

題目二 - 第二組

結合量化及質化指標的 市場加減碼策略

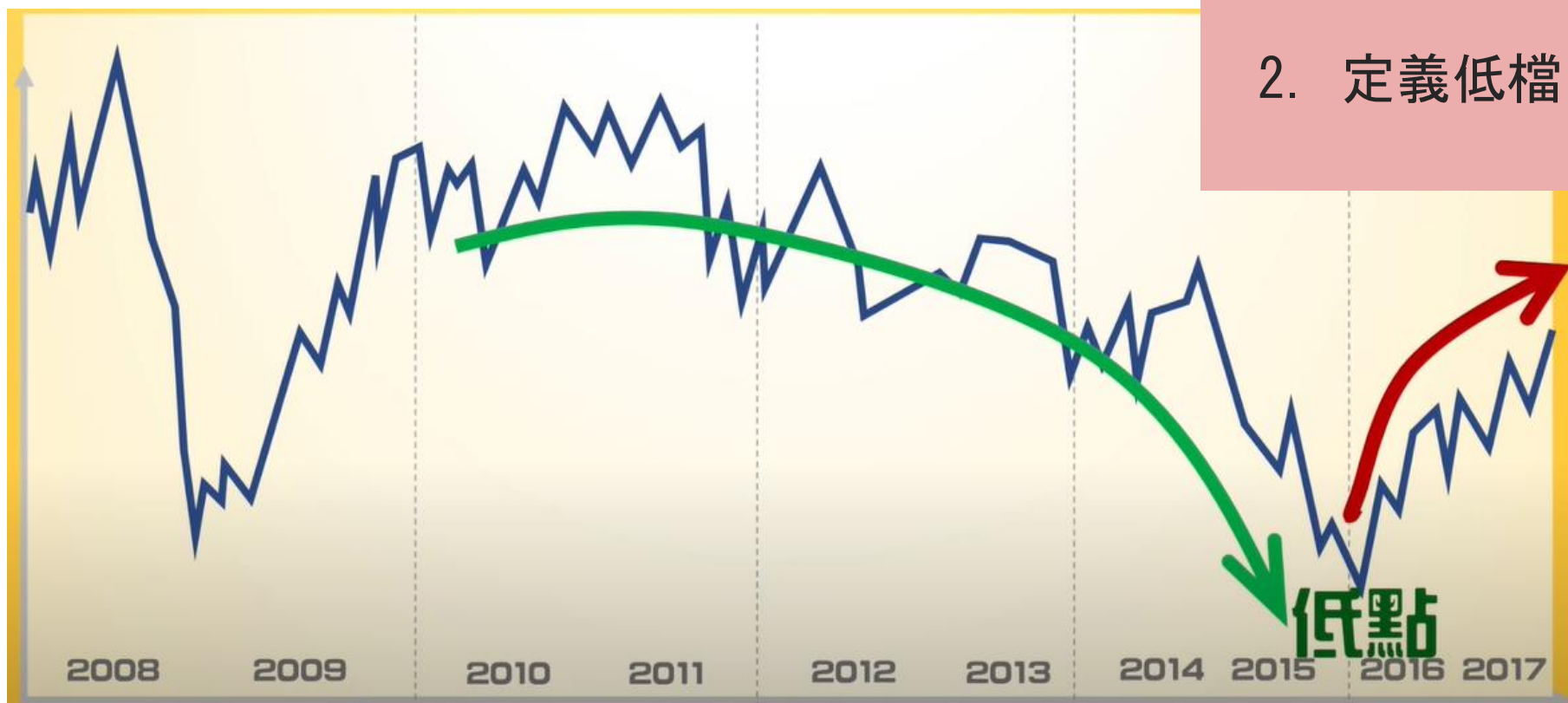
問題定義 & 說明

- D檔投資 = 定期定額 + 低檔加碼

1. 定期定額 + 穩定成長 = 賺錢
2. 買入成本愈低，風險愈低

問題定義 & 說明

- D檔投資 = 定期定額 + 低檔加碼



1. 未來走勢預測
2. 定義低檔

定義低檔

- 主要問題：避免加碼次數過於頻繁
- 貼label：告訴我們何時為「低檔」應該加碼
- Label範圍選取，由統計分析推導

- a. 百分比
- b. 標準差

定義低檔

- 主要問題：避免加碼次數過於頻繁
- 貼label：告訴我們何時為「低檔」應該加碼
- Label範圍選取，由統計分析推導

- a. 百分比
- b. 標準差

未來走勢預測

- 資料準備、特徵工程
- 丟機器學習模型預測
 - a. 基金相關
 - b. 標的物相關

資料來源

- 選定基金 【野村環球 - 台幣累積】
- 量化資料：基金淨值、相對應的指數
- 質化資料
 - 新聞：CNBC
 - 論壇：Reddit
 - 財報：Rocket

代辦事項

- 基金相關ML， 加入時間性
- 標的物相關的ML需要的資料
- 質化資料處理
 - 新聞：CNBC
 - 論壇：Reddit
 - 財報：Rocket

Things To Do

動態策略function

🕒 5月9日

陳博宇

+ 新增另一張卡片

Doing

策略效能評估

👁️ 🕒 5月9日 ☰ 💬 1

陳博宇

標準差 -> 夏普值 -> 策略

🕒 5月9日

陳博宇

標準差 -> 提琴圖

🕒 5月9日

陳博宇

量化資料統計分析&視覺化

👁️ 🕒 5月9日

陳鳳庭

質化資料&NLP處理

👁️

陳鳳庭

建立ML分類器

👁️ 🕒 5月9日 ☰ 📧 0/3

陳鳳庭

+ 新增另一張卡片

Done

3/28 見面討論

☰

與mentor題目釐清

☰

第二次討論

🕒 4月12日 ☰ 💬 1

第一次分工確認討論過程錄影

👁️ 🕒 4月13日 💬 2

陳鳳庭

結合統計結果標記label

🕒 4月18日 💬 2

YC

投資報酬率+Plotly

🕒 4月18日 ☰

陳博宇

+ 新增另一張卡片

+ 新增其他列表

