

投資的美麗境界之 龍的傳人



第六組 - 組員：

107368024李政璋/108AB8002陳裕杰/108AB8008劉千瑜/108AB8014林子紘



目錄



01 業師心得分享



02 策略A介紹



03 策略B介紹



H₂O

01

業師心得分享

$$\frac{\sqrt{AB+CD}}{2} \approx H^2$$

A³



心得分享

黃唯碩



當沖上班族-黃唯碩
@DayTradeHuang

首頁

貼文

影片

相片

關於

社群

建立粉絲專頁

已說讚

追蹤中

分享

...

讚 · 回覆 · 5天

1



當沖上班族-黃唯碩

2019年12月26日下午8:27 · 🌐

<https://jsmarket.jihsun.com.tw/Course/Main;arealD=D>

在高雄的朋友再考慮來聽
別的區域會開別場
不用擠過來高雄…… 更多

有當沖經驗的投資人

講座內容

- 1、反市場的誤解
- 2、市場裡潛意識的動作
- 3、選股的初步
- 4、專職操作者遇到的兩大問題

活動資訊

- 日期: 01月09日(四)下午3點~5點
- 地點: 日盛證券北高雄分公司



講師: 黃唯碩



心得分享



李嘉修
(修大)

Don't be jealous of anyone, be inspired.

加朋友 追蹤 發訊息 ...

動態時報 關於 朋友 1 位共同朋友 相片 更多 ▾

你認識李嘉修嗎？

如要查看他與朋友分享的內容，傳送交友邀請給他。

加朋友

1 位共同朋友

簡介

- 就讀台中商專
- 就讀嶺東科技大學視覺傳達系
- 就讀國立台中技術學院商業設計系
- 曾就讀北斗家商
- 現居台中市
- 來自彰化市
- 2010年10月加入

李嘉修
2019年12月26日上午9:49 · 🌐

女兒的小額投資型基金
一檔22%
一檔10%
其他小賺小賠
再做異動，知道轉入哪一檔嗎？

投資標的	投資標的類別	投資成本 (新台幣)	保單結戶價值 (新台幣)	報酬率	累計單位數	平均淨值	平均匯率	最新淨值	淨值日期	最新匯率	匯率日期	在該標的持有金額	在該標的持有單位數
經濟地產工業地產	基金	10,699	11,810	10.38 %	6,08763	67.8601	30.94267	77.2	108/12/23	30.068	108/11/11		

李嘉修



心得分享

韓承佑



韓承佑

[+ 加好友](#)[追蹤](#)[發訊息](#)[...](#)

[動態時報](#)[關於](#)[朋友 1 位共同朋友](#)[相片](#)[更多 ▾](#)

你認識韓承佑嗎？

如要查看他與朋友分享的內容，傳送交友邀請給他。

 1 位共同朋友

簡介

寫code，旅行

- 之前在 Synopsys 擔任 Intern
- 曾在中央大學鋼琴社工作
- 就讀台灣大學 VLSI Design and Test Automation 系
- 在 Université Paris-Saclay 讀 Computer science。
- 就讀 National Central University Electrical engineering 系
- 就讀台北市私立延平高級中學



吳牧恩

2019年11月17日 · 🌐

【Trader高手 & 吹的高手】昨天辦了協會第一場活動『交易沙龍』。沙龍的目的是讓交易愛好者能夠彼此認識，與來賓多多交流，互相分享。我們也安排最後一段的專家座談，並且用Sli.do匿名機制提問，於是有些朋友問了比較犀利的問題。其中最直接的便是：『交易真能賺錢？為何還要出來開課收費？』。

協會本來就要站在公正第三方，但基於尊重，我們還是先知會講者，徵求其同意的情況下，我們決定讓來賓與提問者直球對決。

所幸賴聖唐總經理 Tony Lai 與 韓承佑博士回答相當合宜，我也現場補充我的觀點。我覺得現在社會有一個很要不得的現象：「酸民心態+仇富！」說更明白點：「見不得人好！」…… [更多](#)

H₂O

02

策略A介紹

A³

$$\frac{\sqrt{AB+CD}}{2} \approx H^2$$



初始資金：1,000,000 (手續費)



標的：聯發科(2454)，鴻海(2317)



選擇原因：此兩家為台灣50持股比例的前10名，其中又以這兩家公司去年的漲跌幅比例，有明顯變化，在新聞面也很有研究價值，故選擇這兩支股票做研究。



時間設定：2018/12/1 ~ 2019/12/27

策略A

黃金交叉時買進 (2日移動平均線 $>$ 5日移動平均線) ,
死亡交叉賣出 (2日移動平均線 $<$ 5日移動平均線) 。



策略A - 聯發科

市場研究方法

股價大於 5日均線，又超過10日均線 才買進；
表示短線股價呈現上漲趨勢。



以12/27日來計算

聯發科(2454) → 股價現值：446,500

現金：1,128,560

勝率：0.433 (大約100次投資聯發科，有43次是賺錢的)

賺賠比：2.21 (把賠的平均值當作1個單位，那一旦賺錢，
“平均”來說可賺2.21 個單位。)



(續) 策略A - 聯發科

聯發科(2454)

→ 獲利因子 : 1.69

獲利因子 = 所有獲利總額 / 所有虧損總額

平均 : 1.35 (因此1.69屬於較高)

最大回檔 : 54500

最大回檔率 : 23.9%



策略A – 鴻海

鴻海(2317)

→ 股價現值：91,500

現金：1,281,000

勝率：0.393 (大約100次投資鴻海，有39次是賺錢的)

賺賠比：3.45 (把賠的平均值當作1個單位，那一旦賺錢， “平均” 來說可賺3.45 個單位。)

獲利因子：2.23

最大回檔：17790

最大回檔率：21.4%

H₂O

03

策略B介紹

$$\frac{\sqrt{AB+CD}}{2} \approx H^2$$

A³





策略B – 情境

起始資金

\$ 1,000,000 NTD

交易期間

1/2/2019 ~ 12/31/2019



策略B – 選股



台股權值排行榜Top2 (12/31/2019)

公司代碼	市值(百萬元)	佔台股大盤比重(%)	累加比重(%)
2330台積電	8,582,956	23.61%	
2317鴻海	1,258,759	3.46%	27.07%

利用tradingview選股篩選器

設定為12/31/2018資料，根據以下條件篩選股票：

- ROE當年 > 15%
- 近5年EPS及revenue > 0
- 長期負債 < 60%以下
- 股價淨值 < 3
- 股息 > 2%



策略B – 市場研究方法



買入訊號為5MA向上突破10MA，同時須滿足股價在120MA之上，賣出訊號為5MA跌破10MA時。



實務上，常以240日均線(又稱年線)作為判別股票長期多空的分界，然而此次設定投資時間較短，因此以120日的半年線作個股多空指標，消除個股反彈時進場等較難應對的情況。



策略B – 部位管理



買入訊號出現，以戶頭中50%現金購入個股，之後交易日續以當下帳戶的50%購買股票，直到現金不足或賣出訊號出現，賣出所有手頭股票。



想法為確定上漲趨勢漸進式買進，避免短線波動觸發訊號而一次投入所有資金，遭受較大風險，並非追求利益最大化。



Data frame 試算 (情形一)

	Close	MA5	MA10	sign	PL	buy	cash	num	shares	net
64	245.5	242.9	243.20	FALSE	17500	0	1060000	0	0	1060000
65	245.5	243.7	243.65	TRUE	0	491000	569000	2	2	1060000
66	246.0	244.1	244.20	FALSE	1000	0	1061000	0	0	1061000



Data frame 試算 (情形二)

	Close	MA5	MA10	sign	PL	buy	cash	num	shares	net
127	249.0	242.3	242.85	FALSE	0	0	1119500	0	0	1119500
128	242.5	243.9	242.70	TRUE	0	485000	634500	2	2	1119500
129	244.0	244.6	242.60	TRUE	0	729000	390500	1	3	1122500
130	243.0	245.4	242.05	TRUE	0	729000	390500	0	3	1119500
131	242.5	244.2	242.20	TRUE	0	729000	390500	0	3	1118000
132	242.0	242.8	242.55	TRUE	0	729000	390500	0	3	1116500
133	247.0	243.7	243.80	FALSE	12000	0	1131500	0	0	1131500



2330台積電

交易天數 : 251

總報酬 : 325500

交易平均損益 : 25038.46

賺錢次數 : 10

勝率 : 76.92308 %

平均賺 : 34700

平均賠 : -7166.667

賺賠比 : 4.84186

回檔次數 : 65

最大回檔 : 10500

最大5個回檔區間 : 18 30 34 48 55

獲利因子 : 16.13953

總報酬/最大回檔 : 31



2317鴻海

交易天數 : 251

總報酬 : 242800

交易平均損益 : 18676.92

賺錢次數 : 7

勝率 : 53.84615 %

平均賺 : 43342.87

平均賠 : -10100.01

賺賠比 : 4.291369

回檔次數 : 149

最大回檔 : 36699.98

最大5個回檔區間 : 17 29 35 52 86

獲利因子 : 5.006598

總報酬/最大回檔 : 6.615808



2337旺宏

交易天數 : 251

總報酬 : 506550

交易平均損益 : 42212.5

賺錢次數 : 6

勝率 : 50 %

平均賺 : 124750

平均賠 : -40325

賺賠比 : 3.093614

回檔次數 : 159

最大回檔 : 146850

最大5個回檔區間 : 38 50 57 100

獲利因子 : 3.093614

總報酬/最大回檔 : 3.449437

H2o

分工

107368024李政璋 30% 程式撰寫-策略A

108AB8002陳裕杰 30% 程式撰寫-策略B

108AB8008劉千瑜 20% 報告內容編輯(PPT、海報)

108AB8014林子紘 20% 報告內容構想、心得分享

$$\frac{\sqrt{AB+CD}}{2} \approx H^2$$

A³

Thank you.

