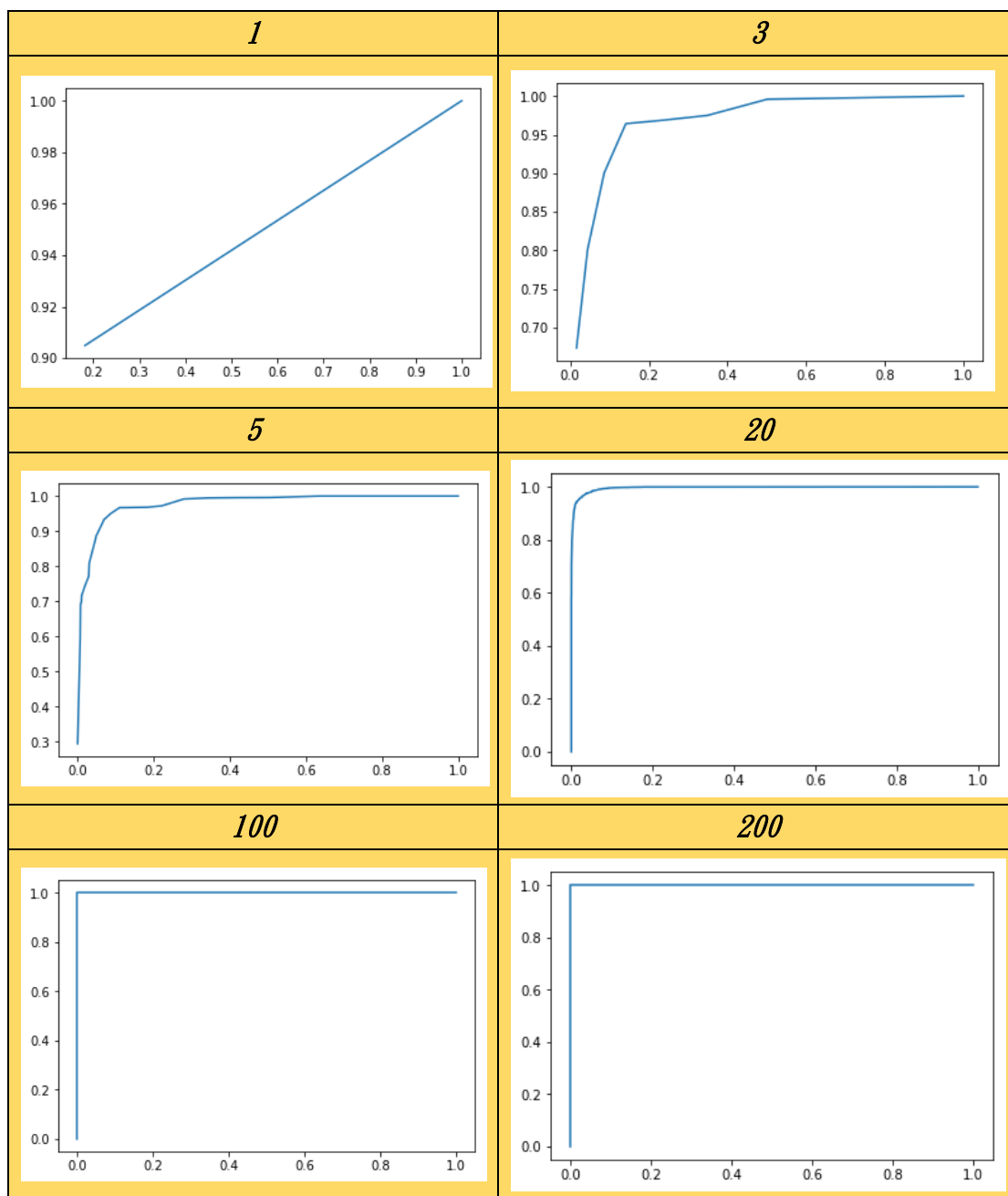


人工智慧與金融科技實務 HW7

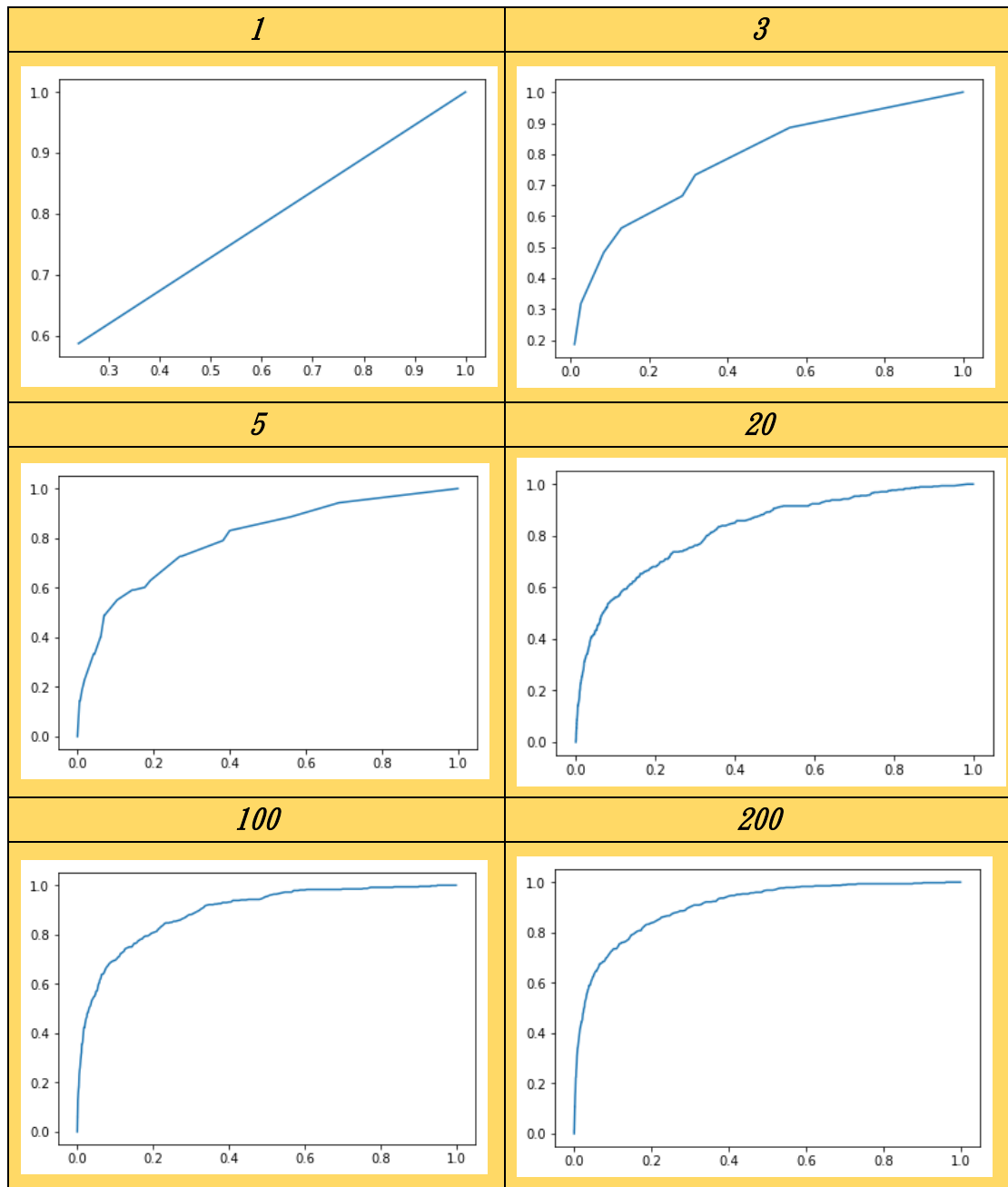
資管碩一 0853412 吳宛儒

1. ROC 曲線

Train :



Test :



2. 尋找人臉

圖片 1

圖片大小：900 x 600
搜尋範圍：900 x 600
框起來的大小：19 x 19



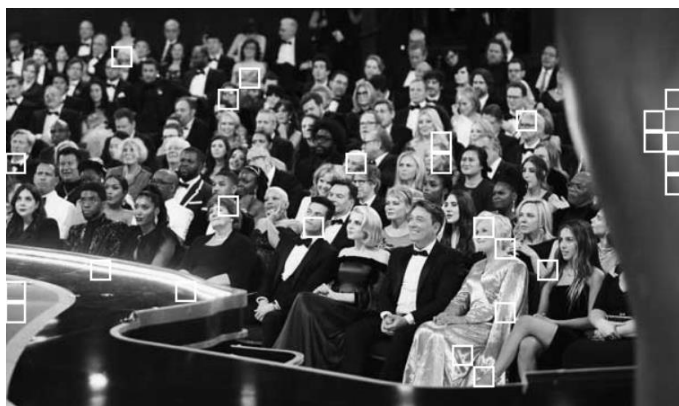
圖片 2

圖片大小：1080 x 867
搜尋範圍：1050 x 850
框起來的大小：19 x 19

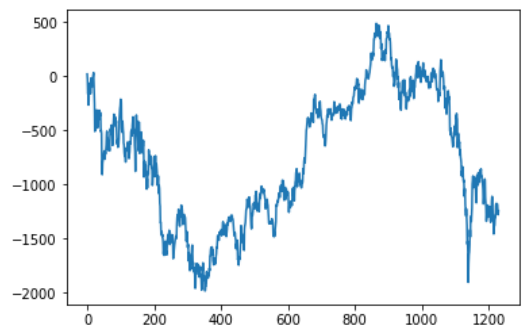
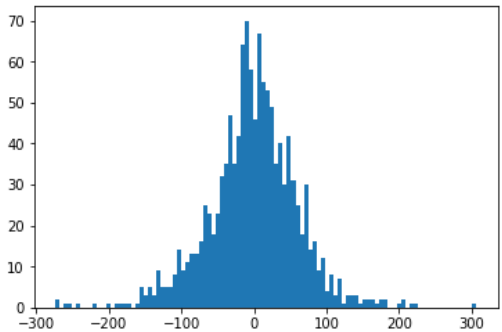


圖片 3

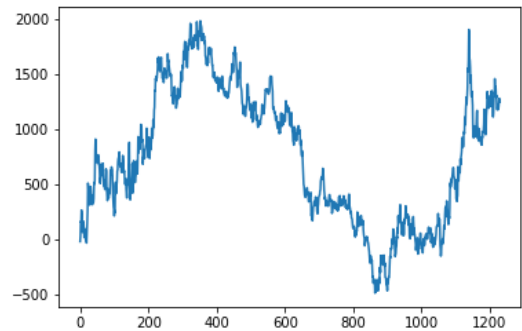
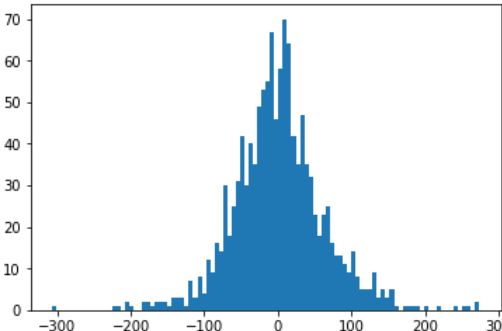
圖片大小：620 x 370
搜尋範圍：620 x 370
框起來的大小：19 x 19



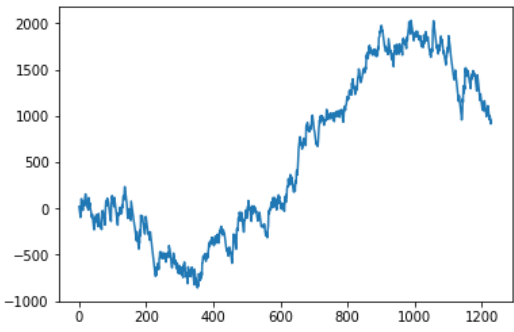
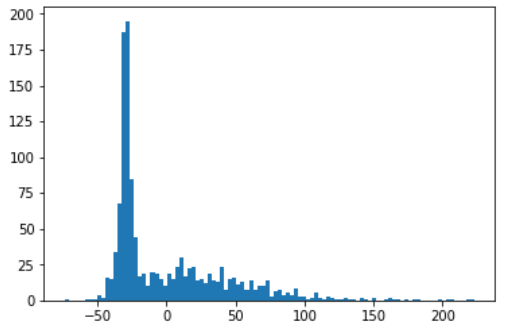
3. 整理上課提到的投資策略模擬 0.0-3.10.0

【0.0】描述	
每天開盤前掛市價買，第一分鐘開盤買進，每天最後一分鐘掛市價賣，收盤價賣出	
逐日累積損益	每日損益的分布圖
	
進場次數	每天進場一次
總損益點數	-1246.0
勝率	0.4991869918699187
賺錢時平均每次獲利點數	44.77850162866449
輸錢時平均每次損失點數	-46.65584415584416

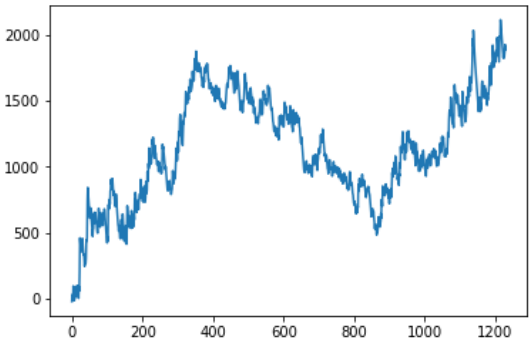
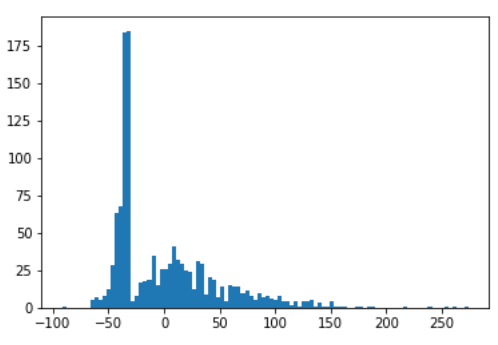
0.1

【0.1】描述	
開盤空一口台指期，收盤時平倉	
逐日累積損益	每日損益的分布圖
	
進場次數	每天進場一次
總損益點數	1246.0
勝率	0.4943089430894309
賺錢時平均每次獲利點數	47.26973684210526
輸錢時平均每次損失點數	-44.20257234726688

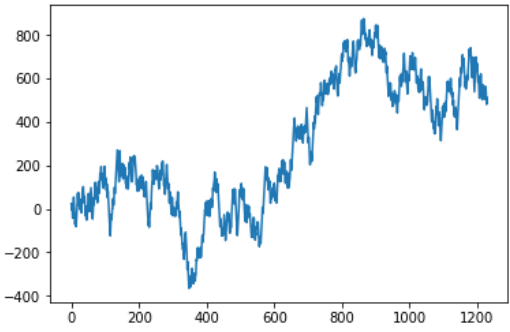
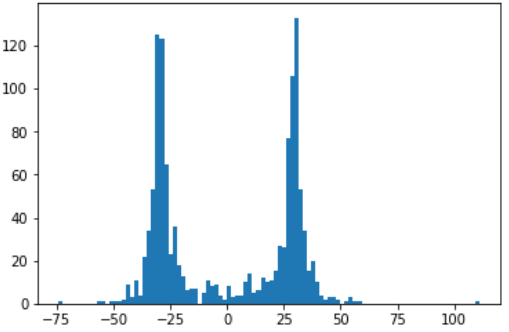
1.0

【1.0】描述	
開盤買進一口，30點停損，收盤平倉	
逐日累積損益	每日損益的分布圖
	
進場次數	每天進場一次
總損益點數	948
勝率	0.37886178861788616
賺錢時平均每次獲利點數	46.80472103004292
輸錢時平均每次損失點數	-27.30759162303665

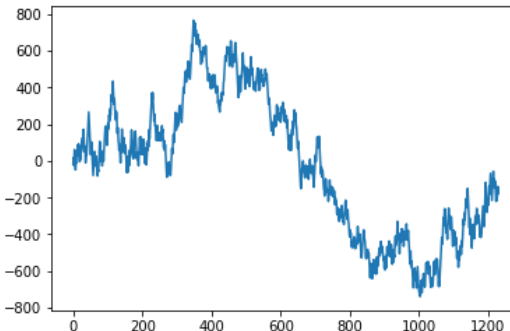
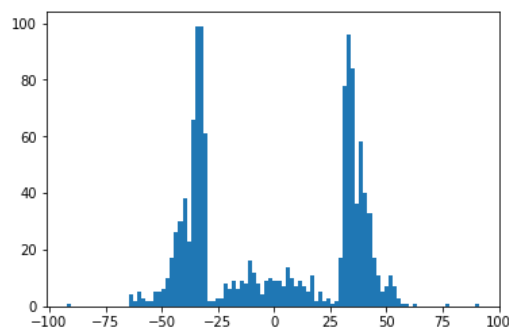
1.1

【1.1】描述	
開盤空一口，30點停損，收盤平倉	
逐日累積損益	每日損益的分布圖
	
進場次數	每天進場一次
總損益點數	1885
勝率	0.4186991869918699
賺錢時平均每次獲利點數	48.0252427184466
輸錢時平均每次損失點數	-31.955244755244756

2.0

【2.0】描述	
開盤買進一口，30 點停損，30 點停利，收盤平倉	
逐日累積損益	每日損益的分布圖
	
進場次數	每天進場一次
總損益點數	512
勝率	0.5048780487804878
賺錢時平均每次獲利點數	27.996779388083738
輸錢時平均每次損失點數	-27.707717569786535

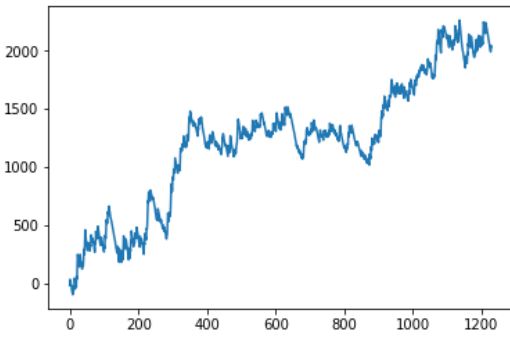
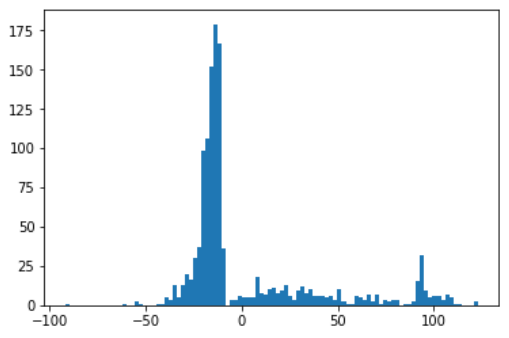
2.1

【2.1】描述	
開盤空一口，30 點停損，30 點停利，收盤平倉	
逐日累積損益	每日損益的分布圖
	
進場次數	每天進場一次
總損益點數	-179
勝率	0.491869918699187
賺錢時平均每次獲利點數	33.25785123966942
輸錢時平均每次損失點數	-32.48

3.0

【3.0】描述	
在 m 點時停利，在 n 點時停損，但 $m > n$	
作法	
基於 2.0 找出 m(停利), n(停損)使總損益點數最佳化	
結果	
結果：[327, 181, 623, 495, 777, 816, 442, 795, 697, 624, 430, 270, 995, 1020, 1262, 1625, 1446, 1537, 1526, 1548, 657, 166, 512, 644, 1077, 1149, 735, 1005, 898, 669, 48, -703, -581, -99, 274, 323, -13, 295, 77, -100, 95, -935, -716, -158, 80, 58, -284, -60, -296, -424, 154, -1062, -614, -156, 383, 238, -177, 100, -210, -265, 115, -1397, -1006, -461, 6, -151, -691, -471, -807, -849, -129, -1483, -1144, -741, -327, -358, -970, -733, -1092, -1176, -612, -1833, -1366, -991, -446, -410, -1066, -806, -1145, -1217, -614, -1859, -1233, -902, -315, -285, -944, -653, -920, -920] 最大為 $m=60, n=20$ 時的 1625 總損益點數。	
逐日累積損益	每日損益的分布圖
	
進場次數	每天進場一次
總損益點數	1625
勝率	0.3252032520325203
賺錢時平均每次獲利點數	43.8125
輸錢時平均每次損失點數	-19.156626506024097

3.1

【3.1】描述	
找到一組 m , n 改進策略 2.1 使總損益點數最佳化	
作法	
基於 2.1 找出 m (停利), n (停損)使總損益點數最佳化	
結果	
<p>結果：[32, 162, 591, 1188, 1644, 1583, 1146, 1667, 2031, 2149, -1109, -499, -52, 712, 774, 780, 241, 806, 1121, 1156, -854, -440, -179, 702, 648, 835, 373, 898, 1230, 1309, -911, -588, -197, 639, 362, 463, 134, 674, 942, 919, -847, -817, -406, 487, 224, 282, -159, 286, 579, 567, -842, -846, -532, 423, 316, 513, 139, 642, 982, 1029, -789, -761, -371, 666, 524, 798, 376, 879, 1226, 1297, -656, -690, -267, 704, 578, 794, 267, 730, 1054, 1139, -693, -818, -369, 630, 509, 698, 183, 646, 970, 1055, -613, -780, -332, 674, 558, 773, 301, 747, 1071, 1156] 最大為 $m=90, n=10$ 時的 2149 總損益點數。</p>	
逐日累積損益	每日損益的分布圖
	
進場次數	每天進場一次
總損益點數	2031
勝率	0.26910569105691057
賺錢時平均每次獲利點數	51.963746223564954
輸錢時平均每次損失點數	-16.873192436040046