

## 附錄 F、 經篩選驗證集商品比較分析

附錄 F、	經篩選驗證集商品比較分析 .....	1
6.1	實驗 A：定錨分析 .....	2
6.1.1	90 — 10%.....	2
6.1.2	80 — 20%.....	5
6.1.3	70 — 30%.....	8
6.1.4	60 — 40%.....	11
6.2	實驗 B：非定錨分析.....	14
6.2.1	90 — 10%.....	14
6.2.2	80 — 20%.....	17
6.2.3	70 — 30%.....	20
6.2.4	60 — 40%.....	23

## 6.1 實驗 A：定錨分析

### 6.1.1 90 — 10%

#### 6.1.1.1 實驗 A-01

附表 F-1、實驗 A-01 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	CC	135	CC	135	SF	128	CC	92	CC	92	CC	86
2	SF	132	SF	133	CC	119	SF	72	SF	73	SF	72
3	RB	79	RB	80	CD	76	RB	59	RB	60	RB	56
4	CD	77	CD	78	RR	72	RR	44	RR	44	RR	44
5	RR	75	RR	75	RB	72	KC	41	KC	41	KC	39
6	NQ	66	RTY	69	OJ	63	HO	35	HO	35	HO	33
7	OJ	64	NQ	67	NQ	57	BP	33	BP	33	CL	31
8	RTY	63	OJ	64	KC	57	CL	32	CL	32	BP	31
9	HO	61	HO	61	RTY	57	CD	29	CD	30	CD	30
10	KC	58	KC	59	HO	55	PL	26	RTY	29	RTY	26
11	CL	55	CL	55	CL	51	NQ	26	NQ	27	W	25
12	LC	52	LC	52	W	50	RTY	26	MP1	27	PL	25
13	BP	52	BP	52	LC	49	MP1	26	PL	26	MP1	24
14	W	50	W	50	BP	49	W	25	W	25	NQ	23
15	O	50	O	50	O	45	OJ	24	OJ	24	OJ	22

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	JXI	25	JXI	28	JXI	25	EWT	16	JXI	17	EWT	16
2	EEM	22	IBB	22	IBB	22	JXI	14	EWT	16	JXI	15
3	IBB	22	AFK	22	\$XOI	21	UNG	14	UNG	14	UNG	13
4	AFK	22	EEM	22	EEM	21	HYG	13	CT	14	CT	13
5	LH	21	LH	21	LH	20	CT	13	HYG	13	HYG	13
6	\$OSX	21	\$OSX	21	DBA	20	\$MNG	12	AFK	12	\$MNG	12
7	\$XNG	21	LC	21	IXC	20	\$OSX	12	LC	12	LC	11
8	\$XOI	21	\$XNG	21	AFK	20	AFK	12	\$OSX	12	\$MXY	11
9	DBA	21	\$XOI	21	LC	19			\$MNG	12	\$XDS	11
10	LC	20	DBA	21	OJ	19					AFK	11
11	IXC	20	\$ADR	20	\$ADR	19					DBA	11
12	\$ADR	20	UNG	20	\$XNG	19					EWJ	11
13	EWJ	20	OJ	20	\$OSX	19					IBB	11
14	UNG	20	EWJ	20	NG	18					\$ADR	11
15			IXC	20	EWJ	18					SM	11
16					HYG	18						
17					UNG	18						
18					\$MXY	18						
19					DBB	18						

### 6.1.1.2 實驗 A-02

附表 F-2、實驗 A-02 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	CC	119	CC	120	CC	108	CC	83	CC	84	CC	79
2	SF	80	SF	80	SF	76	SF	45	SF	45	SF	43
3	RB	53	RB	53	RB	48	RB	42	RB	42	RB	39
4	HO	35	RTY	37	CD	35	BP	22	BP	22	BP	22
5	LC	34	LC	36	LC	33	HO	21	HO	21	HO	19
6	CD	34	HO	35	HO	32	CD	16	PL	16	CD	16
7	BP	33	CD	35	RTY	32	PL	16	CD	16	PL	15
8	RTY	32	BP	33	BP	31	LC	13	LC	15	LC	14
9	PL	22	PL	22	PL	21	CL	10	CL	10	CL	10
10	CL	20	CL	20	C	19	W	10	W	10	W	10
11	C	19	C	19	CL	19	TY	8	RTY	9	RTY	8
12	ES	18	ES	16	ES	17	NG	8	NG	8	NG	8
13	BO	16	BO	16	BO	16	RTY	7	TY	8	TY	8
14	NG	15	NG	15	W	13	SB	7	OJ	7	OJ	7
15	W	13	W	13	NG	13	OJ	7	SB	7	SB	7
16	TY	13	TY	13			ED	7	ED	7	ED	7
17									US	7	US	7
18									FV	7	FV	7

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	\$XOI	13	EWZ	12	\$XOI	13	EWT	10	EWT	10	EWT	9
2	EWZ	12	\$XOI	12	CT	11	HYG	9	HYG	9	HYG	9
3	SM	11	EWT	11	EEM	11	CT	8	CT	9	CT	8
4	EEM	11	EEM	11	HYG	11	HG	7	EEM	7	SM	7
5	HYG	11	HYG	11	C	10	SM	7	SM	7	\$XNG	7
6	EWT	11	SM	11	EWJ	10	\$XNG	7	HG	7	EEM	7
7	CT	10	CT	11	SM	10	EEM	7	\$XNG	7	HG	7
8	BO	10	\$XNG	10	\$DDX	10	EWZ	6	BO	6	BO	6
9	\$XNG	10	\$DDX	10	\$OSX	9	DBA	6	DBA	6	EWJ	6
10	S	10	EWJ	10	EWT	9	EWJ	6	EWJ	6	MXI	6
11	\$DDX	9	C	10	\$MXY	9	\$CZH	6	\$DDX	6	\$XOI	6
12	\$MXY	9	BO	10	\$XNG	9	C	6	MXI	6	C	6
13	IEF	9	S	10	IEF	9	MXI	6	\$CZH	6	\$DDX	6
14	\$CZH	9			HG	9	\$XOI	6	EWZ	6	\$CZH	6
15	GLD	9			S	9			C	6	DBA	6
16	EWJ	9			BO	9			\$XOI	6		
17	\$OSX	9			EWZ	9			JXI	6		
18	EZU	9										
19	C	9										

### 6.1.1.3 實驗 A-03

附表 F-3、實驗 A-03 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	CC	33	CC	33	CC	32	CC	25	CC	25	CC	25
2	BP	16	BP	16	BP	15	BP	11	BP	11	BP	9
3	SF	11	SF	11	SF	10	PL	6	PL	6	PL	6
4	PL	8	PL	8	PL	8	SF	5	SF	5	SF	4
5	HO	5	HO	5	HO	5	RB	2	RB	2	RB	2
6	NG	3	NG	3	NG	3	NG	2	NG	2	NG	2
7	RTY	2	RB	2	RTY	2	HO	1	HO	1	HO	1
8	RB	2	C	2	RB	2	ES	1	C	1	ES	1
9	C	2	BO	2	C	2	C	1			C	1
10	BO	2	RTY	1	BO	2						
11	LC	1	LC	1	LC	1						
12	ES	1	ED	1	ES	1						
13	ED	1	CL	1	ED	1						
14	CL	1			CL	1						

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	IXC	4	IXC	4	IXC	4	BO	3	BO	3	BO	3
2	BO	3	BO	3	BO	3	IXC	3	IXC	3	IXC	3
3	EWZ	3	\$OSX	3	EWZ	3	CT	2	CT	2	EC	2
4	\$OSX	3	\$XNG	3	\$OSX	3	SM	2	SM	2	HG	2
5	\$XNG	3					DBA	2	DBA	2	\$MXY	2
6							SB	2	SB	2	SB	2
7							\$MXY	2	\$MXY	2	RTY	2
8							RTY	2	RTY	2	\$OSX	2
9							EC	2	EC	2	EWU	2
10							\$OSX	2	\$OSX	2	CT	2
11							EWU	2	EWU	2		
12							HG	2	HG	2		

### 6.1.1.4 實驗 A-04

附表 F-4、實驗 A-04 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	BP	1	BP	1	BP	1						

  

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	DX	1	DX	1	DX	1						

## 6.1.2 80 — 20%

### 6.1.2.1 實驗 A-05

附表 F-5、實驗 A-05 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	CC	135	CC	135	CC	115	CC	93	CC	93	CC	84
2	SF	108	SF	110	SF	101	SF	60	SF	62	SF	56
3	RB	72	RB	73	CD	64	RB	56	RB	58	RB	49
4	CD	71	CD	71	RB	63	KC	35	KC	36	KC	35
5	OJ	57	RTY	58	KC	53	HO	32	HO	33	HO	30
6	RTY	55	OJ	58	OJ	53	CL	31	CL	31	CL	27
7	HO	55	HO	56	RTY	51	BP	26	BP	28	RTY	26
8	KC	53	KC	54	CL	49	RTY	25	RTY	27	BP	26
9	CL	52	CL	52	HO	49	CD	25	CD	25	PL	24
10	BP	44	BP	47	BP	41	PL	24	PL	24	CD	22
11	O	43	O	43	PL	40	MP1	23	MP1	23	MP1	20
12	PL	40	MP1	41	W	36	OJ	20	OJ	20	OJ	17
13	MP1	40	PL	40	MP1	35	W	18	W	18	W	16
14	W	39	NQ	40	TY	35	O	17	O	17	O	15
15	NQ	39	W	39	O	35	US	15	NQ	16	TY	15
16							NQ	15				

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	JXI	22	JXI	23	JXI	20	EWT	16	EWT	16	EWT	14
2	DBA	20	LC	20	DBA	19	HYG	14	CT	14	HYG	14
3	\$ADR	19	DBA	20	CT	18	CT	13	HYG	14	CT	14
4	EWJ	19	\$ADR	19	\$ADR	17	JXI	13	JXI	13	\$ADR	12
5	\$OSX	18	CT	19	\$XOI	17	SM	12	SM	12	JXI	11
6	\$XOI	18	EWJ	19	HG	17	\$ADR	12	\$ADR	12	UNG	11
7	CT	18	\$XOI	18	OJ	16	DBA	11	DBA	11	DBA	11
8	HYG	18	SM	18	LC	16	HG	10	UNG	10	SM	11
9	SM	18	HYG	18	IBB	16	\$OSX	10	\$MXY	10	LC	10
10	LC	18	\$OSX	18	HYG	16	EWJ	10	CC	10	EWJ	10
11	LH	18	LH	18	EWJ	16	\$MXY	10	EWJ	10	HG	10
12	OJ	17	\$XNG	17	LH	16	AFK	10	HG	10	CC	10
13	\$XNG	17	OJ	17	\$MXY	16	CC	10	LC	10	\$MNG	9
14	HG	17	HG	17	DBB	15	IXJ	9	\$OSX	10	\$MXY	9
15	IEF	17	IEF	17	NG	15	EWU	9	AFK	10	AFK	9
16	NG	17	\$MXY	17	SM	15	LC	9			EWU	9
17	EWT	17	NG	17	S	15	\$XOI	9			KW	9
18			EWT	17	UNG	15	\$MNG	9				
19					IEF	15	LH	9				
20					\$OSX	15	OJ	9				

### 6.1.2.2 實驗 A-06

附表 F-6、實驗 A-06 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	CC	111	CC	111	CC	95	CC	80	CC	80	CC	73
2	RB	45	SF	44	SF	43	RB	38	RB	37	RB	32
3	SF	44	RB	42	RB	40	SF	22	SF	23	SF	20
4	HO	29	HO	30	HO	28	HO	20	HO	21	HO	20
5	BP	29	BP	29	BP	26	BP	18	BP	19	BP	18
6	RTY	27	RTY	28	RTY	25	CD	13	CL	13	CL	13
7	CD	26	CD	25	CD	24	CL	13	PL	13	PL	13
8	PL	19	PL	19	PL	19	PL	13	CD	12	CD	10
9	CL	19	CL	18	CL	19	RTY	8	RTY	9	RTY	9
10	ES	17	BO	14	ES	16	NG	7	MP1	7	NG	7
11	C	14	C	14	BO	14	W	6	NG	7	W	6
12	BO	13	ES	14	C	14	MP1	6	W	6	MP1	6
13	NG	13	NG	13	NG	13	TY	6	TY	6	TY	6
14	TY	11	TY	11	TY	11	ED	5	FV	5	FV	5
15	ED	9	ED	9	ED	9	OJ	4	ED	5	ED	5
16	W	9	W	9			FV	4				
17	SB	9	SB	9			SB	4				
18							C	4				
19							BO	4				

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	EWZ	10	\$XNG	10	HYG	10	HYG	9	HYG	9	HYG	9
2	\$XNG	10	HYG	10	\$XNG	10	EWT	8	EWT	8	CT	8
3	HYG	10	CT	10	CT	9	CT	8	CT	8	HG	7
4	CT	10	SM	10	EWZ	9	HG	7	HG	7	EWT	7
5	SM	10	EWZ	9	EEM	9	SM	7	SM	7	EEM	6
6	EEM	9	EEM	9	SM	9	EEM	7	EEM	7	SM	6
7	\$XOI	9	\$XOI	9	\$XOI	9	DBA	6	\$MXY	6	DBA	6
8	S	9	S	9	S	9	\$MXY	6	DBA	6	IXC	5
9	EWG	8	\$MXY	9	\$DDX	8	S	5	IXC	5	\$MXY	5
10	EWT	8	EWG	8	HG	8	IXC	5	\$XNG	5	\$XNG	5
11	\$OSX	8	\$OSX	8	\$MXY	8	\$XNG	5	S	5	S	5
12	\$MXY	8	HG	8	EWG	8						
13	HG	8	\$DDX	8	IXC	7						
14	\$DDX	8	EWT	8	GLD	7						
15	EWJ	8			DBA	7						
16					IEF	7						
17					\$CZH	7						
18					SB	7						
19					\$OSX	7						

### 6.1.2.3 實驗 A-07

附表 F-7、實驗 A-07 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	CC	17	CC	17	CC	17	CC	13	CC	13	CC	12
2	BP	12	BP	12	BP	12	BP	9	BP	9	BP	8
3	PL	5	PL	6	PL	6	PL	4	PL	4	PL	4
4	SF	3	SF	3	SF	3	RB	2	RB	2	RB	2
5	HO	3	HO	3	HO	3	NG	2	NG	2	NG	2
6	RB	2	RB	2	RB	2						
7	NG	2	NG	2	NG	2						
8	BO	2	BO	2	ED	1						
9	ED	1	ED	1	BO	1						

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	IXC	3	IXC	3	IXC	3	EWU	2	EWU	2	IXC	2
2	EWU	2	EWU	2	EWU	2	IXC	2	IXC	2	BO	2
3	\$DDX	2	\$DDX	2	\$DDX	2	BO	2	BO	2	EC	2
4	\$HUI	2	\$HUI	2	\$HUI	2	EC	2	EC	2		
5	\$OSX	2	\$OSX	2	\$XAU	2						
6	\$XAU	2	\$XAU	2	\$XNG	2						
7	\$XNG	2	\$XNG	2	\$XOI	2						
8	\$XOI	2	\$XOI	2	BO	2						
9	EC	2	BO	2	EC	2						
10	\$CZH	2	EC	2	\$CZH	2						
11	RB	2	\$CZH	2	RB	2						
12	O	2	RB	2								
13			O	2								

### 6.1.2.4 實驗 A-08

本實驗中經篩選後之驗證集，無任何商品配對組合通過篩選之條件。

### 6.1.3 70 — 30%

#### 6.1.3.1 實驗 A-09

附表 F-8、實驗 A-09 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	CC	134	CC	134	CC	101	CC	90	CC	90	CC	74
2	CD	76	CD	76	CD	67	RB	54	RB	55	RB	45
3	RB	70	RB	70	RB	61	CL	34	HO	34	HO	31
4	CL	53	HO	56	CL	49	HO	32	CL	34	KC	28
5	HO	51	CL	55	HO	48	KC	28	KC	28	CL	27
6	RTY	50	RTY	53	SF	43	BP	27	BP	27	CD	24
7	OJ	49	OJ	48	RTY	42	CD	27	CD	27	BP	23
8	SF	45	SF	44	KC	41	MP1	22	RTY	24	MP1	22
9	BP	41	BP	43	BP	40	RTY	22	MP1	23	PL	22
10	KC	40	KC	42	PL	35	PL	22	PL	22	RTY	19
11	MP1	39	MP1	40	OJ	35	OJ	19	OJ	19	SF	17
12	PL	37	PL	37	MP1	33	SF	16	SF	18	OJ	16
13	ES	34	ES	34	BO	29	NQ	12	CT	12	ED	12
14	C	29	C	29	ES	28	ED	12	ED	12	CT	11
15	BO	28	BO	29	C	27	CT	11	ES	10	FV	9
16	JY	28									NQ	9
17											NG	9

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	HYG	18	LC	18	DBA	15	EWT	13	EWT	14	EWT	11
2	IXN	17	DBA	17	IBB	15	HYG	13	HYG	13	HYG	11
3	JXI	17	JXI	17	SM	15	JXI	13	JXI	13	JXI	11
4	LC	17	IXN	17	JXI	15	\$MXY	11	\$MXY	11	SM	10
5	LH	17	HYG	17	\$XNG	14	SM	10	CT	10	OJ	9
6	EWT	16	EWT	16	CT	14	DBA	10	DBA	10	\$MXY	9
7	DBA	16	EWJ	16	EWJ	14	EWJ	9	SM	10	CT	9
8	EWJ	16	LH	16	HYG	14	IBB	9	OJ	9	DBA	9
9	\$XNG	15	CT	16	IXN	14	OJ	9	EWJ	9	EWJ	8
10	IBB	15	SM	15	LC	14	\$ADR	9	IBB	9	IBB	8
11	SM	15	IBB	15	EWT	13	LC	8	LC	9	LC	8
12	OJ	14	\$XNG	15	OJ	13	LH	8	\$ADR	9	\$ADR	8
13	CT	14	\$MXY	15	HG	13	\$XOI	8	RSX	8		
14	EXI	14	OJ	14	LH	13	UNG	8	UNG	8		
15	IEF	14	\$XOI	14	NG	13	CT	8	\$XOI	8		
16	\$ADR	14	IEF	14	\$ADR	13	CC	8	\$OSX	8		
17							RSX	8				
18							\$OSX	8				



### 6.1.3.2 實驗 A-10

附表 F-9、實驗 A-10 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	CC	101	CC	101	CC	80	CC	71	CC	71	CC	61
2	CD	29	HO	30	CD	28	RB	19	HO	21	HO	20
3	RB	28	CD	28	HO	27	BP	18	RB	18	RB	16
4	BP	24	RB	27	RB	25	HO	17	BP	17	BP	15
5	HO	23	BP	25	BP	22	CD	14	CD	12	CD	13
6	RTY	19	RTY	17	RTY	16	PL	12	PL	12	PL	11
7	PL	17	SF	16	PL	16	CL	8	CL	8	NG	7
8	SF	16	PL	16	SF	15	NG	7	NG	7	MP1	6
9	CL	14	CL	14	BO	14	ED	5	MP1	6	CL	6
10	BO	13	BO	14	NG	13	BO	5	ED	5	ED	5
11	NG	13	NG	13	CL	11	MP1	5	BO	5	BO	5
12	C	11	C	11	C	10	SF	5	RTY	4	SF	5
13	ES	9	ES	9	ED	9	RTY	4	SB	4	SB	4
14	ED	9	ED	9	SB	7	SB	4	SF	3	RTY	3
15	SB	8	SB	8	MP1	6	C	3	C	3	C	3
16					ES	6						

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	EWZ	9	EWZ	10	\$XNG	9	SM	6	SM	6	SM	6
2	\$XNG	9	\$XNG	9	EWZ	7	OJ	5	HYG	5	\$XNG	5
3	\$OSX	8	\$MXY	8	EZU	7	HG	5	\$MXY	5	HG	5
4	S	8	\$OSX	8	CT	7	HYG	5	HG	5	OJ	5
5	EZU	7	CT	8	HG	7	\$MXY	5	\$XNG	5	\$MXY	5
6	GLD	7	S	8	\$MXY	7	\$XNG	5	OJ	5	\$ADR	4
7	HG	7	SB	7	S	7	\$ADR	4	CT	5	SB	4
8	BO	7	HG	7	SM	7	GLD	4	EWZ	4	HYG	4
9	SM	7	GLD	7	EWG	6	IXC	4	SB	4	IXC	4
10	\$XOI	7	EZU	7	IXC	6	DBA	4	JXI	4	DBA	4
11	SB	6	SM	7	BO	6	CT	4	IXC	4	S	4
12	OJ	6	\$XOI	7	SB	6	JXI	4	GLD	4	GLD	4
13	CT	6	EWG	6	\$XOI	6	BO	4	DBA	4	CT	4
14	NQ	6	BO	6	\$XCI	6	EWZ	4	\$OSX	4	\$CZH	4
15	EWG	6	IXC	6	GLD	6	\$OSX	4	\$DDX	4	\$DDX	4
16	\$XCI	6	\$CZH	6	\$CZH	6	\$CZH	4	\$CZH	4		
17	\$MXY	6	\$DDX	6			S	4				
18	\$CZH	6										

### 6.1.3.3 實驗 A-11

附表 F-10、實驗 A-11 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	BP	11	BP	11	BP	11	BP	8	BP	8	BP	7
2	CC	7	CC	7	CC	6	CC	5	CC	5	CC	5
3	PL	5	PL	5	PL	5	PL	3	PL	3	PL	3
4	BO	2	BO	2	NG	1	NG	1	NG	1	NG	1
5	NG	1	NG	1	HO	1						
6	HO	1	HO	1	ED	1						
7	ED	1	ED	1	BO	1						

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	\$OSX	2	\$OSX	2	IXC	2	IXC	2	IXC	2	IXC	2
2	IXC	2	IXC	2	\$XOI	2	TIP	1	TIP	1	TIP	1
3	\$XOI	2	\$XOI	2			SM	1	SM	1	SM	1
4							S	1	S	1	S	1
5							IXG	1	IXG	1	IXG	1
6							HG	1	HG	1	HG	1
7							EWU	1	EWU	1	EWU	1
8							EEM	1	EEM	1	EEM	1
9							EC	1	EC	1	EC	1
10							\$XTC	1	\$XTC	1	\$XTC	1
11							\$XOI	1	\$XOI	1	\$XOI	1
12							\$XNG	1	\$XNG	1	\$XNG	1
13							\$XAU	1	\$XAU	1	\$XAU	1
14							\$OSX	1	\$OSX	1	\$MXY	1
15							\$MXY	1	\$MXY	1	\$CZH	1
16							\$CZH	1	\$CZH	1		

### 6.1.3.4 實驗 A-12

本實驗中經篩選後之驗證集，無任何商品配對組合通過篩選之條件。

## 6.1.4 60 — 40%

### 6.1.4.1 實驗 A-13

附表 F-11、實驗 A-13 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	CC	134	CC	134	CC	99	CC	90	CC	90	CC	69
2	CD	71	CD	73	CD	62	RB	50	RB	50	RB	40
3	RB	64	RB	66	RB	55	CL	33	CL	35	CL	29
4	HO	53	HO	54	CL	48	HO	32	HO	32	HO	25
5	CL	50	CL	54	HO	44	CD	29	CD	30	BP	25
6	RTY	46	RTY	50	RTY	42	BP	27	BP	26	CD	23
7	BP	45	BP	45	BP	40	PL	21	MP1	22	MP1	20
8	MP1	39	MP1	41	MP1	34	MP1	21	PL	20	PL	18
9	PL	36	PL	36	PL	32	RTY	18	RTY	19	RTY	17
10	OJ	36	OJ	35	OJ	32	KC	16	KC	18	OJ	13
11	SF	34	SF	32	SF	32	SF	14	OJ	14	SF	13
12	C	31	C	31	BO	30	OJ	14	ED	12	KC	13
13	ES	31	BO	31	C	28	ED	12	SF	12	ED	12
14	BO	30	ES	31	JY	24	CT	10	CT	10	JY	10
15	JY	24	JY	27	ED	22	C	9	JY	10	CT	9
16					DX	22	JY	9				

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	JXI	16	JXI	17	IBB	15	JXI	12	JXI	12	HYG	10
2	LC	15	LC	16	\$ADR	14	HYG	11	EWT	11	EWT	9
3	\$OSX	15	EWT	15	LC	14	CT	10	HYG	11	JXI	9
4	\$XNG	15	\$MXY	15	\$XNG	14	EWT	10	EWJ	9	CT	9
5	IBB	15	\$OSX	15	JXI	14	DBA	9	\$MXY	9	EWJ	9
6	EWT	14	\$XNG	15	DBA	14	EWJ	8	CT	9	DBA	8
7	CT	14	DBA	15	LH	13	\$MXY	8	SM	9	\$ADR	8
8	DBA	14	EWJ	15	EWJ	13	\$OSX	8	\$OSX	8	LC	7
9	EWJ	14	IBB	15	OJ	13	EWU	8	DBA	8	SM	7
10	HG	14	OJ	14	HG	13	HG	8	EWU	8	IBB	7
11	HYG	14	\$XOI	14	HYG	12	IBB	8	HG	8	SB	7
12	\$ADR	14	HG	14	EXI	12	\$ADR	8	IBB	8	\$MXY	7
13	SM	14	HYG	14	SM	12	SM	8	\$ADR	8	\$XNG	7
14	LH	13	\$ADR	14	CT	12	CC	7			HG	7
15	OJ	13	SM	14	\$MXY	11	BO	7			CC	7
16	EXI	13			\$CZH	11	\$XNG	7			OJ	7
17	S	13			NG	11	OJ	7				
18	IXN	13			EWT	11	KW	7				
19					S	11	LC	7				
20					SB	11						

### 6.1.4.2 實驗 A-14

附表 F-12、實驗 A-14 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	CC	86	CC	87	CC	68	CC	63	CC	64	CC	51
2	HO	31	HO	29	HO	31	RB	25	RB	24	RB	21
3	RB	29	RB	27	RB	25	HO	21	HO	21	HO	18
4	BP	24	BP	24	BP	22	BP	18	BP	18	BP	16
5	CD	22	CD	22	CD	20	CL	11	CL	12	CD	10
6	CL	16	CL	17	CL	14	CD	11	CD	11	CL	9
7	PL	14	PL	15	PL	14	PL	9	PL	9	PL	8
8	RTY	13	NG	12	NG	12	NG	6	NG	6	NG	6
9	NG	13	BO	12	BO	12	ED	5	ED	5	ED	5
10	ES	12	ES	11	RTY	11	BO	4	MP1	5	MP1	5
11	SF	12	SF	10	SF	10	C	3	BO	4	BO	4
12	BO	11	C	10	C	10	SB	3	C	3	C	3
13	C	11	ED	9	ED	9	RTY	3	ES	2	SF	3
14	ED	9	RTY	7	ES	6	MP1	3	TY	2	ES	2
15	SB	5	MP1	5	MP1	5	SF	3	RTY	2	TY	2
16									SB	2		
17									SF	2		

  

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	EWZ	9	\$MXY	8	\$XNG	7	\$ADR	5	HG	5	\$ADR	5
2	\$OSX	7	\$XOI	8	\$MXY	7	\$MXY	5	\$XNG	5	HG	5
3	\$XNG	7	EWZ	8	S	7	HG	5	HYG	5	\$XNG	5
4	EZU	6	\$OSX	7	EWG	6	SM	4	\$MXY	5	DBA	4
5	EWG	6	\$XNG	7	EWZ	6	IXC	4	IXC	4	\$DDX	4
6	IXC	6	IXC	6	\$OSX	6	EWT	4	EWT	4	IXC	4
7	HG	6	\$DDX	6	IXC	6	EEM	4	EEM	4	EWT	4
8	S	6	HG	6	\$ADR	5	DBA	4	DBA	4	EEM	4
9	NQ	6	EWJ	5	\$DDX	5	\$XNG	4	OJ	4	\$CZH	4
10	\$XOI	6	NQ	5	EEM	5	OJ	4	\$XOI	4	\$MXY	4
11	\$DDX	6	S	5	EZU	5	HYG	4	\$ADR	4	\$XOI	3
12	OJ	5	IXN	5	OJ	5	\$CZH	4	\$CZH	4	ES	3
13	EWJ	5	EEM	5	HG	5	\$OSX	4	\$DDX	4	OJ	3
14	\$XCI	5	BO	5	\$CZH	5			\$OSX	4	EWG	3
15	GLD	5									\$OSX	3
16	\$MXY	5									HYG	3
17	\$CZH	5									SB	3
18	IXN	5									SM	3
19	BO	5										
20	\$ADR	5										

### 6.1.4.3 實驗 A-15

附表 F-13、實驗 A-15 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	BP	9	BP	9	BP	8	BP	7	BP	7	BP	7
2	CC	5	CC	5	CC	5	PL	3	PL	3	PL	3
3	PL	4	PL	4	PL	4	CC	3	CC	3	CC	3
4	NG	2	NG	2	NG	2	NG	1	NG	1	NG	1
5	BO	2	BO	2	BO	2						
6	HO	1	HO	1	HO	1						
7	ED	1	ED	1	ED	1						

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	IXC	2	IXC	2	IXC	2	IXC	2	IXC	2	IXC	2
2	\$OSX	2	\$OSX	2	\$OSX	2	S	1	S	1	S	1
3	\$XOI	2	\$XOI	2			FV	1	FV	1	FV	1
4							EWU	1	EWU	1	EWU	1
5							EEM	1	EEM	1	EEM	1
6							EC	1	EC	1	EC	1
7							BO	1	BO	1	BO	1
8							\$XTC	1	\$XTC	1	\$XTC	1
9							\$XOI	1	\$XOI	1	\$XOI	1
10							\$XAU	1	\$XAU	1	\$XAU	1
11							\$OSX	1	\$OSX	1	\$OSX	1
12							\$MXY	1	\$MXY	1	\$MXY	1
13							\$CZH	1	\$CZH	1	\$CZH	1

### 6.1.4.4 實驗 A-16

本實驗中經篩選後之驗證集，無任何商品配對組合通過篩選之條件。

## 6.2 實驗 B：非定錨分析

### 6.2.1 90 — 10%

#### 6.2.1.1 實驗 B-01

附表 F-14、實驗 B-01 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	CC	55	CC	65	NQ	47	RB	37	CC	40	CC	31
2	RR	52	RR	54	CC	47	CC	35	RB	35	RB	30
3	RB	49	RB	49	RR	43	RR	26	RR	28	RR	24
4	NQ	45	HO	39	RB	41	HO	23	HO	22	HO	18
5	HO	43	LC	38	LC	37	CL	21	CL	21	CL	16
6	LC	42	O	34	HO	34	S	12	O	17	NQ	12
7	CL	32	CL	33	CD	31	NQ	12	MP1	13	S	12
8	W	28	W	32	RTY	28	LC	11	LC	10	O	11
9	CD	26	RTY	30	W	26	O	11	CT	10	SF	10
10	O	26	SF	29	SF	26	CT	9	S	10	MP1	10
11	SF	24	CD	29	CL	26	SF	9	KC	9	LC	9
12	TY	24	MP1	26	TY	25	KC	9	AD	8	AD	8
13	S	22	KC	24	S	22	MP1	8	SF	7	CT	8
14	KC	22	S	22	O	22	YM	8	HG	7	KC	8
15	RTY	20	TY	22	MP1	22	AD	8	TY	7	CD	7
16	FV	20			KC	22	TY	8			YM	7

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	EUFN	14	EXI	14	\$XDE	14	\$XDE	8	\$OSX	7	\$XDE	8
2	EXI	13	EC	13	LH	13	EXI	6	EMD	6	\$OSX	7
3	\$XDE	13	LH	13	EUFN	12	\$OSX	6	EXI	6	BO	6
4	EC	12	JXI	11	SM	12	\$SOX	6	\$SOX	6	JXI	6
5	UUP	11	UUP	11	EC	12	EMD	6	RXI	6	LH	6
6	LH	11	HYG	11	EWJ	11	BO	5	\$XDE	6	PL	5
7	\$OSX	11	\$XDE	11	IBB	11	ASEA	5	ASEA	5	FV	5
8	ASEA	10	EWU	11	HYG	11	LH	5	\$XNG	5	EXI	5
9	EWU	10	SOXX	11	SB	10	RXI	5	RSX	5	EWT	5
10	JXI	10	EWJ	10	EWZ	10	\$XDB	5	JXI	5	IXN	5
11	AFK	10	IXC	10	JXI	10	EC	5	FV	5	EUFN	5
12	HO	10	RXI	10	IXC	10	SM	5	DBA	5	EMD	5
13	HYG	10	SB	10			\$XDN	5	AD	5	DX	5
14	SM	10	EWT	10			DBA	5	EWT	5	DBA	5
15	SOXX	10	ASEA	10			\$MXY	5	SM	5	HYG	5
16	\$SOX	10	\$XNG	10			IXN	5	HYG	5	\$SOX	5
17	UNG	10	\$OSX	10			EWU	5	EWU	5	SM	5
18	US	10	EUFN	10			RSX	5	\$MNG	5		
19	\$MXY	10							\$DDX	5		
20	\$HGX	10										

### 6.2.1.2 實驗 B-02

附表 F-15、實驗 B-02 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	CC	54	CC	52	CC	42	CC	33	CC	33	CC	26
2	RB	39	RB	33	RB	32	RB	31	RB	28	RB	25
3	LC	28	LC	20	LC	26	HO	15	HO	10	HO	13
4	HO	26	HO	20	HO	19	LC	8	SF	10	SF	9
5	RTY	14	RTY	17	RTY	18	SF	8	CL	9	LC	7
6	CL	13	SF	15	SF	14	CL	7	LC	6	CL	5
7	C	11	C	13	ES	12	NG	4	RR	5	PL	5
8	SF	11	CD	13	C	11	TY	4	FV	5	NG	4
9	CD	11	CL	13	CL	11	RR	4	TY	4	FV	4
10	W	9	ES	12	CD	10	PL	4	NG	4	RR	4
11	NG	9	NG	9	TY	9	C	3	C	3	CD	3
12	TY	8	W	9	PL	8	CD	3	RTY	3	C	3
13	RR	8	RR	8	W	7	CT	3	CD	3	RTY	3
14	PL	8	FV	8	NG	7	FV	3	CT	3	TY	3
15	US	7	US	7	BO	7	W	2	ES	2	MP1	2
16							MP1	2	W	2	ED	2
17							NQ	2	MP1	2	CT	2
18							RTY	2			BP	2
19							BP	2			ES	2

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	EWZ	8	EWT	9	EWZ	7	\$DDX	5	\$DDX	5	EXI	4
2	EWT	7	RTY	6	HYG	7	EXI	4	HYG	5	HYG	4
3	HYG	7	\$DDX	6	EWT	7	HYG	4	IXN	4	\$OSX	4
4	SM	6	CT	6	\$OSX	6	\$OSX	4	EXI	4	EWT	4
5	CT	6	EWZ	6	CT	6	IXN	4	\$OSX	4	IXN	4
6	RTY	6	SM	6	SM	6	EMD	4	\$ADR	3	\$ADR	3
7	\$DDX	6	HYG	6	PL	6	EWT	3	EWT	3	CT	3
8	\$MXY	6	IBB	6	EWJ	5	MXI	3	C	3	EMD	3
9	\$OSX	6	\$OSX	5	IBB	5	UUP	3	\$XNG	3	EFA	3
10	SOXX	5	\$XNG	5	SB	5	EWG	3	MXI	3	MXI	3
11	\$XOI	5	CC	5	RTY	5	EFA	3	\$MNG	3	DBA	3
12	SB	5	EXI	5	MXI	5	EC	3	UUP	3	PL	3
13	C	5	GLD	5	YM	5	DBA	3	RTY	3	BO	3
14	EXI	5	NQ	5			CT	3	EWG	3		
15	PL	5	PL	5			C	3	EMD	3		
16	EMD	5	YM	5			\$MXY	3	EFA	3		
17			SOXX	5			ACWI	3	CT	3		
18							RTY	3	IXG	3		
19							\$XCI	3				

### 6.2.1.3 實驗 B-03

附表 F-16、實驗 B-03 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	CC	18	CC	15	CC	12	CC	11	CC	11	CC	7
2	PL	4	PL	4	PL	3	PL	4	PL	3	PL	3
3	HO	4	HO	3	BP	3	RB	2	RB	2	RB	2
4	BP	3	BP	3	RB	2	NG	1	NG	2	NG	2
5	RB	2	RB	2	NG	2	HO	1	BP	1	HO	1
6	BO	2	NG	2	HO	2	BP	1			BP	1
7	SF	1	SF	1	BO	2						
8	RTY	1	LC	1	SF	1						
9	NG	1	ES	1	RTY	1						
10	LC	1	CL	1	LC	1						
11	ES	1	BO	1	ES	1						

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	EWZ	3	TIP	2	EWZ	3	TIP	2	TIP	2	BO	2
2	TIP	2	RTY	2	BO	2	RTY	2	RTY	2	TIP	1
3	RTY	2	PL	2	C	2	BO	1	BO	2	SM	1
4	\$OSX	2	\$XNG	2			\$MXY	1	SM	1	S	1
5	IXC	2	IXC	2			\$OSX	1	S	1	RTY	1
6	\$XTC	2	BO	2			\$XAL	1	IXG	1	FV	1
7	C	2					\$XOI	1	IXC	1	EWU	1
8							\$XTC	1	FV	1	DBA	1
9							AD	1	EWU	1	C	1
10							C	1	DBA	1	AD	1
11							SM	1	C	1	\$XOI	1
12							DBA	1	AD	1	\$XAL	1
13							EC	1	\$XTC	1	\$OSX	1
14							EWU	1	\$XAL	1	\$MXY	1
15							IXC	1	\$MXY	1	\$DDX	1
16							IXG	1	\$DDX	1		
17							S	1				
18							\$DDX	1				

### 6.2.1.4 實驗 B-04

附表 F-17、實驗 B-04 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	BP	1	BP	1	BP	1						

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	DX	1	DX	1	DX	1						



## 6.2.2 80 — 20%

### 6.2.2.1 實驗 B-05

附表 F-18、實驗 B-05 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	SF	81	SF	93	SF	77	SF	36	SF	46	SF	42
2	RB	52	RB	53	RB	48	RB	36	RB	38	RB	30
3	KC	39	CC	49	CC	41	CC	19	CC	24	CC	19
4	CC	37	KC	40	RTY	37	KC	14	CL	18	CL	18
5	NQ	35	RTY	40	BP	35	CL	14	BP	17	BP	16
6	BP	32	CD	38	CD	34	HO	14	KC	14	HO	14
7	RTY	32	BP	38	KC	31	BP	12	W	14	RTY	12
8	CL	29	CL	32	NQ	29	RTY	10	HO	11	KC	10
9	HO	29	O	31	CL	27	OJ	9	O	10	PL	9
10	O	27	W	27	O	26	PL	8	RTY	10	W	9
11	CD	27	BO	26	BO	25	NQ	8	CT	7	CD	8
12	C	23	HO	24	OJ	23	CT	7	OJ	6	OJ	8
13	OJ	22	C	21	HO	23	W	7	CD	5	O	8
14	W	18	ES	20	W	22	O	7	S	5	NQ	8
15	TY	18	TY	17	C	20	NG	5	PL	5	FV	5
16							MP1	5	FV	5	CT	5
17							FV	5	HG	5	MP1	5
18							CD	5				

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	OJ	12	EWJ	12	EWJ	13	CC	6	ACWI	7	ACWI	7
2	IXN	11	LC	12	EC	11	EWJ	5	LC	6	EMD	6
3	LC	11	IXN	12	OJ	11	EMD	5	ES	6	OJ	6
4	GLD	11	SM	11	SB	11	HG	5	EWJ	6	RTY	6
5	BO	11	IXJ	11	IXN	11	IXP	5	CC	6	EWJ	5
6	SB	11	GLD	11	IEF	10	LC	5	\$OSX	6	\$OSX	5
7	RXI	10	IXP	10	IXP	10	MXI	5	EMD	6	\$XOI	5
8	IXJ	10	HG	10	CT	10	RTY	4	IXP	5	TY	5
9	EWJ	10	SB	10	TY	10	ES	4	SM	5	IXP	5
10	DBA	10	OJ	10			DBA	4	EWU	5	LC	5
11	\$XOI	10	EXI	10			EXI	4	EXI	5		
12			EC	10			ACWI	4	RTY	5		
13			CT	10			IXJ	4	KW	5		
14			\$XOI	10			\$XOI	4	MXI	5		
15							OJ	4				
16							KW	4				
17							SM	4				
18							TY	4				
19							\$SOX	4				
20							\$HWI	4				

### 6.2.2.2 實驗 B-06

附表 F-19、實驗 B-06 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	CC	35	SF	37	RB	34	RB	23	RB	25	RB	24
2	SF	32	CC	35	CC	33	CC	18	CC	19	SF	19
3	RB	32	RB	34	SF	32	SF	16	SF	17	CC	15
4	BP	19	BP	22	BP	22	HO	8	BP	11	BP	10
5	RTY	19	HO	16	RTY	18	PL	8	CL	9	HO	9
6	HO	16	RTY	13	HO	15	BP	7	HO	9	PL	8
7	PL	11	CL	13	ES	13	CL	6	PL	6	CL	8
8	C	10	C	11	C	10	RTY	3	W	4	RTY	4
9	CL	9	ES	11	PL	10	CD	3	CD	4	NG	4
10	NG	7	W	8	CD	9	NG	3	RTY	2	CD	4
11	O	6	CD	8	NG	9	CT	2	O	2	W	2
12	CD	5	BO	8	BO	8	W	2	CT	2		
13	W	5	PL	8	CL	8	O	2				
14	TY	5	NG	6	O	5						
15	FV	5	JY	5	FV	5						
16			O	5								

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	BO	6	SB	8	EWJ	6	SM	4	SM	4	\$XNG	4
2	SM	6	\$XNG	7	BO	6	DBA	3	\$XCI	4	\$XCI	3
3	EWJ	6	SM	7	\$XOI	6	\$MXY	3	\$XNG	4	IXN	3
4	\$DDX	5	BO	6	TY	6	S	3	\$MNG	4	\$XOI	3
5	OJ	5	\$XOI	6	SB	6	\$XOI	3	IXP	3	OJ	3
6	TY	5	\$XCI	6	NQ	5	EXI	3	EXI	3	IXP	3
7	\$XNG	5	NQ	6	\$XNG	5	IXP	3	DBA	3	DBA	3
8	\$XOI	5	\$MXY	5	FV	5	OJ	3	S	3		
9	SB	5	EWG	5	\$DDX	5			\$OSX	3		
10	EZU	5	S	5	IXN	5			\$DDX	3		
11			EZU	5								
12			\$MNG	5								
13			\$DDX	5								

### 6.2.2.3 實驗 B-07

附表 F-20、實驗 B-07 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	BP	6	BP	6	BP	6	CC	4	BP	5	BP	5
2	CC	5	CC	5	CC	4	BP	4	CC	3	PL	2
3	PL	3	PL	4	SF	3	PL	2	PL	2	NG	2
4	SF	2	SF	3	PL	3			NG	2	CC	2
5	HO	2	NG	2	NG	2						
6	RB	1	HO	2	HO	2						
7	FV	1	RB	1	RB	1						
8	ED	1	ED	1	FV	1						
9	BO	1	BO	1	ED	1						
10					BO	1						

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	EC	2	EC	2	\$CZH	2	EC	2	EC	2	EC	2
2	\$DDX	2	\$XNG	2	\$DDX	2	SM	1	TIP	1	TIP	1
3	IXC	2	\$DDX	2	O	2	RTY	1	SM	1	SM	1
4	DX	1	\$OSX	2	IXC	2	IXC	1	IXC	1	IXC	1
5	\$HUI	1	\$CZH	2	\$XNG	2	EWU	1	FV	1	FV	1
6	\$XAU	1	O	2	EC	2	BO	1	EWU	1	BO	1
7	\$XNG	1	IXC	1	BO	1	\$XOI	1	BO	1	\$XOI	1
8	\$XOI	1	FV	1	\$HUI	1	\$XNG	1	\$XOI	1	\$XNG	1
9	BO	1	EWU	1	\$XAU	1	\$CZH	1	\$XNG	1	\$OSX	1
10	CL	1	EEM	1	\$XOI	1			\$OSX	1	\$CZH	1
11	SM	1	SM	1	TIP	1			\$CZH	1		
12	S	1	DBC	1	CL	1						
13	ED	1	BO	1	SM	1						
14	EEM	1	\$XOI	1	ED	1						
15	EWU	1	\$XAU	1	EEM	1						
16	O	1	RB	1	FV	1						
17	RB	1	\$HUI	1	S	1						
18	RTY	1	S	1	DX	1						
19	\$CZH	1	TIP	1								

### 6.2.2.4 實驗 B-08

附表 F-21、實驗 B-08 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	FV	1	BP	1	FV	1	BP	1	BP	1	BP	1

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	ED	1	\$OSX	1	ED	1	\$OSX	1	\$OSX	1	\$OSX	1

## 6.2.3 70 — 30%

### 6.2.3.1 實驗 B-09

附表 F-22、實驗 B-09 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	RB	55	RB	57	CC	44	RB	39	RB	39	RB	32
2	SF	37	CC	44	RB	43	CL	21	KC	25	CC	24
3	BP	35	SF	41	SF	42	BP	19	CL	22	KC	23
4	CC	34	KC	40	RTY	33	KC	18	CC	19	CL	21
5	CD	32	RTY	37	KC	33	CC	14	BP	16	BP	16
6	KC	30	ES	32	BP	31	SF	11	SF	16	SF	12
7	CL	28	BP	32	CD	30	HO	10	HO	12	OJ	10
8	HO	26	CD	31	CL	26	OJ	10	OJ	9	PL	9
9	OJ	26	CL	30	ES	24	PL	8	CT	9	HO	9
10	RTY	26	HO	27	DX	23	NQ	7	CD	9	RTY	8
11	DX	25	DX	25	HO	23	CT	7	PL	8	CD	7
12	C	21	OJ	24	OJ	20	DX	6	RTY	7	FV	6
13	NQ	20	C	22	BO	19	NG	6	HG	6	NQ	6
14	TY	18	BO	20	TY	18	MP1	6	MP1	6	MP1	6
15	ES	16	PL	18	FV	17	CD	6	DX	6	CT	6
16					NQ	17					NG	6

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	HYG	13	JXI	15	LC	14	EWT	7	EWT	7	EWT	7
2	LC	13	IXN	13	JXI	12	SM	7	EWJ	6	TIP	6
3	SM	12	LC	13	IEF	10	OJ	6	\$DDX	5	BO	5
4	IXN	11	EWT	11	OJ	10	EWJ	6	HYG	5	\$MXY	5
5	HO	11	SM	11	SM	9	HYG	5	\$MXY	5	TY	5
6	EWT	11	IEF	11	\$XOI	9	\$MXY	5	SM	5		
7	OJ	10	EWJ	10	EC	9	BO	5	EWU	5		
8	JXI	10	\$XOI	10	HYG	9	\$DDX	5	KW	5		
9	EWJ	10	OJ	10	FC	9	DBA	4	OJ	5		
10	IXC	9	HO	9	EXI	9	IXC	4				
11	\$XNG	9	HYG	9	EWT	9	NG	4				
12	EZU	9	HG	9	\$OSX	9	\$XCI	4				
13	\$MXY	9	\$XNG	9	TY	9	\$UTY	4				
14	HG	9	IXC	9	EWU	8	HG	4				
15	EC	9	EZU	9	HO	8	TIP	4				
16			IXP	9	KXI	8	\$OSX	4				
17			\$OSX	9	EWJ	8	S	4				
18					IXN	8	SB	4				
19					\$MXY	8	EWU	4				
20					EEM	8						

### 6.2.3.2 實驗 B-10

附表 F-23、實驗 B-10 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	CC	33	CC	35	CC	34	RB	19	CC	19	CC	21
2	RB	25	BP	21	RB	19	CC	15	RB	12	RB	13
3	RTY	18	SF	15	BP	16	BP	10	BP	11	BP	7
4	BP	16	RB	15	SF	15	HO	6	HO	6	SF	5
5	SF	14	RTY	13	RTY	15	PL	5	CL	4	PL	5
6	HO	12	ES	13	HO	11	CL	5	PL	3	NG	5
7	CD	8	HO	12	NG	9	NG	4	CD	3	HO	4
8	PL	7	CD	9	ES	9	SF	3	BO	3	CL	3
9	NG	6	BO	9	CD	8	DX	2	OJ	2	SB	2
10	ES	6	NG	6	BO	7	TY	2	NG	2	RTY	2
11	CL	6	C	6	ED	6	OJ	2	TY	2	OJ	2
12	BO	5	JY	5	PL	5	RTY	2	FV	2	FV	2
13	DX	5	PL	5	C	5	SB	2	SB	2	CD	2
14	C	5	CL	5	JY	4	BO	2	SF	2	DX	2
15	JY	5	TY	4	FV	4			SI	2		
16			FV	4	DX	4						
17			DX	4	SB	4						

  

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	EZU	6	\$XNG	7	\$MXY	6	SM	5	SM	5	BO	3
2	IXC	6	SM	6	\$XOI	5	\$MXY	3	HYG	3	S	3
3	\$MXY	6	\$MXY	6	EWZ	5	\$OSX	3	\$OSX	3	\$MXY	3
4	\$XNG	6	IXC	5	IXC	5	S	3	\$DDX	3	OJ	3
5	\$OSX	5	\$OSX	5	\$XNG	5	\$DDX	3	\$MXY	3		
6	GLD	5	EZU	5	RSX	4	OJ	3	HG	3		
7	HG	5	NQ	4	HG	4	HG	3				
8	SM	5	CT	4	HO	4						
9	EWG	4	HG	4	BO	4						
10	HO	4	HYG	4	NQ	4						
11	BO	4	EWZ	4	OJ	4						
12	NQ	4	BO	4	EZU	4						
13	EWZ	4	\$DDX	4	SOXX	4						
14	SB	4			\$DDX	4						
15	S	4			SB	4						
16	\$DDX	4			\$OSX	4						

### 6.2.3.3 實驗 B-11

附表 F-24、實驗 B-11 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	BP	7	BP	9	BP	6	BP	3	BP	4	BP	3
2	PL	2	PL	2	PL	2	PL	2	PL	2	PL	2
3	CC	2	NG	1	NG	1	CC	1	NG	1	NG	1
4	FV	1	HO	1	HO	1						
5			ED	1	FV	1						
6					ED	1						
7					CC	1						

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	\$XOI	2	IXC	2	\$XOI	2	SM	1	TIP	1	TIP	1
2	SM	1	\$XOI	2	TIP	1	IXC	1	IXC	1	IXC	1
3	S	1	TIP	1	S	1	EC	1	EC	1	EC	1
4	IXC	1	RB	1	RB	1	\$XOI	1	\$XOI	1	\$XOI	1
5	ED	1	EC	1	IXC	1	\$OSX	1	\$OSX	1	\$MXY	1
6	EC	1	DX	1	ED	1	\$CZH	1	\$MXY	1	\$CZH	1
7	DBC	1	DBC	1	EC	1			\$CZH	1		
8	\$XNG	1	\$XNG	1	DX	1						
9	\$TOB	1	\$OSX	1	\$XNG	1						
10	\$OSX	1	\$MXY	1	\$MXY	1						
11	\$CZH	1	\$DDX	1	\$DDX	1						
12			\$CZH	1	\$CZH	1						

### 6.2.3.4 實驗 B-12

附表 F-25、實驗 B-12 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	FV	1	FV	1	FV	1						

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	ED	1	ED	1	ED	1						

## 6.2.4 60 — 40%

### 6.2.4.1 實驗 B-13

附表 F-26、實驗 B-13 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	CC	67	CC	74	CC	69	CC	32	CC	32	CC	30
2	RTY	34	RB	44	RB	38	BP	19	RB	30	RB	27
3	BP	32	BP	36	SF	38	RB	19	BP	19	BP	17
4	RB	29	RTY	35	RTY	33	SF	10	KC	12	SF	16
5	SF	28	ES	33	BP	31	PL	9	SF	9	CD	10
6	CD	26	CD	30	CD	29	OJ	9	MP1	9	PL	10
7	BO	26	SF	27	ES	23	KC	9	OJ	8	OJ	10
8	PL	22	JY	26	JY	23	MP1	8	PL	8	JY	8
9	OJ	20	BO	23	OJ	22	FV	8	FV	8	MP1	8
10	JY	20	FV	21	BO	22	CD	7	CD	8	YM	7
11	FV	20	MP1	20	PL	20	TY	6	JY	8	CL	7
12	TY	19	YM	20	YM	17	BO	6	CT	8	CT	7
13	HO	18	OJ	18	TY	16	RTY	6	RTY	7	KC	6
14	MP1	17	DX	16	FV	16	ED	6	CL	6	BO	6
15	ES	17	KC	16	MP1	15	CT	6	TY	6	RTY	6

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	HYG	12	OJ	11	HYG	12	SM	6	CT	6	W	7
2	\$XNG	11	EWT	11	\$MXY	11	CT	6	HG	5	HYG	6
3	OJ	10	IXP	10	HO	10	HG	6	\$XNG	5	SB	5
4	EXI	10	EXI	10	EEM	10	HYG	6	OJ	5	CT	5
5	\$MXY	10	\$XNG	10	EWG	10	OJ	6	\$OSX	5	OJ	5
6	CT	10	CT	10	W	10	W	5	BP	5	BO	5
7	EWT	10	W	10	EXI	10	\$MNG	5	SM	5	TY	5
8	HG	10	SB	9	\$XNG	9	DBA	5	IXP	5	EWJ	4
9	\$CZH	9	EEM	8	CT	9	EWT	5	W	5	HG	4
10	\$OSX	9	HYG	8	IBB	9	\$OSX	4	SB	5	BP	4
11	EEM	9	HO	8	OJ	9	TY	4	\$MXY	4	IXP	4
12	HO	9	HG	8	EWT	8	IXC	4	EWT	4	DBA	4
13	DBA	8	EWZ	8	JXI	8	IXP	4	EWJ	4	IXC	4
14			EFA	8	IXP	8			\$MNG	4	\$MNG	4
15			\$ADR	8	EWJ	8			IXC	4	\$MXY	4
16			DBA	8	TY	8			TY	4	\$OSX	4
17			\$OSX	8					HYG	4	SM	4
18									DBA	4		

### 6.2.4.2 實驗 B-14

附表 F-27、實驗 B-14 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	CC	47	CC	50	CC	48	CC	22	CC	22	CC	20
2	BP	18	BP	20	RB	18	BP	11	RB	12	RB	13
3	RB	15	RB	16	BP	14	RB	8	BP	12	BP	8
4	RTY	13	ES	13	SF	12	PL	5	HO	3	PL	6
5	ES	13	HO	12	RTY	12	SF	3	ES	3	HO	3
6	HO	12	CD	9	PL	11	RTY	3	CD	3	RTY	3
7	PL	11	BO	8	HO	11	HO	3	BO	3	SF	3
8	BO	9	PL	7	ES	10	ED	3	TY	2	ES	3
9	SF	9	TY	5	CD	8	CD	3	PL	2	ED	3
10	CD	8	ED	5	ED	7	BO	3	NG	2	CL	2
11	ED	6	SF	4	BO	7	TY	2	ED	2	CD	2
12	TY	5	NG	4	TY	5	SB	1	MP1	1	TY	2
13	C	4	C	3	C	4	NG	1	CT	1	NG	2
14	FV	4	FV	3	NG	4	ES	1	CL	1	BO	2
15	NG	3	CT	2	CL	3	CT	1	C	1	MP1	1
16			CL	2	SB	3	C	1			C	1
17			MP1	2	MP1	3					SB	1
18			RTY	2	FV	2						
19					DX	1						
20					US	1						

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	\$MXY	7	\$XNG	6	EWG	6	IXC	3	\$MXY	4	\$MXY	4
2	\$XNG	5	\$MXY	5	\$MXY	6	\$MXY	3	\$XNG	4	HYG	3
3	\$XOI	5	\$OSX	4	HYG	5	SM	3	HG	3		
4	\$OSX	5	IXP	4	\$OSX	5	\$XNG	3	HYG	3		
5	EWG	4	HYG	4	\$XOI	5	HYG	3	EWJ	2		
6	HO	4	HG	4	BO	4	W	2	IXC	2		
7	HYG	4	EWJ	4	EWJ	4	\$OSX	2	\$OSX	2		
8	IXC	4	\$XOI	4	EEM	4	\$UTY	2	\$UTY	2		
9	BO	4			IXN	4	BO	2	DBA	2		
10	EWJ	4					CD	2	EC	2		
11	EWZ	4					DBA	2	EWG	2		
12							EC	2	US	2		
13							EWJ	2	EWU	2		
14							HG	2	\$CZH	2		
15							HO	2	IXP	2		
16							EWU	2	SM	2		
17							\$CZH	2	MXI	2		
18							OJ	2				
19							JXI	2				
20							IXP	2				



### 6.2.4.3 實驗 B-15

附表 F-28、實驗 B-15 經篩選驗證集在不同排序方法與不同高原點數之交易與關聯商品排序

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	BP	6	BP	8	BP	8	BP	6	BP	7	BP	7
2	PL	3	PL	4	PL	4	PL	2	PL	2	PL	3
3	BO	2	NG	2	NG	2			NG	1	NG	1
4	NG	1	BO	2	FV	1						
5	FV	1	FV	1	ED	1						
6	CC	1	ED	1	CC	1						
7			CC	1	BO	1						

	M-20		N-20		P-20		M-40		N-40		P-40	
1	\$OSX	2	IXC	2	IXC	2	IXC	1	IXC	2	IXC	2
2	TIP	1	\$OSX	2	\$OSX	2	EWU	1	FV	1	FV	1
3	O	1	TIP	1	TIP	1	EC	1	EWU	1	EWU	1
4	IXC	1	C	1	FV	1	BO	1	EC	1	EEM	1
5	EWU	1	\$DDX	1	EWU	1	\$XOI	1	BO	1	EC	1
6	ED	1	\$HUI	1	EEM	1	\$OSX	1	\$XOI	1	BO	1
7	EC	1	\$MXY	1	ED	1	\$MXY	1	\$OSX	1	\$XOI	1
8	C	1	\$XOI	1	EC	1	\$CZH	1	\$MXY	1	\$OSX	1
9	BO	1	BO	1	DX	1			\$CZH	1	\$MXY	1
10	\$XOI	1	DX	1	C	1					\$CZH	1
11	\$MXY	1	O	1	BO	1						
12	\$HUI	1	EC	1	\$XOI	1						
13	\$CZH	1	ED	1	\$MXY	1						
14			EEM	1	\$HUI	1						
15			EWU	1	\$DDX	1						
16			FV	1	\$CZH	1						
17			\$CZH	1								

### 6.2.4.4 實驗 B-16

本實驗中經篩選後之驗證集，無任何商品配對組合通過篩選之條件。