

HW6説明

截止日到5/15 00:00

backtesting.py策略回測

- 多空當沖策略
- 台指期
- 日盤
- 樣本內: 2022-05-08 ~ 2023-01-08 (8個月)
- 樣本外: 2023-01-08 ~ 2023-05-08 (4個月)
- 手續費: 百萬分之33

注意事項

- 30秒K、1分K、5分K..... 都可以
- 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(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
 - 使用日+夜盤資料績效如何
 - 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 120次以上
- MDD(Max. Drawdown [%])
 - 至少 $> -10\%$
- Win Rate [%] 勝率
 - 至少 $> 30\%$
- Profit Factor 獲利因子
 - 至少 > 1.4
- SQN
 - 至少 > 2

繳交

- 5/15 00:00以前繳交, 包含
 - 策略ipynb檔
 - 報告ppt轉pdf檔(報告範例格式)
 - (老師要求績效損益表除了樣本內+樣本外, 也附上單純樣本外
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