

工作進度報告

投資因子分析

目錄 | Contents



1. 資料來源

2. 共現圖規劃

3. 討論狀況

4. 研究方向

5. 參考網址



資料來源

資料來源

01

SEC DOCUMENT



02

CRSP CENTER



03

YAHOO FINANCE



04

QUANDL



05

Rocket



CRSP DATA

PERMNO	date	SHRCD	TICKER	COMNAM	SHRCLS	CUSIP	PRC	VOL	RET
10001	20141222	11	EGAS	GAS NATURAL INC		36720410	10.95	27715	0.009217
10001	20141223	11	EGAS	GAS NATURAL INC		36720410	10.9	24333	-0.004566
10001	20141224	11	EGAS	GAS NATURAL INC		36720410	11.03	14881	0.011927
10001	20141226	11	EGAS	GAS NATURAL INC		36720410	11.04	25496	0.000907
10001	20141229	11	EGAS	GAS NATURAL INC		36720410	10.88	16249	-0.014493
10001	20141230	11	EGAS	GAS NATURAL INC		36720410	10.95	10705	0.006434
10001	20141231	11	EGAS	GAS NATURAL INC		36720410	11.02	32865	0.006393
10025	20141222	11	AEPI	A E P INDUSTRIES INC		103110	56.34	11411	0.003384
10025	20141223	11	AEPI	A E P INDUSTRIES INC		103110	56.98	9722	0.01136
10025	20141224	11	AEPI	A E P INDUSTRIES INC		103110	57.3	9149	0.005616
10025	20141226	11	AEPI	A E P INDUSTRIES INC		103110	57.75	4691	0.007853
10025	20141229	11	AEPI	A E P INDUSTRIES INC		103110	57.95	5912	0.003463
10025	20141230	11	AEPI	A E P INDUSTRIES INC		103110	56.47	18785	-0.025539
10025	20141231	11	AEPI	A E P INDUSTRIES INC		103110	58.15	13085	0.02975
10026	20141222	11	JJSF	J & J SNACK FOODS CORP		46603210	108.98	25514	0.016794
10026	20141223	11	JJSF	J & J SNACK FOODS CORP		46603210	110.31	43241	0.012204
10026	20141224	11	JJSF	J & J SNACK FOODS CORP		46603210	109.2	33557	-0.010063
10026	20141226	11	JJSF	J & J SNACK FOODS CORP		46603210	110.35	31428	0.010531
10026	20141229	11	JJSF	J & J SNACK FOODS CORP		46603210	111.51	36414	0.010512
10026	20141230	11	JJSF	J & J SNACK FOODS CORP		46603210	110.07	20797	-0.012914
10026	20141231	11	JJSF	J & J SNACK FOODS CORP		46603210	108.77	63558	-0.011811
10028	20141222	11	DGSE	D G S E COMPANIES INC		2.94E+14	1.1901	5400	0.043947
10028	20141223	11	DGSE	D G S E COMPANIES INC		2.94E+14	1.14	15435	-0.042097

Rocket SEC DATA

Name	Ticker	Class	Shares	Change	Value	Change	% Port	% OS	Hist	Date
Mastercard Inc	MA	CL A	6380459	-291741	1905141000	93172000	14.61	0.63	Hist	12/31/2019
NESTLE SA	NSRGY	Common	12760244	-276446	1381424000	-31753000	10.6		Hist	12/31/2019
BERKSHIRE HATHAWAY INC	BRK.A	Common	3850	-76	1307422000	83170000	10.03	0	Hist	12/31/2019
HEINEKEN HOLDING N V	HKHHF	Common	8992136	-153751	872093000	-38744000	6.69		Hist	12/31/2019
PERNOD RICARD S A /FI	PDRDF	Common	4844875	-93487	866877000	-12836000	6.65		Hist	12/31/2019
COMPAGNIE FINANCIERE RICHEMONT AG /FI	CFRHF	Com	10157731	-253848	797849000	33334000	6.12		Hist	12/31/2019
Philip Morris International Inc.	PM	Common	8863924	-219411	754231000	64533000	5.79	0.57	Hist	12/31/2019
UNILEVER N V	UN	N Y SHS NEW	12374258	-266824	711025000	-47819000	5.45		Hist	12/31/2019
WELLS FARGO & COMPANY/MN	WFC	Common	12639980	-143867	680031000	35214000	5.22	0.3	Hist	12/31/2019
Anheuser-Busch InBev SA/NV	BUDDF	COM	7574490	-163448	618207000	-119259000	4.74		Hist	12/31/2019
BERKSHIRE HATHAWAY INC	BRK/B	Common	2206875	-55786	499857000	29178000	3.83	0.16	Hist	12/31/2019
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	MLM	Common	1687254	-50423	471824000	-4473000	3.62	2.7	Hist	12/31/2019
Alphabet Inc.	GOOG	COM	312829	57451	418259000	106953000	3.21	0.05	Hist	12/31/2019
SWATCH GROUP	SWGAF	Common	1044330	-42700	291185000	2408000	2.23		Hist	12/31/2019
COMCAST CORP	CMCSA	Common	5778809	-126684	259873000	-6347000	1.99	0.13	Hist	12/31/2019
BROWN FORMAN CORP	BF.A	CL A	3738915	-142537	234692000	2775000	1.8	0.78	Hist	12/31/2019
DIAGEO PLC	DGEAF	Common	5427771	-142995	230130000	1324000	1.77		Hist	12/31/2019
JCDECAUX SA /FI	JCDXF	Common	6345372	-195043	195731000	18613000	1.5		Hist	12/31/2019
BROWN FORMAN CORP	BF.B	CL B	1721550	-81640	116377000	3173000	0.89	0.36	Hist	12/31/2019
ALTRIA GROUP, INC.	MO	Common	2221018	-1064876	110851000	-23542000	0.85	0.12	Hist	12/31/2019
VISA INC.	V	CL A	495011	-7569	93013000	6564000	0.71	0.02	Hist	12/31/2019
DIAGEO PLC	DEO	SPON ADR NEW	232405	-3565	39142000	556000	0.3		Hist	12/31/2019
AMERICAN EXPRESS CO	AXP	Common	131870	-5687	16416000	146000	0.13	0.02	Hist	12/31/2019



共現圖規劃

預期數據

	平均 股價 0~50	平均 股價 10~100	平均 股價 100~500	平均 股價 >500	股息 0%	股息 0~2%	股息 2~6%	股息 >6%
Apple Inc.	0	0	1	0	0	1	0	0
Alphabet Inc.	0	0	0	1	0	1	0	0
Loreal	0	0	1	0	0	0	1	0
Nestle SA	0	1	0	0	0	1	0	0
VISA Inc	0	0	1	0	1	0	0	0



討 論 狀 況

基本工作管理情况

開會
目前共開兩次會議，往後每周以投票方式決定例會議日期時間。

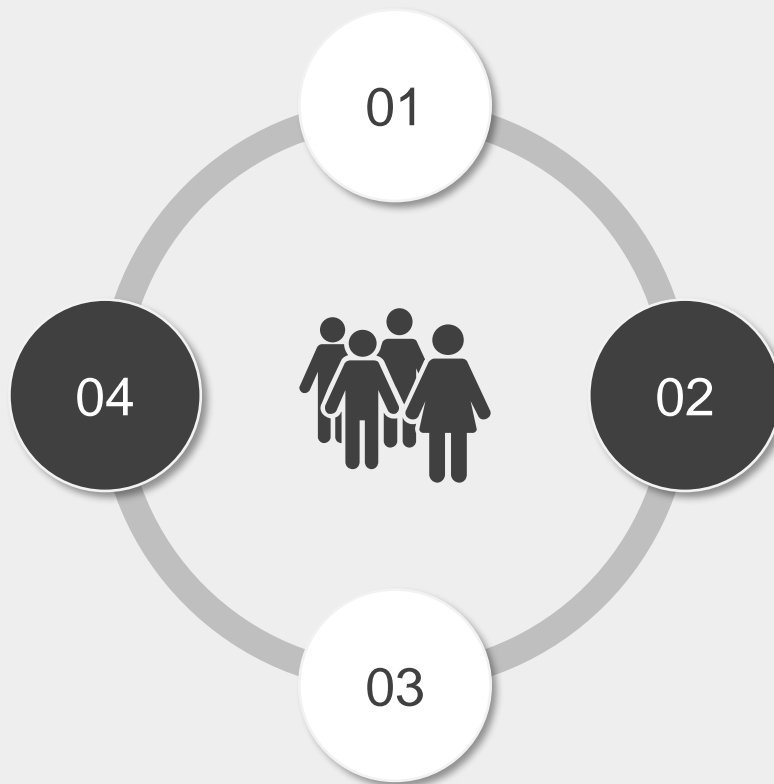
Trello

開始從大家都不熟悉，慢慢的會把要做的事情寫上去。

Github
目前只有我把我抓下的資料以及code上傳上去。

Line

Line上討論較為不為熟絡，通常只拿來約時間，然後在會議上討論。





研 究 方 向

研究 方 向



從各種維度指標中，找出其投資經理人的投資偏好。



加入其他資料擴大訓練與驗證，並加入其他影響因子，ex.時空

找資料設計因子

從文獻或網上資料設計投資因子。

共現圖分析因子



討論分析後結果

依照其程式結果做敘述說明與解釋。

不斷重複訓練、調整、加新因子





參考網址

參考網址



<https://www.rocketfinancial.com/>



<https://www.quandl.com/>



<https://rapidapi.com/>



<https://github.com/wellslu/CTBC-PROJECT>



<https://reurl.cc/62QIzV>



THANK YOU

