

# 0111策略

老師:吳牧恩

組員:廖偉淵、劉冠宏、潘芷寧、林雨萱

## 摘要

標的:APPLE、大立光、台積電、玉晶光

時間:2017/1/1-2019/12/31

資金:100萬

策略:布林通道-順勢

## 目錄

01摘要

02交易策略

03重點程式碼

04結果分析

05問題與討論

## 交易策略

採用布林通道20日MA、兩倍標準差。

- 當價格接近帶狀上限，而且上漲力道經過技術指標的確認，順勢買進。
- 當價格接近帶狀下限，而且下跌力道經過技術指標的確認，順勢賣出。

## 結果分析

APPLE	大立光
勝率: 59.62%	勝率: 52.51%
賺賠比: 1.57	賺賠比: 1.42
獲利因子: 2.32	獲利因子: 1.57

台積電	玉晶光
勝率: 47.66%	勝率: 65.25%
賺賠比: 1.9	賺賠比: 1.92
獲利因子: 1.73	獲利因子: 3.61

以蘋果概念股中挑選3檔股票做績效回測，結果表現依然都還不錯。而本策略尚未考慮手續費，單純使用布林通道順勢策略去做模擬測試，因此本策略適合小額投資者作為簡單的投資參考。

## 重點程式碼

```
row1=Cl(STK)>BB[,3]
while(m<nrow(STK)){
  if (row1[m-1]==0 && row1[m]==1){
    long=as.numeric(Cl(STK)[m])
    Cash1[m]=Cash1[m-1]-long*1000
    STKValue1[m]=long*1000
    while (row1[m]==1 && m<nrow(STK)){
      m=m+1
      Cash1[m]=Cash1[m-1]
      STKValue1[m]=as.numeric(Cl(STK)[m])*1000 }
    PL1[m]=as.numeric(Cl(STK)[m])-long
    Cash1[m]=Cash1[m-1]+as.numeric(Cl(STK)[m])*1000
    STKValue1[m]=0}
  m=m+1
  Cash1[m]=Cash1[m-1]}
Cap1=Cash1+STKValue1
```

## 問題與討論

本研究假設不考慮交易成本，後續研究可將交易成本納入考量，更貼近實際之交易狀況，抑或是結合其他技術指標(KD、MACD、RSI、)，作為停損機制，等於增加篩選條件，使得交易次數減少了，以提升操作績效。