

HW3説明

截止日到3/19 24:00

backtesting.py策略回測

- 多空當沖策略 多單空單都要寫, 可以延續上周策略
- 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 ~ 2022-11-13 (8個月) 請注意回測時間 1年
- 樣本外: 2022-11-13 ~ 2023-03-13 (4個月)
- 手續費: 百萬分之3 (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 180次以上
- MDD(Max. Drawdown [%])
 - 至少 < 20%
- Win Rate [%] 勝率
 - 至少 > 30%
- Profit Factor 獲利因子
 - 至少 > 1.2
- SQN
 - 至少 > 1.5

繳交

- 3/19 24:00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)