

一、

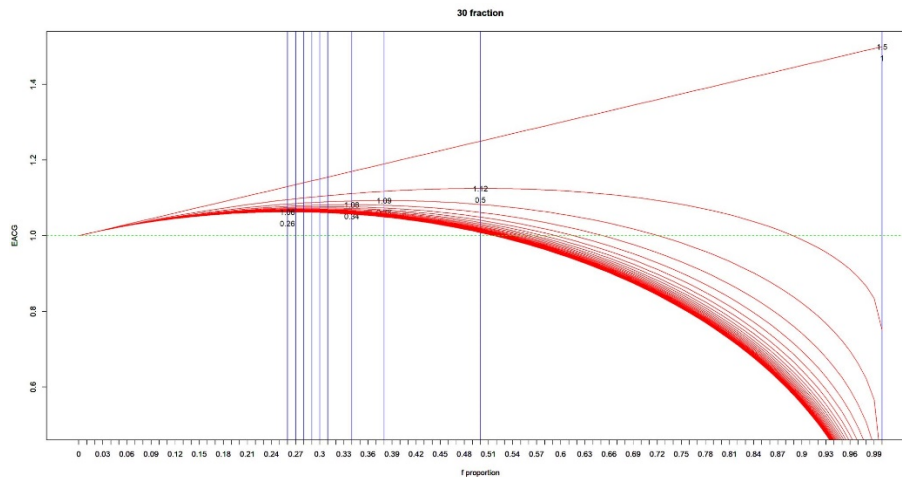
之前的作業是銅板賭局在

$p=0.5$

$b=2$

T =由 1 to 30，求 EACG

隨著玩的 T 局數愈來愈多，求得 EACG 的最佳下注比率 f 在這個情型之下由會往下收斂至 0.25，老師應該是藉著程式模擬 EACG，來近似凱利比例。



二、

這週作業我估算一般設計良好波段的交易策略勝率約有 0.4，賺賠比 3，得出以下的結果，在不同的 f 值之下，玩 1 次到玩 30 次的損益曲線圖。最佳的槓桿是開啟 2 倍的槓桿。在這個槓桿下，有最好的報酬。

這和之前昨業的不同處是這是對真實交易在 $p=0.4$ 、 $b=3$ 、對不同下注比率 f 的模擬，得出損益。

Opt F: 200%, WinRate: 40%, Wodds: 0.3 LOdds:-0.1

