

0111策略

第十組

廖偉淵：報告

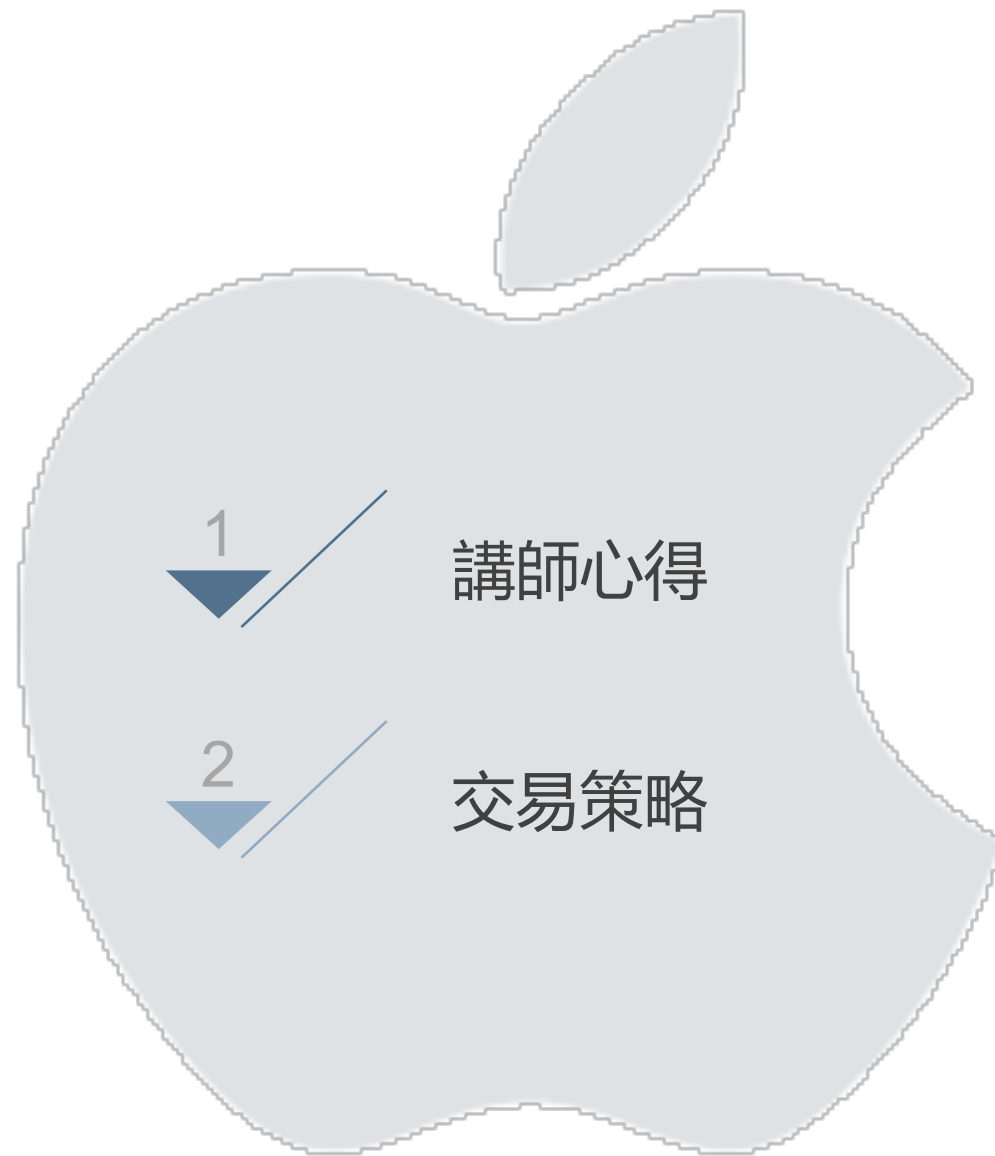
劉冠宏：code

潘芷寧：PPT

林雨萱：Poster

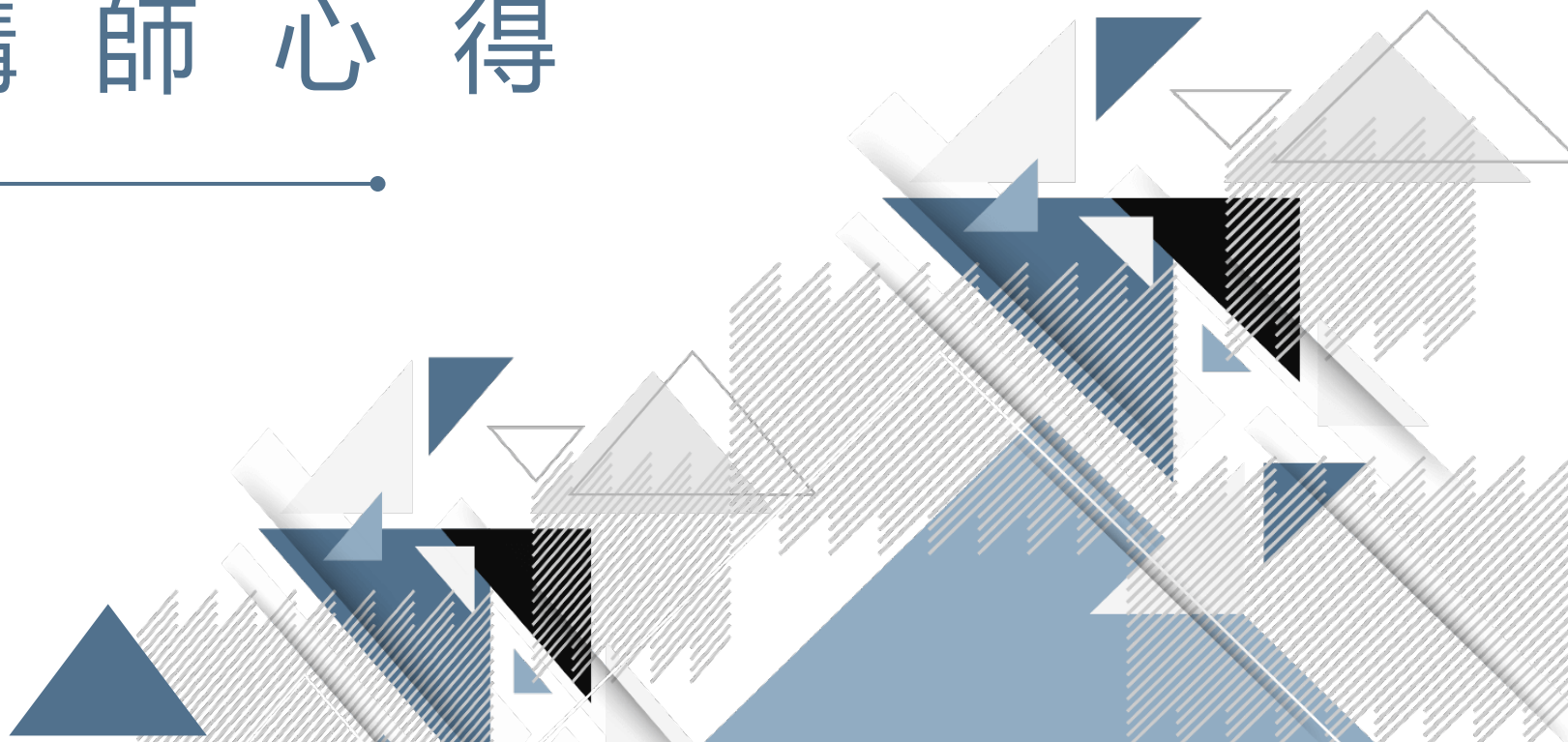
目錄

CONTENTS





01 講師心得





黃唯碩 講師



李嘉修 講師

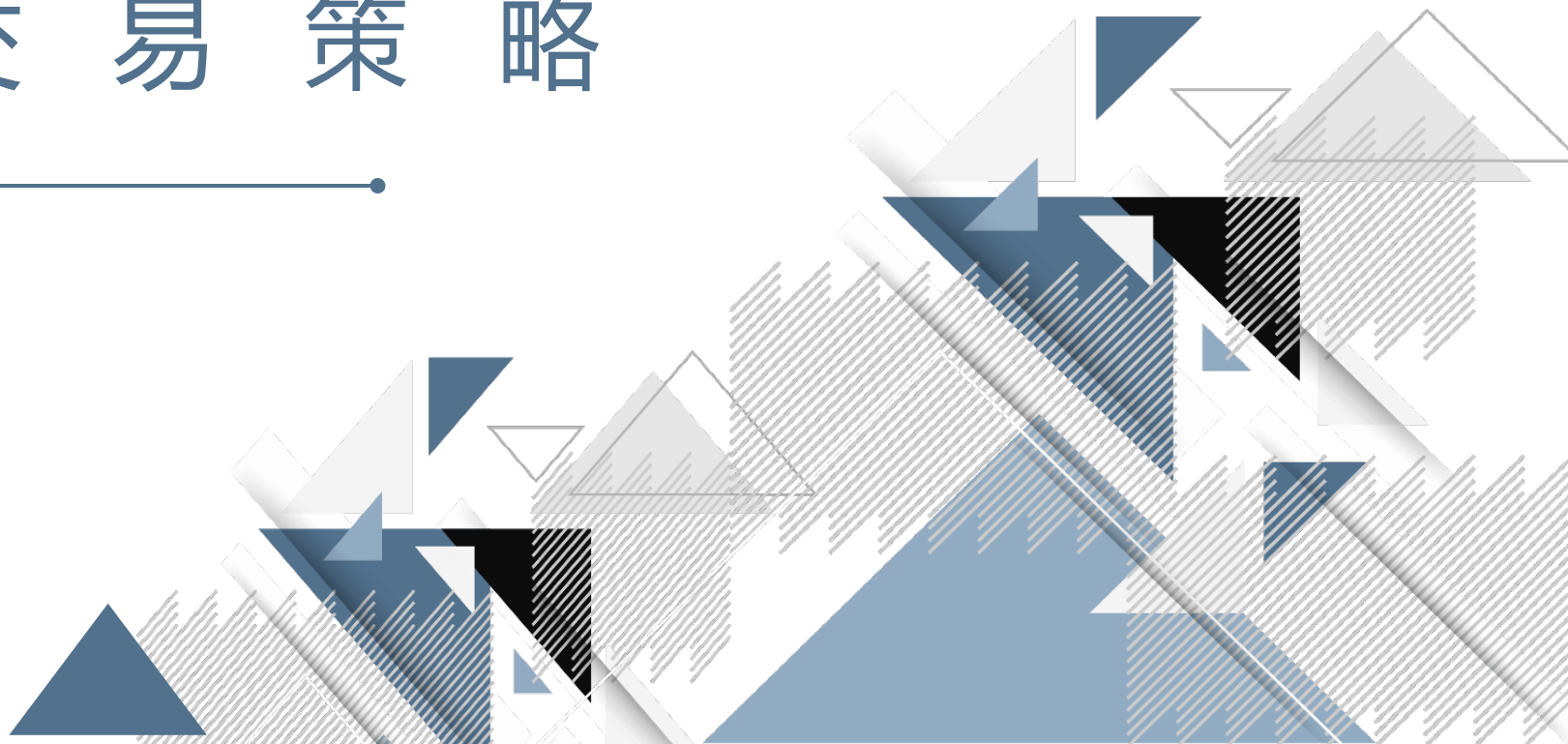


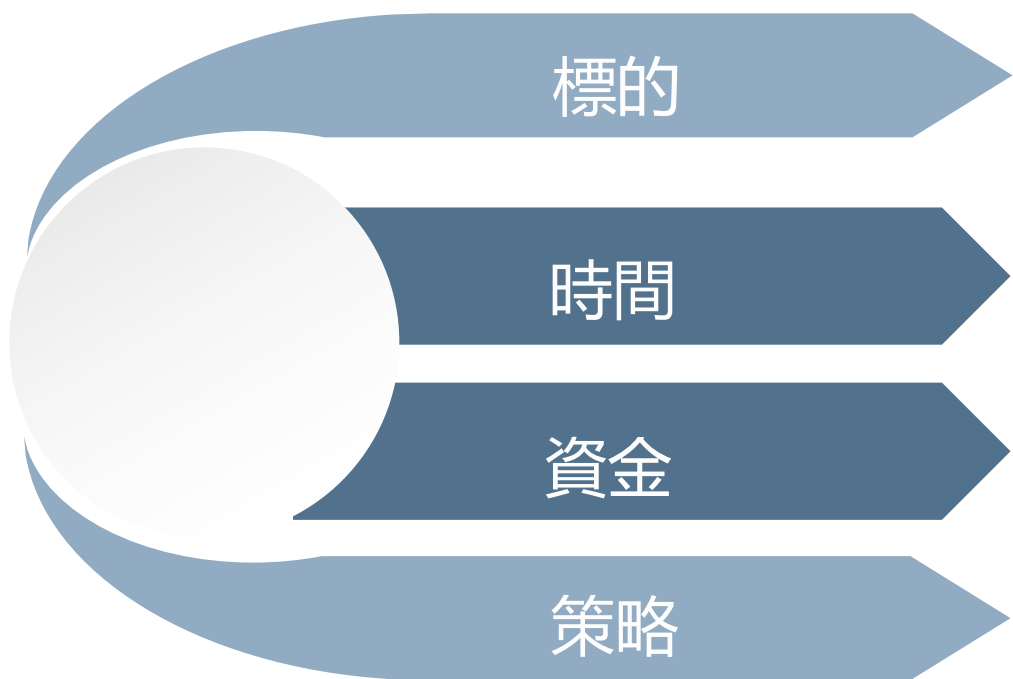
韓承佑 講師

- 選擇與思想決定未來
- 豁達的人生觀
- 日以繼夜看盤的股票上班族
- 創造自己的專屬公式
- 用簡單好記的方法解釋call、put、buy、short
- 小小的演練加強印象
- 淺顯易懂的說明
- 理論及實務操作併重
- code解釋詳盡
- 關於機器學習的概念及理論

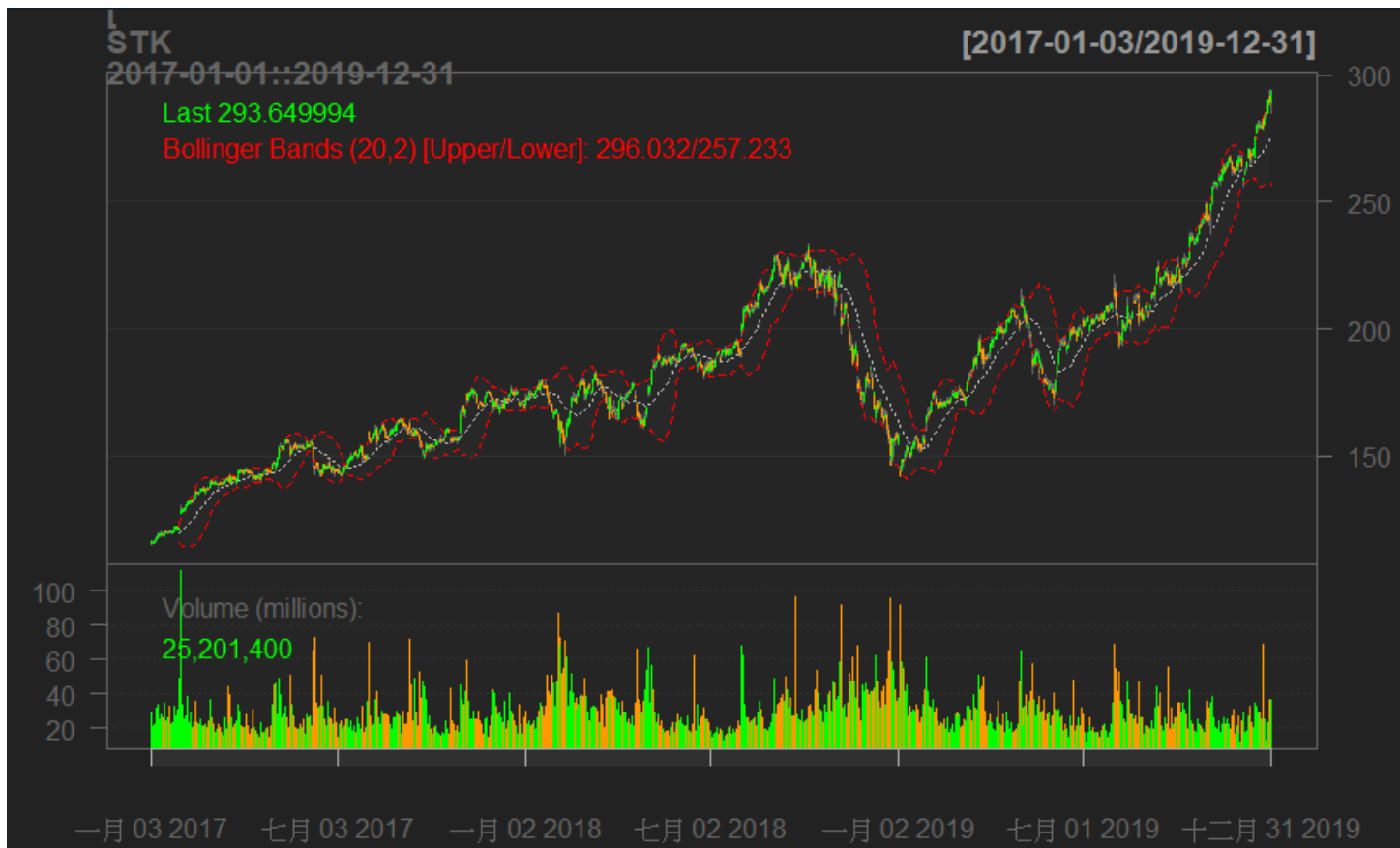


02 交易策略





-
- A large, light gray Apple logo serves as the background for the list items. The logo is centered and occupies the right half of the slide.
- 01 APPLE
 - 02 2017/1/1-2019/12/31
 - 03 台幣100萬
 - 04 布林通道



布林通道

- 由美國John Bollinger在 1980 年代發明的技術分析工具，應用上結合了移動平均和標準差的概念，基本的型態由三條軌道線組成的帶狀通道。中軌為股價的平均成本，上軌和下軌可分別視為股價的壓力線和支撐線。
- 布林線波動區間隨著價格的波動，價格波動強烈時，波動帶會變寬；波動平緩時，波動帶會變窄。

策略概念

- 使用研究標的之每日收盤價建構布林通道。

中軌

- N 週期移動平均線 (MA)，採用 20 日移動平均線，設定 $K=2$,採用兩個標準差。

上軌

- K 倍於移動平均數以上的 N 週期標準偏差的上頻帶 ($MA + K\sigma$)；當價格接近帶狀上限，而且上漲力道經過技術指標的確認，則順勢買進。

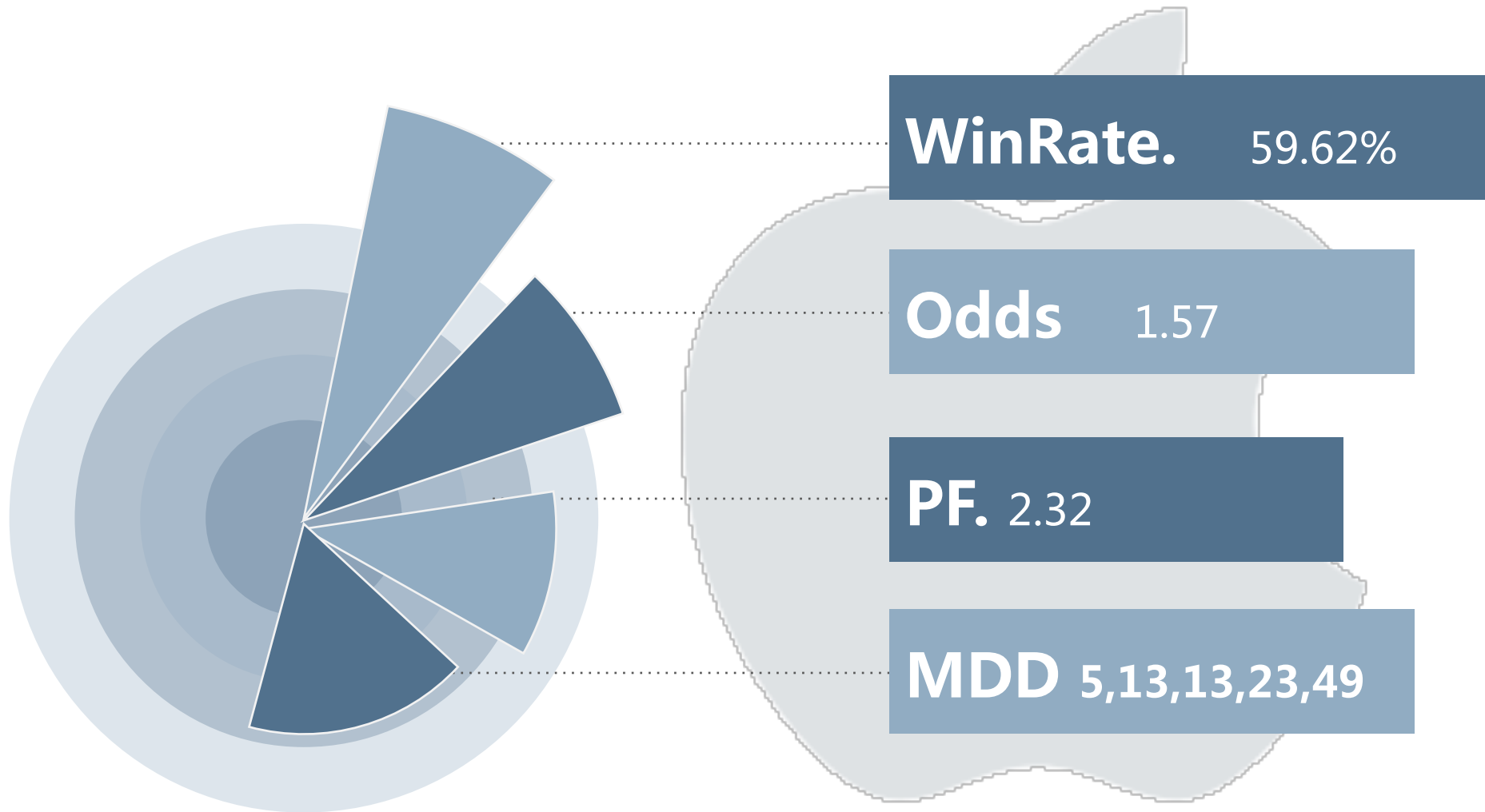
下軌

- K 倍下的低頻帶，低於移動平均值的 N 週期標準差 ($MA - K\sigma$)，當價格接近帶狀下限，而且下跌力道經過技術指標的確認，則順勢賣出。



交易策略

回測 績效



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
```



Thanks for

listening