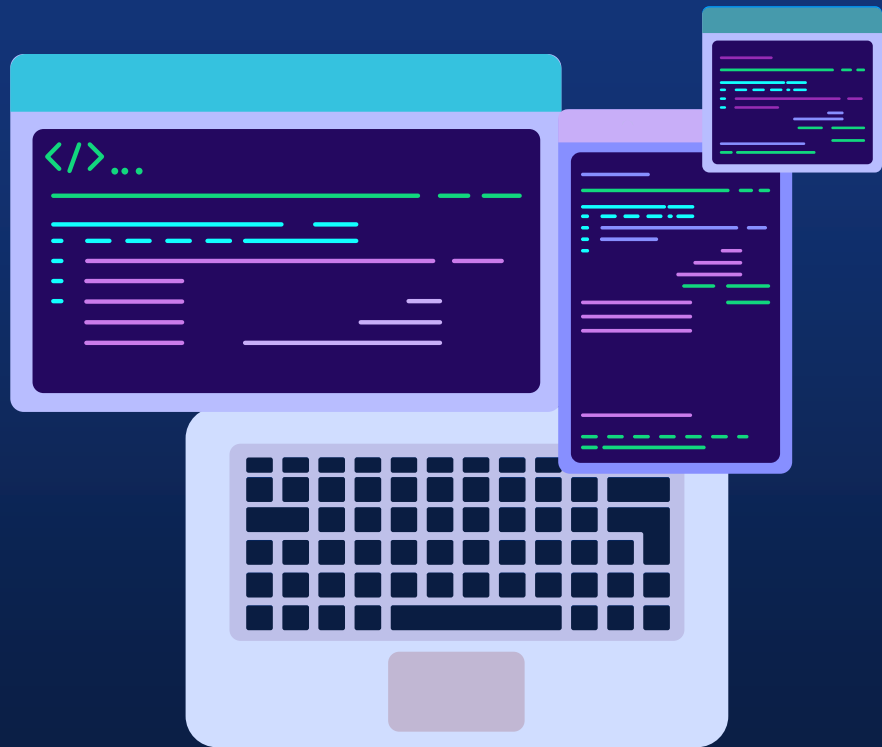


量化策略交易平台

R08723067

余柏叡





題目 - 市場資訊供應 - 新興平台

目前台股並無專業整合資料庫及程式交易且具分享訂閱功能之量化交易平台，所以我希望能建立一平台，能夠消彌平量化策略開發者與一般投資者間的隔閡，以優質的策略回測系統及一般投資者的付費訂閱，給予量化交易人持續開發策略的動力，也給予一般投資人更數據化的投資策略。

目標

平台提供給策略開發者

- 策略回測系統
- 策略開發系統
- 指標開發系統
- 資料庫
- 公開發表策略及指標

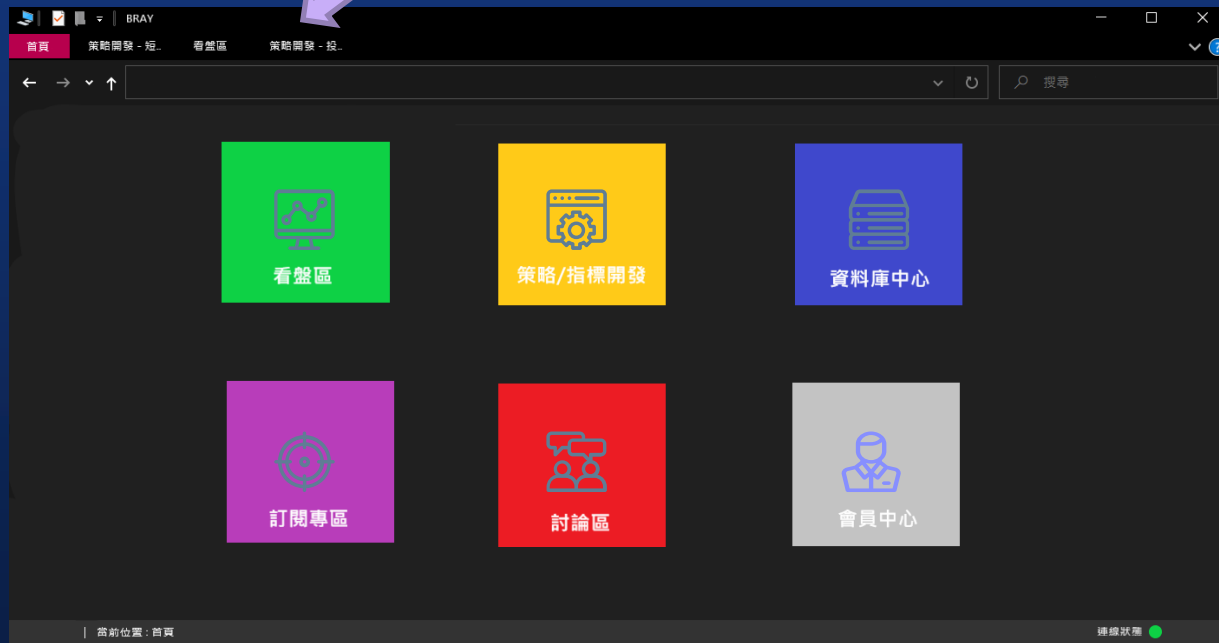
平台提供一般投資使用者

- 簡易策略回測系統
- 簡易指標檢視系統
- 簡易策略開發系統
- 訂閱策略及指標服務



主畫面

可以多開分頁使用不同功能



使用者功能介紹



平台主要功能

01

程式交易策略編寫

- 簡易型交易策略編寫(免費)
- 進階型交易策略編寫(Python)

02

程式交易策略回測

- 簡易型交易回測系統
- 進階型交易回測系統

03

臺股資料庫

多類型臺股資料庫，包含籌碼面、
基本面、技術面、總經面

04

市場指標編寫

- 市場指標編寫(Python)

05

指標及策略訂閱

- 市場指標訂閱服務
- 交易策略訂閱服務
- 明星交易人訂閱服務

06

討論區

- 個股討論區
- 策略及指標討論區



00

主要看盤區

主要看盤區



使用者選取之各項數值欄位



01

程式交易 策略編寫





簡易型交易策略編寫(免費)

按下歷史回測
便可以看出用此指標做買賣的歷史回測表現

參考模板改編自「籌碼K線」

使用者可以勾選希望使用之指標
免費方案將提供基礎指標
若有付費訂閱指標亦可使用



進階型交易策略編寫(Python)

執行、最佳化、回測顯示功能

main.py

```
1 class ModulatedVentralCircuit(QCAlgorithm):  
2  
3     def Initialize(self):  
4         self.SetStartDate(2020, 6, 28) # Set Start Date  
5         self.SetCash(100000) # Set Strategy Cash  
6         # self.AddEquity("SPY", Resolution.Minute)  
7  
8  
9     def OnData(self, data):  
10  
11         # if not self.Portfolio.Invested:  
12             # self.SetHoldings("SPY", 1)
```

此為主要編譯區，
以Python為主要語言

指標資料庫 回測表現

開=107.00 高=107.15 低=105.22 收=105.56 -0.59 (-0.56%)
成交量(Vol) 4.569M
Greedy Strategy 10 10 5
RSI Strategy 14 30 70

參考模板改編自「Quantconnect」

此為標的資訊顯示區
可以從資料庫中心呼叫



02

程式交易 策略回測



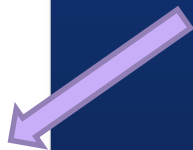
顯示策略各項簡易回測結果



進階型交易策略回測

策略績效總結果			
	所有交易	多單	空單
淨利	#611.27	#1578.29	(#967.02)
毛利	#10944.09	#5934.06	#5010.03
毛損	(#10332.82)	(#4355.77)	(#5977.05)
調整後淨利	(#2015.73)	(#252.2)	(#2858.63)
調整後毛利	#9749.99	#5077.55	#4175.02
調整後毛損	(#11765.72)	(#5329.75)	(#7033.65)
特定淨利	#1358.01	#2187.12	(#829.11)
特定毛利	#6779.14	#4494.68	#2284.46
特定毛損	(#5421.13)	(#2307.56)	(#3113.57)
帳戶所需金額	#2053.5	#1693.74	#1440.51
帳戶報酬	29.77%	93.18%	(67.13%)
初始資本報酬	0.61%	1.58%	(0.97%)
最大策略虧損	(#2260.8)	(#2396.69)	(#1835.89)
最大策略虧損(%)	(2.26%)	(2.39%)	(1.83%)
最大平倉交易虧損	(#2053.5)	(#1693.74)	(#1440.51)
最大平倉交易虧損(%)	(2.05%)	(1.69%)	(1.43%)
最大的策略虧損報酬	0.27	0.66	(0.53)
獲利因子	1.06	1.36	(0.84)
調整獲利因子	(0.83)	(0.95)	(0.59)
特定獲利因子	1.25	1.95	(0.73)
最大持有契約數量	1	1	1
清償支付	#0	#0	#0
佣金支付	#0	#0	#0
未平倉部位損益	(#47.05)	n/a	(#47.05)
年報酬率	0.12%	0.32%	(0.2%)
月報酬率	0.01%	0.03%	(0.02%)
實證持有績效	#27212.52	#26557.7	#27212.52
平均月報酬	#9.4		
報酬的標準差	#305.48		

顯示詳細各項回測結果



左側欄位可以選取觀看各類型數據回測結果

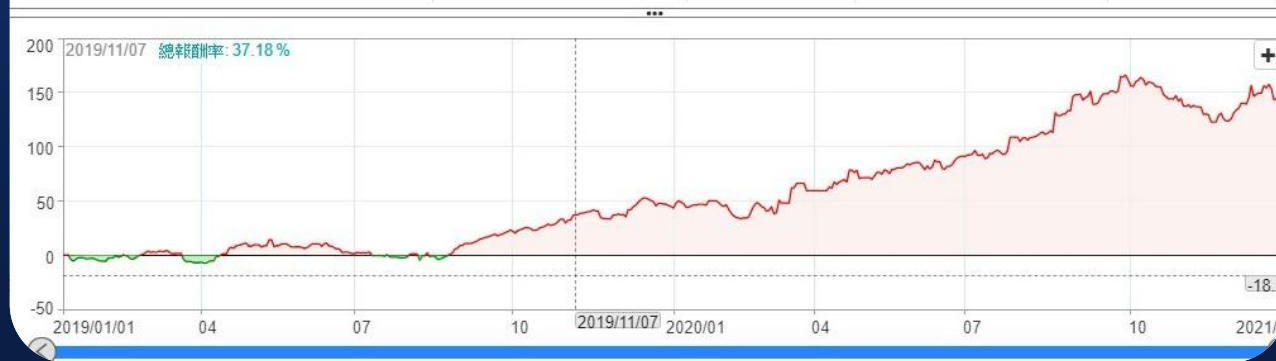
參考模板改編自「Multichart」





策略回測權益曲線

進場設定	總交易次數	1112	勝率%	56.03%
RSI < 20	獲利次數	623	虧損次數	489
出場設定	總報酬率%	142.93%	平均報酬率%	0.13%
最大持有時間: 1期	最大獲利率%(單筆)	10.86%	最大虧損率%(單筆)	-10.63%
	最大連續獲利率%	15.28%	最大連續虧損率%	-8.93%
	最大區間獲利率%	187.25%	最大區間虧損率%	-16.65%



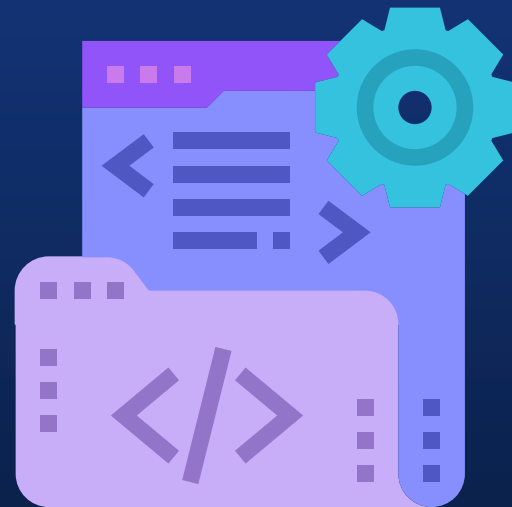


策略回測交易明細

個股	張數	買進日期	類別 價格	賣出日期	類別 價格	持有天數	報酬率
信謙(5274.TW)	1	2020/12/09	賣出 1585	2020/12/09	買進 1610	1	-1.98%
台勝科(3532.TW)	2	2020/12/10	賣出 145.5	2020/12/10	買進 138	1	4.76%
光韻(3624.TW)	3	2020/12/10	賣出 31.7	2020/12/10	買進 31.15	1	1.34%
寧筆實(8043.TW)	2	2020/12/10	賣出 29.6	2020/12/10	買進 29.3	1	0.62%
安可(3615.TW)	4	2020/12/11	賣出 23.95	2020/12/11	買進 22.7	1	4.83%
中樞(2613.TW)	1	2020/12/14	賣出 19.4	2020/12/14	買進 20.2	1	-4.53%
鈺邦(6449.TW)	1	2020/12/14	賣出 63.5	2020/12/14	買進 62.9	1	0.55%
南電(8046.TW)	1	2020/12/14	賣出 173.5	2020/12/14	買進 186	1	-7.62%
台翰(1336.TW)	3	2020/12/15	賣出 20.95	2020/12/15	買進 20.95	1	-0.40%
尼克森(3317.TW)	8	2020/12/15	賣出 43.75	2020/12/15	買進 42.75	1	1.89%
燐輝(2023.TW)	1	2020/12/16	賣出 13.4	2020/12/16	買進 13.3	1	0.35%
百達-KY(2236.TW)	1	2020/12/16	賣出 18.95	2020/12/16	買進 18.8	1	0.39%
大略-KY(4804.TW)	2	2020/12/16	賣出 16.2	2020/12/16	買進 16.05	1	0.53%
勝悅-KY(1340.TW)	5	2020/12/18	賣出 12.55	2020/12/18	買進 12.2	1	2.39%
廣宇(2328.TW)	2	2020/12/18	賣出 22.5	2020/12/18	買進 22.55	1	-0.62%
承啟(2425.TW)	7	2020/12/18	賣出 32.5	2020/12/18	買進 30.35	1	6.23%
東鹼(1708.TW)	2	2020/12/21	賣出 23.05	2020/12/21	買進 24.3	1	-5.83%
偉詮電(2436.TW)	2	2020/12/21	賣出 50.5	2020/12/21	買進 48.05	1	4.46%
和椿(6215.TW)	10	2020/12/22	賣出 16.15	2020/12/22	買進 15.9	1	1.15%
美隆電(2477.TW)	2	2020/12/23	賣出 31.3	2020/12/23	買進 31.15	1	0.08%
詠昇(6418.TW)	4	2020/12/23	賣出 14.4	2020/12/23	買進 14.75	1	-2.84%
榮創(3437.TW)	4	2020/12/24	賣出 24.95	2020/12/24	買進 25.25	1	-1.60%
乙盛-KY(5243.TW)	1	2020/12/24	賣出 50.2	2020/12/24	買進 54	1	-7.98%
司亨(5490.TW)	3	2020/12/24	賣出 27	2020/12/24	買進 27.55	1	-2.44%
益昌(2480.TW)	3	2020/12/24	賣出 53	2020/12/24	買進 53.22	1	-0.41%
益昌-KY(2583.TW)	1	2020/12/24	賣出 20.3	2020/12/24	買進 21	1	-3.98%
益昌(3431.TW)	1	2020/12/24	賣出 54.02	2020/12/24	買進 52.52	1	2.80%
益昌(6418.TW)	1	2020/12/24	賣出 14.4	2020/12/24	買進 14.32	1	0.56%

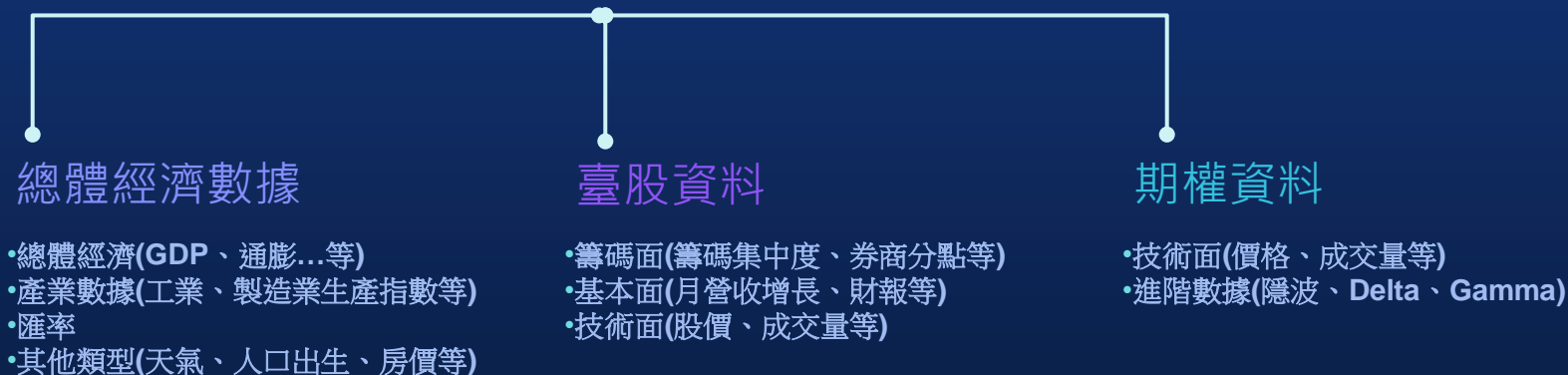
03

台股資料庫





資料庫組織圖



資料庫檢視

顯示選取當前各項類別與路徑

資料檔案，點擊進去為CSV格式顯示

將資料引用至策略/指標編寫之範例程式碼

資料基本敘述

/資料庫/股票/2330/技術面/股價/Tick

20020522_trade.zip	641bytes
20020523_trade.zip	
20020524_trade.zip	358bytes
20020528_trade.zip	291bytes
20020529_trade.zip	322bytes
20020530_trade.zip	284bytes
20020531_trade.zip	325bytes
20020603_trade.zip	313bytes
20020604_trade.zip	265bytes
20020605_trade.zip	244bytes

Show 10 entries

1 2 3 4 5 14t >

2330 - 台積電

Code Example

```
def initialize(self):
    self.AddEquity("2330.tw", Resolution.Minute)
```

Resolutions

Tick Second Minute Hour Daily

Providers

QuantQuote

Market

Taiwan

Type

Equity

Date Started

2002-05-22

資料庫檢視

資料庫之數值型資料
亦能以視覺化方式呈現

可以將資料呈現於主要看盤區



參考模板改編自「Tradingview」

04

市場指標編寫



市場指標編寫(Python)

執行結果顯示功能



參考模板改編自「Quantconnect」



市場指標顯示

執行結果顯示



參考模板改編自「Tradingview」





05

指標及策略訂閱



我的訂閱

排行

全部作者

全部策略

全部策略

排序: ☒ 推薦 ☐ 新舊

短線籌碼集中策略

8574 訂閱



月線急拉
短線籌碼穩定

[檢視策略回測](#)
上架日期: 2017/07/31

Bray

籌碼+大盤表現策略

8454 訂閱



短中長線籌碼集中股表應股
如果大盤量能不足時, 不用急著隔
天追進
可等待量縮拉回布局。

[檢視策略回測](#)
上架日期: 2016/10/27

Siv

基本面波段策略

6346 訂閱



長多策略、適合波段操作!
外資、投信都要
加上有基本面支撐, 容易成為長線
黑馬股!

[檢視策略回測](#)
上架日期: 2016/10/27

謝董

投信佈局股

5472 訂閱



以投信大買的股票為主, 適合短線
上偏多操作

[檢視策略回測](#)
上架日期: 2016/10/25

金融創新

外資投信買超策略

4246 訂閱



近20日漲幅 <20%
外資連續 買超N天以上
投信連續 買超N天以上
多頭排列(2條)

[檢視策略回測](#)
上架日期: 2018/01/19

r08723067

逆勢抄底策略

3806 訂閱



適合大盤重挫後的「逆勢搶短」策
略
隔天不管有沒搶到都記得要跑

[檢視策略回測](#)
上架日期: 2016/10/27

希望能賺大錢

訂閱策略及指標

- 可依關鍵字搜尋策略類型，將喜愛之策略點擊右上角訂閱
- 訂閱該指標或策略後，將收到指標/交易信號
- 可檢視策略之回測表現

訂閱策略及指標



可檢視訂閱策略之回測表現

非該策略開發者本人，無法看見策略之程式碼或全貌，僅能檢視開發者提供之說明，保護策略開發者。



06

討論區



策略討論區

訪客
LV. 0

0 0 0
好讚 粉紅 讚賞

我訂閱的美股

熱門爆料

動態欄

我的社團

我的私訊

我的通知

我的收藏

熱門頻道

熱門文章

熱門股票

熱門問答

熱門社團

投信佈局股

已有 2,378 人訂閱

今日標的數 4 今日績效 1.48% 今年累積報酬 35.44%

全部資訊

HOT

討論區

提問

相關新聞

熱門度: 4.9 / 5.0
網友: 1 收藏

分享 提問 1500

分享你對投信佈局股的想法吧!

公開 退出

Neil

LV.10

聯電 華邦電 星通 遠雄 華東 投信佈局股

前陣子推薦個股分析

聯電
今天小跌破高點，看明日是否站穩47.5以上，後續持續看多

華邦電
今日冤魂滿載，但目前未跌破半，觀望明日狀況

華東
量縮像是洗籌碼，沒跌破半持續抱著

遠雄
小跌作收，k線力道轉弱，後續仍然看多

矽格
明天沒站穩在45.8可能又要稍微盤一下，支撐線是44.7，沒跌破都可以持續抱著

星通
持續觀察中

可針對選取之交易策略進行意見分享

可瀏覽他人對此策略之意見分享

比較表



交易軟體比較



BRAY



籌碼K



XQ



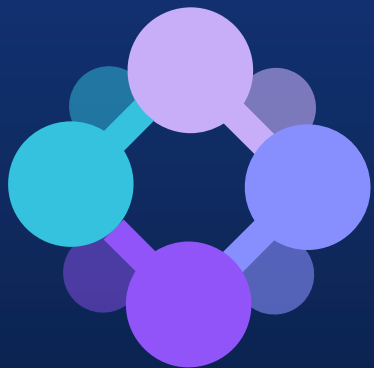
MC

開源程式語言	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
內建資料庫	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
多元類型商品	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>
策略回測系統	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>
訂閱他人策略	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>



策略開發者 誘因

- 優質資料庫與回測系統
- 透過策略及指標
賺取訂閱費用
- 提供更自由化之程式語言
(Python)編寫策略及指標



一般使用者 誘因

- 訂閱優質交易策略及市場指標
- 檢視訂閱之交易策略回測表現
- 可使用簡易策略編寫及回測系統
- 多元類型資料庫

THANKS



聯絡方式

信箱：r08723067@ntu.edu.tw

Github：<https://github.com/bray010040>

電話：0900-493763

CREDITS: This presentation template was created by **Slidesgo**, including icons by **Flaticon**, infographics & images by **Freepik**