

## 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

---

## 優化D檔投資法

- D檔投資 = 定期定額 + 低檔加碼
- 與前10天基金淨值相比，下跌超過10%就自動加碼

## 優化方案

- 作法一：基金淨值最佳化
- 作法二：機器學習

# 資料來源 & 前處理步驟

---

爬蟲

基金公開資訊網站

TEJ

指數、指標資料試跑

# 資料EDA & 視覺化解讀

蒐集資料

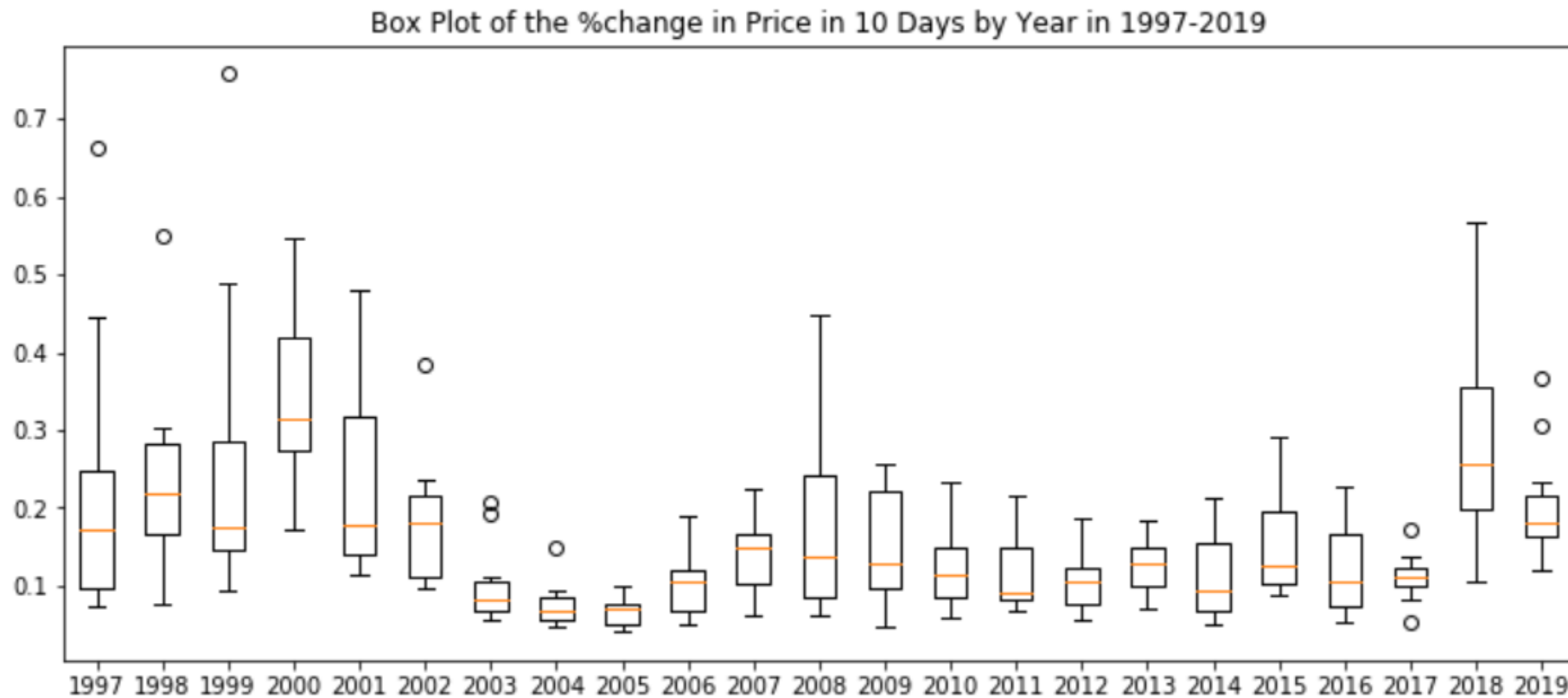
清洗資料

特徵擷取

41	1997/02/20	11.44	-2.0	Little High Point
42	1997/02/27	11.38	-1.67	Little High Point
43	1997/02/28	11.29	-0.53	Little High Point
44	1997/03/01	11.26	-0.62	Little High Point
45	1997/03/03	11.26	-0.89	Little High Point
46	1997/03/04	11.18	-0.54	Little High Point
47	1997/03/05	11.14	-0.09	Little High Point
48	1997/03/06	11.15	-1.17	High Point
49	1997/03/07	11.08	-0.99	Little High Point
50	1997/03/08	11.11	-2.07	High Point
51	1997/03/10	11.12	-1.89	High Point

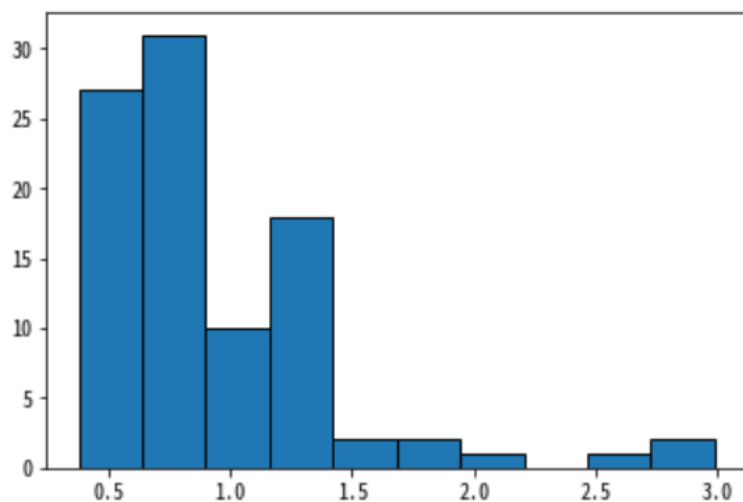
# 資料EDA & 視覺化解讀

## 資料視覺化

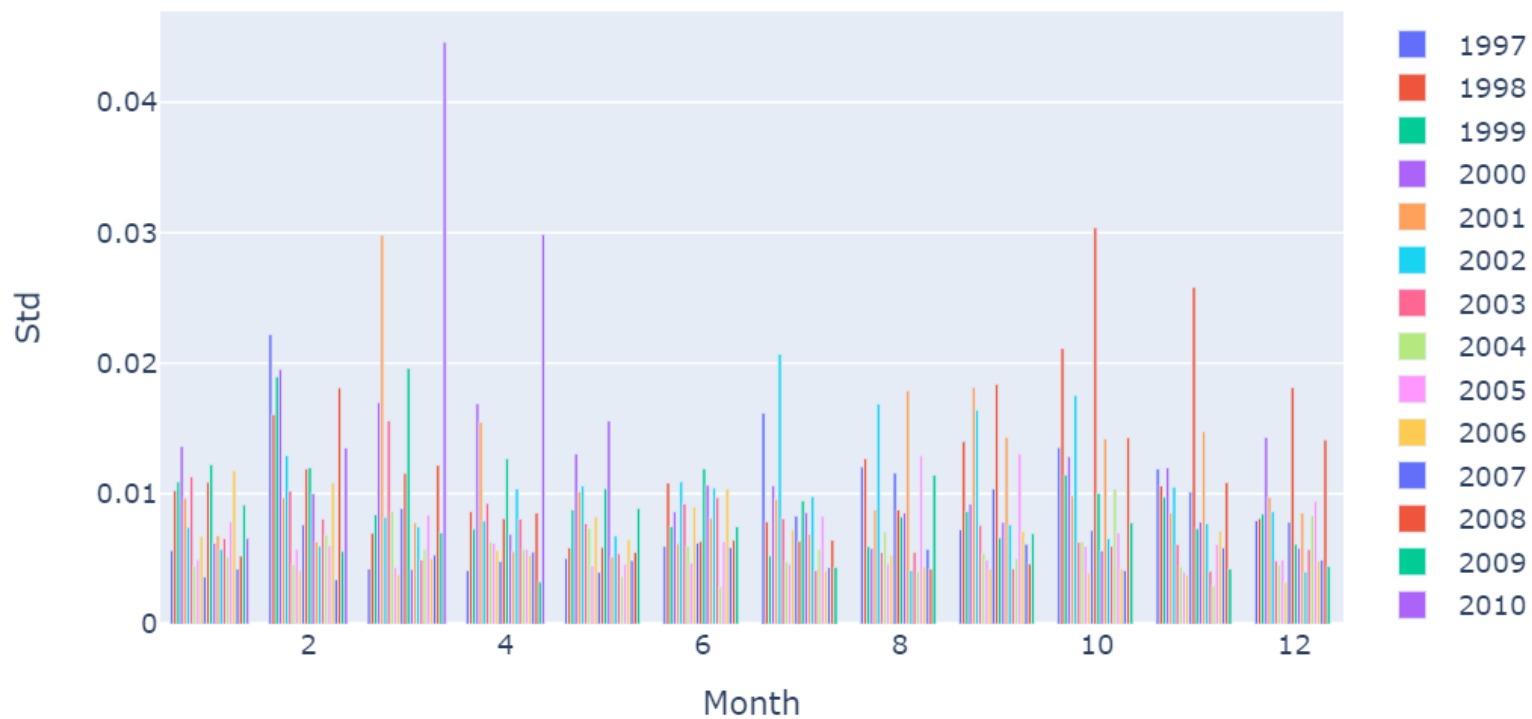


# 資料EDA & 視覺化解讀

## 資料視覺化



Year Standard Deviation



# 如何分工

---

## 統計分析

@ 陳博宇  
@ 陳鳳庭

## 機器學習

@ 張筱青  
@ 吳豐光  
@ 陳怡蓁

# 如何解決問題

---

- 建立工具使用
- 固定時間討論
- 知識、技術面問題，直接詢問老師



Things To Do

+ 新增卡片

Doing

法一改善：利用標準差調整投資頻率  
🕒 5月2日 陳博宇

量化資料統計分析 & 質化的一些部分  
👁️ 🕒 5月2日

Label調整及報酬率驗證  
🕒 5月2日 AN

建立ML分類器  
🕒 5月2日 0/3 YC

因子資料整體(調整時間)  
🕒 5月2日 C

+ 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

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

# 第三次討論紀錄

🕒 Created 4月 19, 2020 12:13 中午

🏷 Tags Empty

+ Add a property

鳳庭 Add a comment...

## 一、進度匯報

大綱：用量化資料分類是否為合適的買入點，最後再加入質化資料作調整

作法：法一 & 法二


法一：

目前進度：

1. 統計分析結果 - 日報酬率的季標準差分布直方圖
2. 建立累積報酬率計算函式
3. 由低檔投資出發作改良 (找出最適 N 天 & %數)

35 commits1 branch0 packages0 releases3 contributors

Branch: masterNew pull requestCreate new fileUpload filesFind fileClone or download

 boyuchen0224 Merge pull request #8 from boyuchen0224/master	Latest commit f555275 2 days ago
<a href="#">.ipynb_checkpoints</a>	Add fb crawler test 2 days ago
<a href="#">.gitignore</a>	Add strategy, priceAvg fun 10 days ago
<a href="#">Data_Analysis.ipynb</a>	Add fb crawler test 2 days ago
<a href="#">FB_Crawler_Test.ipynb</a>	Add fb crawler test 2 days ago
<a href="#">Labeled_Nomura_Global_Equity_Fund.csv</a>	Add files via upload 4 days ago
<a href="#">Labeling.ipynb</a>	Add files via upload 4 days ago
<a href="#">Nomura_Global_Equity_Fund.csv</a>	Fix roi err 2 days ago
<a href="#">Nomura_Global_Equity_Fund_Crawler.ipynb</a>	Add Ten Percent Buying Info 10 days ago
<a href="#">README.md</a>	Update README.md 28 days ago
<a href="#">Statistics_Analysis.ipynb</a>	Merge branch 'master' into master 2 days ago

README.md