

# HW4説明

截止日到3/27 00:00

# backtesting.py策略回測

- 多空當沖策略 多單空單都要寫, 改善上周策略
- 台指期 請確認回測績效 Max. Trade Duration <= 0 days 04:45:00
- 日盤
- 樣本內: 2022-03-13 ~ 2022-11-20 (8個月) 請注意回測時間1年, 時間請到2023-03-20
- 樣本外: 2022-11-13 ~ 2023-03-20 (4個月)
- 手續費: 百萬分之33 (原百萬分之2加20元)

# 注意事項

- 30秒K、1分K、5分K..... 都可以 **請注意策略設定, 可以參考範例檔**
- 起始資金:**50萬**, **一次下單數量200**, **槓桿20倍**, 同時只能持有一單
- 多空只能同時做一個方向
- 13:30強制平倉
- 使用Jupyter Notebook, 包含以下程式碼
  - 抓取歷史行情資料、資料處理
  - 策略部分(註解說明**技術指標、進出場條件**)
  - 回測部分(**圖、損益表**)

## 注意事項

- 另外繳交一份報告(請依照報告範例格式), 包含
  - 使用的技術指標說明
  - 策略做了哪些改善、效果如何
  - 策略進出場條件
  - 最後的損益圖(樣本內+樣本外)

# 注意事項

- # Trades
  - 至少 190次以上
- MDD(Max. Drawdown [%])
  - 至少  $> -15\%$
- Win Rate [%] 勝率
  - 至少  $> 30\%$
- Profit Factor 獲利因子
  - 至少  $> 1.4$
- SQN
  - 至少  $> 1.8$

完成注意事項70%(樣本內+樣本外)

策略績效30%

(取某一段時間, 排行 Return及Sharpe Ratio, 避免過度擬合)

# 繳交

- 3/27 00:00以前繳交，包含
  - 策略ipynb檔
  - 報告ppt轉pdf檔(請依照報告範例格式)
  - (老師有特別要求績效損益表除了樣本內+樣本外，也請一併貼上單純樣本外之績效)

# 策略檔說明

程式碼須包含

說明資料類型: 30秒K、1分K、5分K.....

說明資料時間: 日盤(8:45~13:45)、日盤+夜盤(8:45~13:45、15:00~5:00)

策略: 只要一支策略即可(讓助教可以直接回測)

助教會任取一段時間跑所有人的策略回測績效, 請確認上傳的是最新策略並且可以執行