

HW2

截止日期到3/12 24:00

backtesting.py策略回測

- 多單當沖策略
- 台指期
- 日盤
- 樣本內: 2022-03-06 ~ 2022-11-06 (8個月)
- 樣本外: 2022-11-06 ~ 2023-03-06 (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
- 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，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

注意事項

- # Trades
 - 至少 140次以上
- Win Rate [%] 勝率
 - 至少 > 40%
- Profit Factor 獲利因子
 - 至少 > 1.5
- SQN
 - 至少 > 1.5

繳交

- 3/12 24:00以前繳交, 包含
 - 策略ipynb檔
 - 報告pdf檔