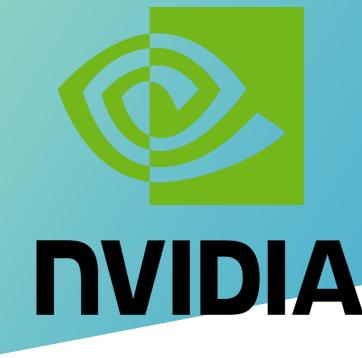
贏了就要衝,

輸了就要縮。

目錄

- 01 摘要
- 02 策略邏輯與方法
- 03 研究成果與對比
- 04 結論



01 摘要

原始資金:100萬新台幣

投資標的: NVIDIA 輝達為主 · AMD 與 INTC 為比較

投資策略:黃金交叉 all in、死亡交叉 all out

投資原因:股價起始點低,成長空間大

02 策略邏輯與方法

黃金交叉買進(20MA>120MA),all in 死亡交叉賣出(20MA<120MA),all out 以 NVIDIA 為主與類似產業超微 AMD、英特爾 INTC 去做比較,對比哪間公司的勝率、賺 賠比等等誰表現較好。

04 結論

程式跑出結果,雖然勝率以 NVIDIA 的 66.67%表現最好,即使 AMD 勝率不到四成五但賺賠比以 9.84 拔得頭籌,代表也有被投資的潛力。結果是回測,只能看到過去的事件,未來還是有許多不確定性,還是靠自己最實在!

03 研究成果與對比

```
1] "WinRate=66.67%"
- paste0("Odds=",round(mean(PL[PL>0])/abs(mean(PL[PL<0])),2)) #赚赔比
1] "0dds=1.66"
- paste0("PPE=",round(sum(PL[PL>=0])/abs(sum(PL[PL<0])),2)) #獲利因子
1] "PF=3.32"
- DDD=tail(sort(diff(which(DD==0))-1),5)## 最大達寶虧損區間
- paste0("DDD=",DDD)
1] "DDD=0" "DDD=0"
- paste0("MDD=",round(MDD,2))
1] "後利/MDD=2.32"

NVIDIA
```

> paste0("WinRate=",round(length(PL[PL>0])*100/length(PLPL-N)*100/length(PLPLN)*100/length(PLPLN)*100/length(PLPLN)*100/length(PLPLN)*100/length(PLPLN)*100/length(PLPLN)*100/length(PL[PLN])*100/len