

贏了就要衝，  
輸了就要縮。



# NVIDIA

## 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)) #賺賠比
1] "Odds=1.66"
paste0("PF=",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)## 最大連續虧損區間
paste0("DDD=",DDD)
1] "DDD=0" "DDD=0"
paste0("獲利/MDD=",round(MDD,2))
1] "獲利/MDD=2.32"
```

NVIDIA

```
> paste0("winRate=",round(length(PL[PL>0])*100/length(PL),2)) #勝率
[1] "winRate=44.44%"
> paste0("Odds=",round(mean(PL[PL>0])/abs(mean(PL[PL<0])),2)) #賺賠比
[1] "Odds=9.84"
> paste0("PF=",round(sum(PL[PL>=0])/abs(sum(PL[PL<0])),2)) #獲利因子
[1] "PF=7.87"
> DDD=tail(sort(diff(which(DD==0))-1),5)## 最大連續虧損區間
> paste0("DDD=",DDD)
[1] "DDD=0" "DDD=0" "DDD=0" "DDD=4"
> paste0("獲利/MDD=",round(MDD,2))
[1] "獲利/MDD=7.43"
```

AMD

```
> paste0("winRate=",round(length(PL[PL>0])*100/length(PL),2)) #勝率
[1] "winRate=37.5%"
> paste0("Odds=",round(mean(PL[PL>0])/abs(mean(PL[PL<0])),2)) #賺賠比
[1] "Odds=4.54"
> paste0("PF=",round(sum(PL[PL>=0])/abs(sum(PL[PL<0])),2)) #獲利因子
[1] "PF=2.72"
> DDD=tail(sort(diff(which(DD==0))-1),5)## 最大連續虧損區間
> paste0("DDD=",DDD)
[1] "DDD=0" "DDD=1" "DDD=3"
> paste0("獲利/MDD=",round(MDD,2))
[1] "獲利/MDD=4.77"
```

INTC