

小路金融實戰 | Lewis.Invest

— 績優量化交易策略 —

【策略概要】

本交易策略鎖定『基本面數據優異』的公司，以及『股價轉強的訊號』來增加投資效率，同時在歷史的量化驗證當中取得優異的投資績效且歷史行情中打敗加權指數報酬率。該策略屏除追逐市場熱門公司，依舊建構出不錯的報酬率。

透過系統化的選股與固定的交易方式，捕捉績優個股轉強且突破的交易機會根據歷史量化驗證，策略數據如下；其驗證期間為2016/01-2021/12

- ① 交易次數：97筆 | 勝率77.32%
- ② 單筆最大獲利率 +11.27%
- ③ 單筆最大虧損率 -8.99%
- ④ 最大連續虧損率(MDD) -11.86%



【策略邏輯說明】

基本面數據表現亮眼，共三個基本邏輯：

(一)公司透過本業獲利能力創近期新高

(二)公司實質獲利數字明顯增加

(三)公司產銷組合或商品附加價值創高，更有效率地把利潤提升

透過上述的選股濾網找出優質績優好公司後，同時考慮**技術面**因子：

(一)股價突破轉強訊號

(二)近期波動度維持低穩狀況

最後，進場策略以「特定交易時間進場」並「設置標準停利與停損比率」，
全程機械化操作完成交易策略。

【近期策略表現】 2021/9月起選出兩檔標的物

- 1229 聯華 | 09/07 策略選出，09/08操作，後續最高報酬率達**15.9%**
- 3188 鑫龍騰 | 09/13 策略選出，09/14操作，後續最高報酬率達**17.5%**



日期	名稱	價格/股數	應收付/損益
2021/09/14	鑫龍騰 現沖買		
委託單號： f0539		手續費：	
持有成本：		價金：	
幣別： 新台幣			
2021/09/14	鑫龍騰 現沖賣		
委託單號： f2226		報酬率： 6.63%	
手續費：		交易稅：	
持有成本：		價金：	
幣別： 新台幣			

| 本資料僅供教學研究參考，不構成任何買賣操作依據 |
投資人應自負盈虧風險，歷史數據並無法做為未來獲利的保證。