

CCU-NFU Team

會議記錄

出席者：Prof. George Lin、Prof. Robert Lin、Huyen、黃柏浚

日期、時間、地點：2023/06/21、早上 11 點、線上會議

下次會議：未定

1. 說明問題

CCU 說明 NFU 結果有問題的原因在於交易次數的不同:CCU 每天只有一次交易，但 NFU 是只要符合條件，就進行交易，故一天內可能會多次交易，例如：當天第一次價高賣，第二次價低買，CCU 建議於每次符合交易條件時，製作一個計數的標記。

2. 討論延伸

- 更改參數，例如：5%改成 1、3%，展示不同參數的勝率及收益率結果
- CCU 跟 NFU 共同搜尋關鍵字 期中撮合 與 Momentum 的論文，確認裡面是否有一些有幫助的技術指標來改善現行方法的收益率及增加其勝率，建議 CCU 可先提供 1-2 篇好的 Paper 給 NFU 做些參考
- 設定目標投稿兩篇論文
- 每天不只有一次交易的機會，可以調整交易的策略
- 哪些股票或哪段時間比較容易獲得收益
- 針對節日進行標註 (Event)

3. 下一次會議

於這週內針對問題、討論延伸部分去做實作與分析，完成後再次進行會議討論。