CTBC投資名人堂

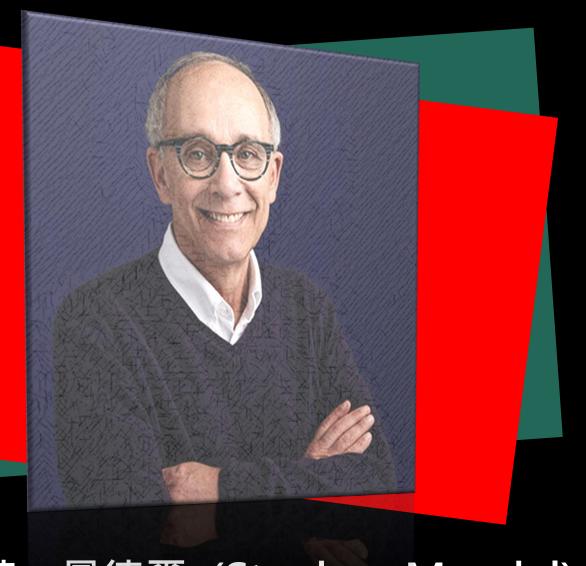
指導業師: 林裕訓

指導老師: 石百達、蔡芸琤

許惟傑(台大財金碩一) 林哲瑋(台大財金碩一)

徐慕華(台大國企碩二) 盧煒中(東吳巨資大三)





史蒂芬・曼德爾 (Stephen Mandel)

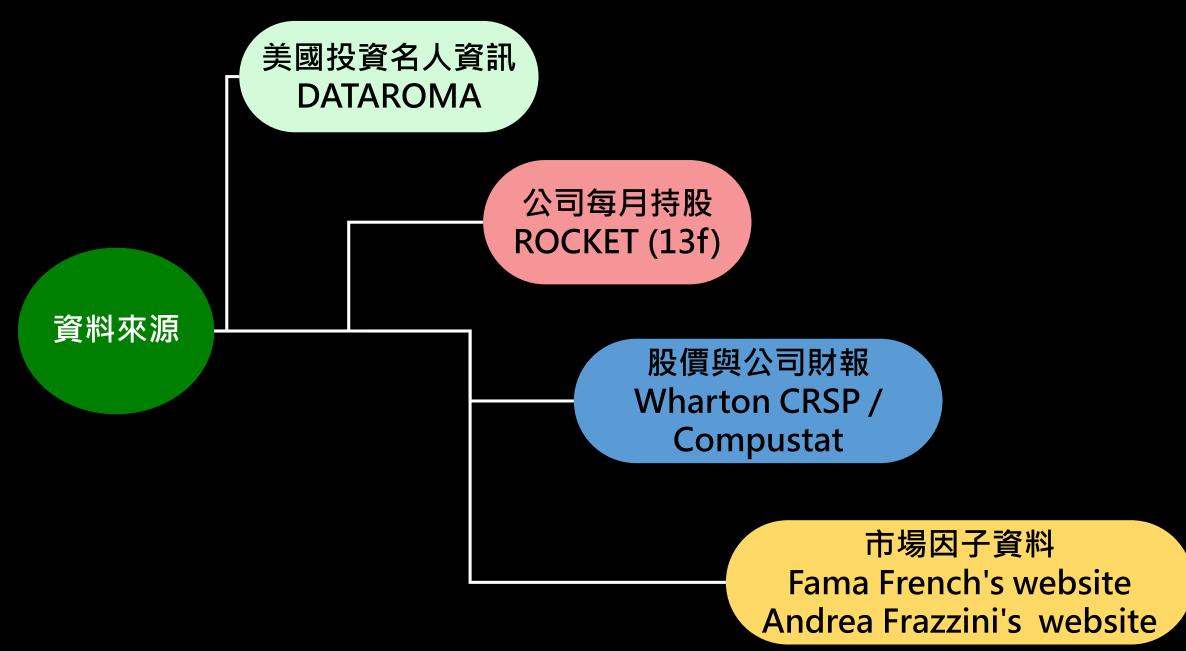


● 非價值也非成長型投資人,尋找由好人所經營的優質企業

● 由下而上(bottom-up),相信基於徹底了解企業之基本面能預判未來成長

● 偏愛企業

- 以自己的優勢保持營收成長創造價值的企業
- 管理優良的企業
- 有新的企業策略但尚未反映至價格上的企業
- 持有期間非長期,買賣憑自身有力且迅速的判斷





01

03

產業篩選

因子篩選

股票交易特徵訓練

產業篩選



統計投資人每季 股票所屬產業

挑選產業累積占比大於等於80% (若不滿五個產業,則補至五個)



計算每個產業佔投組的比例 (以次數計算比例)

因子篩選





MKT CMA HIVE

v2.6.0-beta.2 | build: release 2.6.0-beta 2

build: build 2.6.0-beta.2

feat: dynamic directive arguments for v-on, v-bind and custom

origin/dynamic-directive-arguments) feat: dynamic args for customers

perf: improve scoped slots change detection accuracy (#9371)

test: test cases for v-on/v-bind dynamic arguments

refactor: v-bind dynamic arguments use bind helper

段票交易特徵訓練

.eslintignore

.babelrc.js

.editorconf

packages

scripts

> test

> types

D STC

eslintrc.js

.flowconfig

.gitignore

BACKERS.md

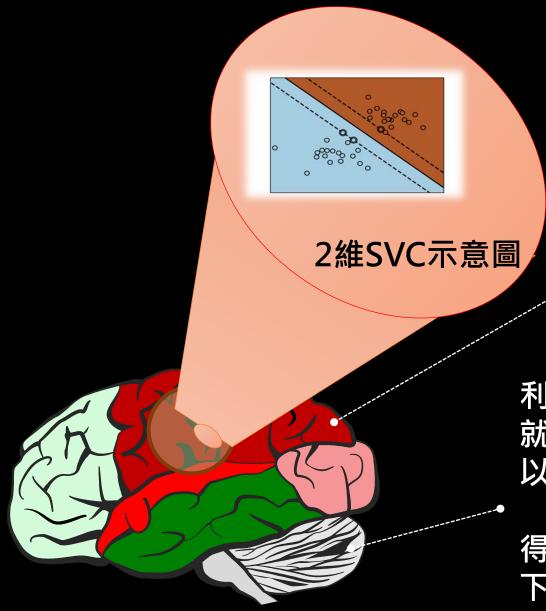
feat: dynamic directive arguments for v-bind and v-on refactor: extend dom-props update skip to more

fix: fix checkbox event edge case in Final

test: fix tests in IE/Edge

chore: uprashe comment

refactor: simplify time stamps of the



訓練時,放入上一期之features 並使在本期投資人有買之股票=1; 隨機從市場抽樣設為本期投資人未買 的股票=0 最後得出數個模型

利用各模型作為我們下一期選股之模型,也就是在下一期買股票時,會利用此期features以及此模型挑選股票

得出數組股票後,我們將其取交集,得知在 下一期時我們會選哪些股票



Liquidity



One year Range

Volatility

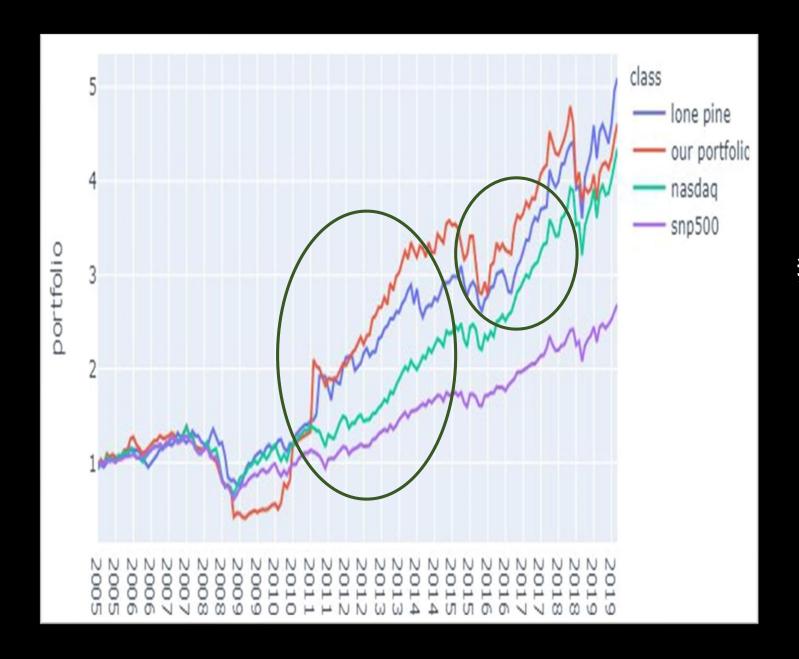


SST Momentum



模型結果





我們的投組累積報酬與Stephen Mandel的累積原報酬相關係數

0.9678



主要貢獻

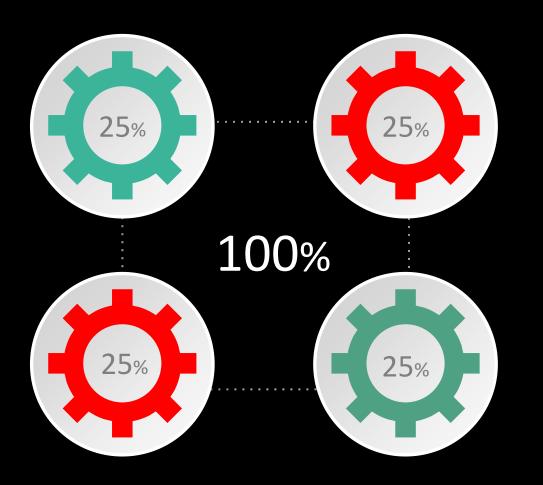
未來目標

許惟傑

簡報製作 架構規劃 尋找因子

林哲瑋

簡報製作 架構規劃 尋找因子



盧煒中

資料爬蟲 資料清洗 機器學習

徐慕華

簡報製作 架構規劃 尋找因子

