎而出，股價自然容易跟著向上成長。



股價維穩指標
月營收年增率>0

Value2=GetFiled(“月營收年增率”, “M”)

➔得到**每月月營收年增率**數值



Condition4=Value2>0;



搶反彈+投信連買三日+月營收年增率>0



回測資料範圍	2011/10/10 - 2023/10/10 (日資料)	回測執行時間	2023/10/11 15:59 (費時52秒)
回測執行商品	台股 - 普通股全部(系統) 1786(成功) 2(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	630	勝率%	61.11%
<input type="checkbox"/> 日 搶反彈(Google)(布林通道日線 天數=20, 布林通道倍數=2, 爆量倍數 =1.2)	獲利次數	385	虧損次數	245
	時間加權報酬	286.86%	平均報酬率%	0.46%
出場設定	最大獲利率%(單筆)	17.26%	最大虧損率%(單筆)	-17.40%
停利: 股票10% 停損: 股票10%	最大連續獲利率%	24.81%	最大連續虧損率%	-23.42%
	最大區間獲利率%	383.50%	最大區間虧損率%	-26.40%

...





```
1 inputs:len1(20,"布林通道日線天數");
2 inputs:P1(2,"布林通道倍數");
3 inputs:V1(1.2,"爆量倍數");
4
5 vars:MA1(0);      //布林通道中軸均線
6 vars:Std(0);      //標準差
7 vars:UP(0);       //布林通道上軌
8 vars:DN(0);       //布林通道下軌
9
10 MA1=average(close,len1);
11 Std=standardDev(close,len1,1);
12 UP=MA1+P1*Std;
13 DN=MA1-P1*Std;
14
15 value1=GetField("投信買賣超", "D");
16 value2=GetField("月營收年增率", "M");
17
18 condition1=close<DN and V>V[1]*V1 and trueall(value1>0,3) and value2>0;
19
20 if condition1 then ret=1;
```



台灣大(3045.TW) 106 =0 (0%) 高:107 低:106 開:106 量:4,348

2022/04/19

交易序號	交易日期	交易價位	報酬率	累計報酬率	持有區間
1	2013/12/17 2014/10/30	買進 94 賣出 98.8	10.96%	10.96%	214
2	2020/02/27 2020/07/06	買進 105 賣出 115.5	9.56%	20.52%	87
3	2020/09/10 2022/02/17	買進 100 賣出 105.5	9.73%	30.25%	349
4	2022/10/17 2023/03/30	買進 91.5 賣出 101	9.94%	40.19%	108
5	2023/09/01 2023/10/06	買進 93.8 賣出 94.2	0.03%	40.21%	25





東元(1504.TW) 31.4 ▼-0.1 (-0.32%) 高:31.8 低:31.1 開:31.5 量:5,108

2022/04/06

交易序號	交易日期	交易價位	報酬率	累計報酬率	持有區間
1	2011/11/22 2011/12/01	買進 16.85 賣出 18.6	9.94%	9.94%	8
2	2021/05/13 2021/06/10	買進 30.95 賣出 32.9	9.69%	19.64%	21
3	2021/08/16 2022/03/31	買進 29.6 賣出 32.6	9.69%	29.33%	152
4	2022/10/14 2023/02/16	買進 27.2 賣出 30	9.86%	39.18%	81
5	2023/09/12 2023/09/25	買進 47.35 賣出 52	9.38%	48.57%	10



如果要追強勢？



跌破下軌→突破上軌!!



股價

(1)收盤價(**C/Close**)

→收盤突破(只看結果)

(2)最高價(**H/High**)

→當日曾經突破(注重過程)

Condition1 = C > UP;
H

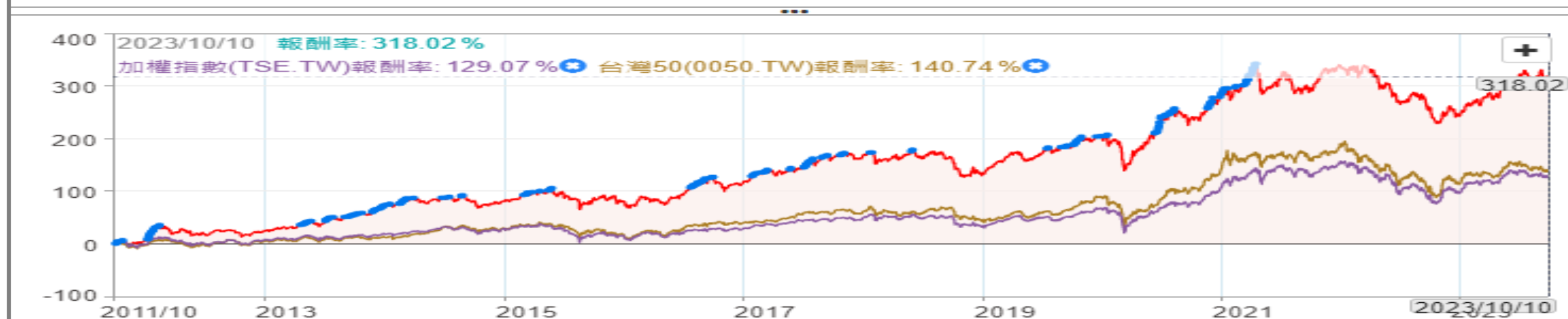


追強勢+投信連買三日+月營收年增率>0



回測資料範圍	2011/10/10 - 2023/10/10 (日資料)	回測執行時間	2023/10/11 16:25 (費時51秒)
回測執行商品	台股 - 普通股全部(系統) 1786(成功) 2(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		

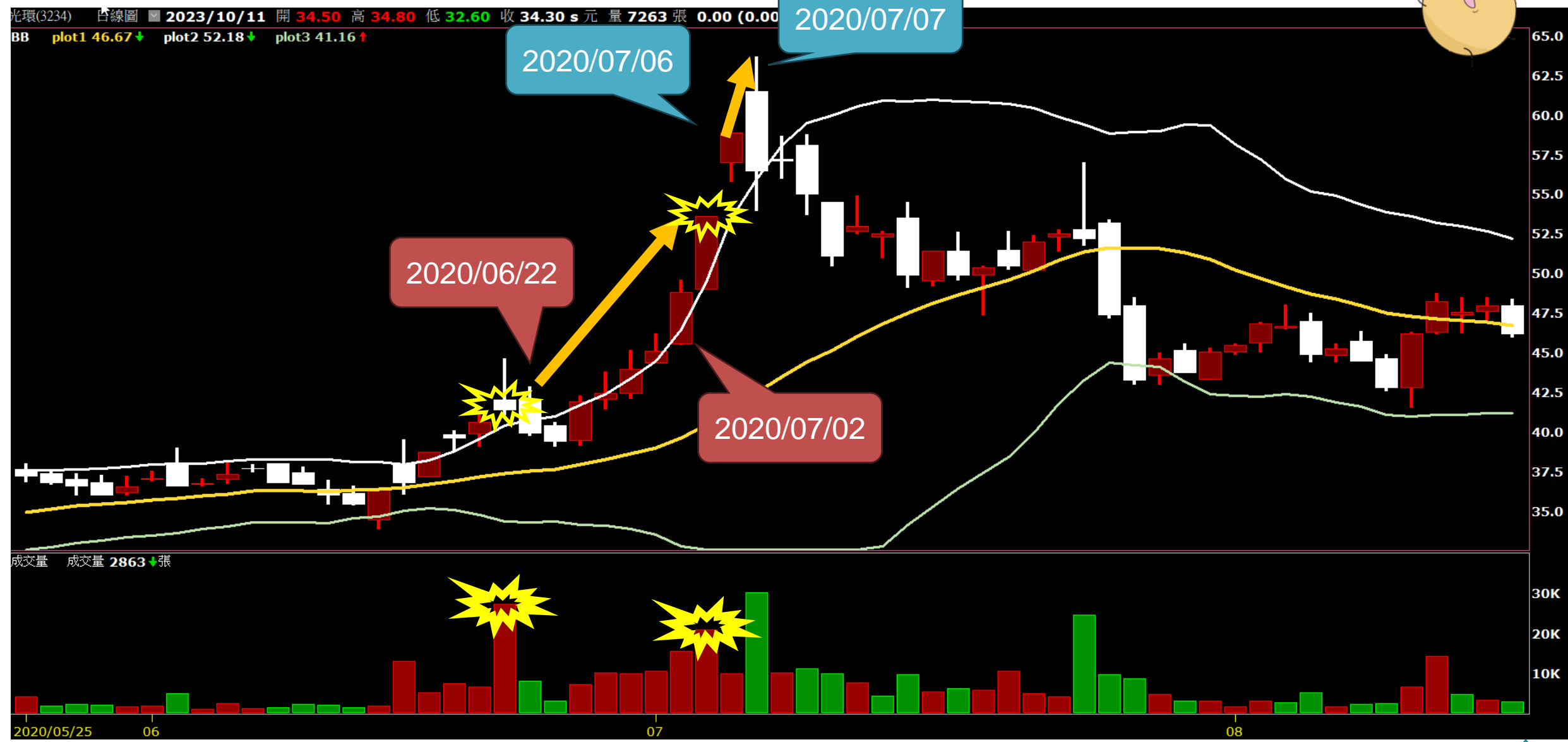
進場設定	總交易次數	4474	勝率%	56.75%
<input type="checkbox"/> 日 搶反彈(Google)(布林通道日線天數=20, 布林通道倍數=2, 爆量倍數=1.2)	獲利次數	2539	虧損次數	1935
	時間加權報酬	318.02%	平均報酬率%	0.07%
出場設定	最大獲利率%(單筆)	20.10%	最大虧損率%(單筆)	-18.78%
停利: 股票10%	最大連續獲利率%	15.57%	最大連續虧損率%	-10.05%
停損: 股票10%	最大區間獲利率%	373.07%	最大區間虧損率%	-25.75%





光環(3234.TW) 26.2 ▲0.3 (+1.16%) 高:26.2 低:25.8 開:26.1 量:279







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