

小路金融實戰 | Lewis.Invest

一價值成長交易策略 策略說明一

【策略概要】

本策略主要鎖定『具備價值與獲利成長』作為標的，搭配籌碼參數進行隨機選取，有效率地提高策略來面對未來不確定性的行情；並且善用突破交易策略，設置合理的停利與停損，有著數量較多的交易次數，從歷史回測上可看到優異的勝率與累積報酬率。

在良好風險控制之下，都具備著良好的歷史回測數據，本策略優異表現如下，其驗證期間為2016/01-2021/12

- ① 交易次數：394筆 | 勝率70.05%
- ② 單筆最大獲利率 +14.71%
- ③ 單筆最大虧損率 -12.53%
- ④ 最大連續虧損率(MDD) -10.87%



【策略邏輯說明】

必要條件四項以及次要條件四項

■ 必要條件如下，必須完全符合

- (一)公司營運必須有獲利，且獲利數字明顯增加
- (二)公司實質獲利數字明顯增加
- (三)選擇Beta 值較低，與大盤波動度相比更加穩健
- (四)尋找有被低估可能的個股

■ 次要條件如下，必須至少符合其中一項

- (一)有大戶明顯持續加碼持股動作
- (二)觀察近期籌碼流進少數人手中
- (三)觀察近期投信開始布局
- (四)觀察近期外資開始布局

【策略交易SOP】

1. 選出符合「上述選股條件」的個股清單
2. 確認必要條件是否完全符合，且次要條件需至少符合一項
3. 特定交易時間進場，設置標準停利與停損比率
4. 機械化交易持續複製上述流程。

【近期策略表現】

2812 台中銀 | 01/05 盤後選出，01/06進場操作，01/11達到停利價格。



損益：6,883(台幣) 報酬率：% 筆數：2 (頁次 1/1)

商品	交易日期	類別	股數	價格	應收付
台中銀	2022/01/11	現賣	10,000	13.1	130,492
台中銀	2022/01/06	現買	10,000	12.35	-123,609

日期	名稱	價格/股數	應收付/損益
2022/01/11	台中銀	13.15	130,994
	普通賣出	10,000	7,389

| 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。

