

Python

小資族選股策略



FinLab

股票心裡學

量化投資策略心法

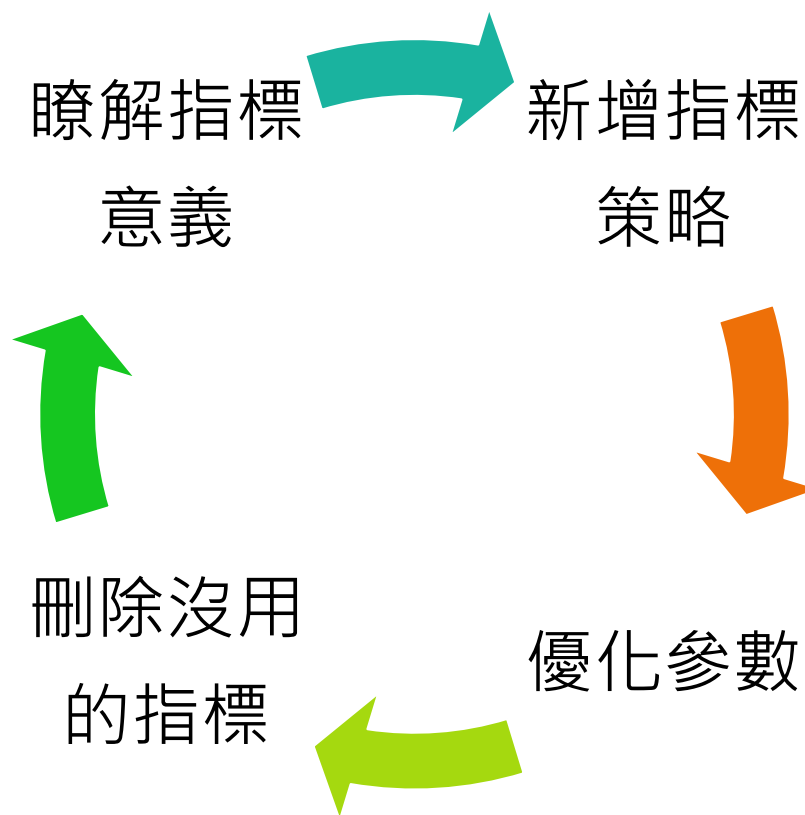
目錄

- 製作策略
 - 如何尋找好策略
 - 碰到的障礙
 - 如何克服
- 使用策略
 - 如何使用策略
 - 碰到的障礙
 - 如何克服



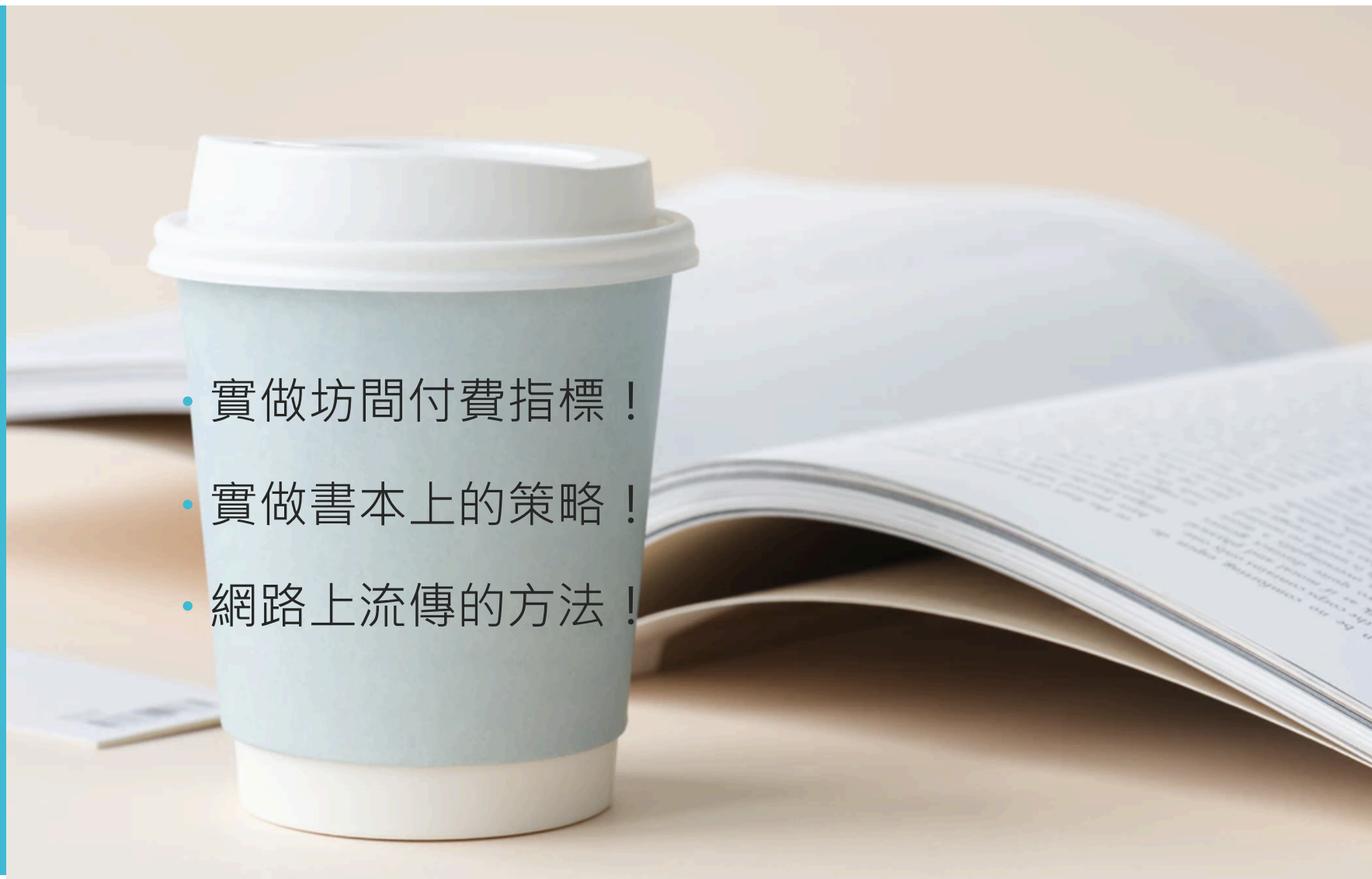
製作策略

- 好策略：條件不用多（甚至3~4個就可以了），要搭配得當！
- 步驟：



小密技

- 實做坊間付費指標！
- 實做書本上的策略！
- 網路上流傳的方法！



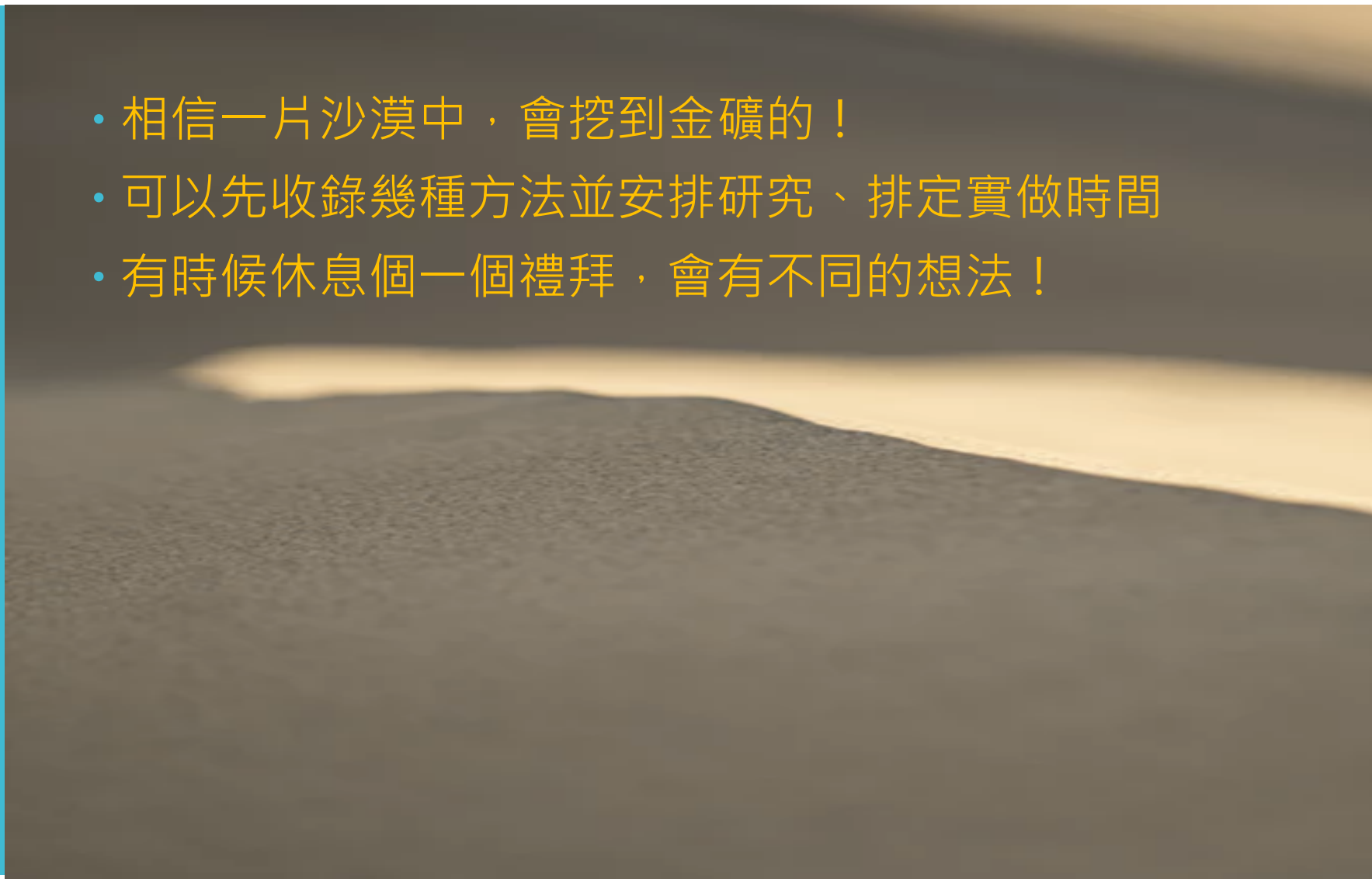
最大的障礙

- 找不到好策略，策略怎麼怎麼爛！
- 覺得沮喪



如何克服障礙

- 相信一片沙漠中，會挖到金礦的！
- 可以先收錄幾種方法並安排研究、排定實做時間
- 有時候休息個一個禮拜，會有不同的想法！



使用策略

按表操課！



遇到的問題 策略沒有驗證

- 策略只能驗證、再驗證
- 利用模擬股市、股市大富翁
 - 驗證自己的策略是有用的
 - 瞭解買賣的標準程序
 - 感受漲跌對心裡的影響
- 感受歷史最大回撤 x 實際投資金額，並確認自己可以承受！
- 預留資金，以防金融海嘯！

遇到的問題

策略輸大盤

策略虧損

因為虧損而經常更動策略，反而更不好！

- 策略輸大盤：沒關係！沒有虧損就好了
- 策略虧損：沒關係！贏過大盤就好了
- 策略虧損、又輸大盤：用歷史回測，檢查這情況是不是很常發生
(理論上來說，滿正常的)

遇到的問題 嚴重虧損

量化投資比較曖昧的地方！

- 主觀判斷：是否繼續使用
- 避免方法：確認策略長期（10年左右）有效！
- 擁有額外資金，可以再投入！

遇到的問題 嚴重虧損

為何海嘯虧損嚴重，但還是要投資股票？

- 海嘯可能會虧損40%的總資產，約5~10年來一次，我們假如可以保持7%的報酬率就好了，還是能夠獲利！

策略：預留資金，並在海嘯後投入！

- 預留0%資金：10年報酬率 +10%
- 預留30%資金：10年報酬率 +32%

總結

- 實做策略：
 - 持之以恆，制訂計畫，偶爾休息、吸收新知取得心靈感
- 實戰策略：
 - 上線前：嚴格審慎檢視策略、模擬上線獲利
 - 上線就相信它，直到虧損過大（約30%），再決定是否換策略！
 - 多個策略並行，分散風險
- 金融海嘯：
 - 嚴格檢驗策略
 - 預留資金（越高越好），以便景氣好轉時，有充裕的資金投資捕血

謝謝大家的收看
我們下個單元見！