

Fintech Final Project

資工 碩一 R07922003 劉濬慶

Optimization strategy

決策一:是沿用 HW04 中策略，可變參數有三個，分別是：

window size = 11

alpha = 6

beta = 19

決策二:是運用兩個 RSI 指標，分別使用 8 天當作短期 RSI，20 天當作長期的 RSI。

I. 8 days RSI or 20 days RSI ≥ 80 : action = -1

II. 8 days RSI or 20 days RSI ≤ 20 : action = 1

決策三:是使用黃金交叉和死亡交叉，分別用 8 天和 20 天當作基準算交叉。

Note: 決策三會蓋過決策二，決策二會蓋過決策一的
action 動作

Testing Score

#		Problem	User	Verdict		Date
26064	80006	FinTech Project Final Submission	r07922003	Wrong Answer (score: 371) 	Python 3 	2018/12/28 12:41:07

用 Judege System 測試的話分數大概 371 分