

嘉實新金贏島

量化積木-操作說明

新金贏島量化積木-前言

- ❖ 之所以取名為「量化積木」，讓不會寫程式的各位可以把需要的條件組起來變成策略，就好像拼樂高積木一樣，把積木組起來之後就是一個很厲害的策略模型囉！



策略建構零門檻，再也不用寫程式



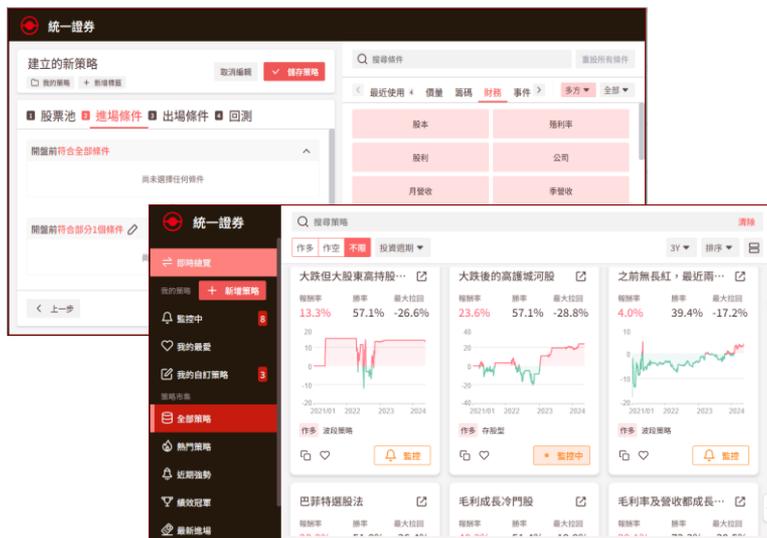
No code時代，免寫程式輕鬆回測



盤中監控最即時，雲端運算快又穩



條件組合積木化，十萬條件任你選



如何開啟量化積木-畫面介紹

- ❖ 如何開啟量化積木：[新金贏島](#)→資訊→量化積木。
- ❖ 量化積木畫面可分成3大部分，即時總覽、我的策略、策略市集。

The screenshot shows the 'Quantitative Building Blocks' (量化積木) interface. On the left, a navigation menu highlights '量化積木' (Quantitative Building Blocks). The main interface is divided into three main sections:

- 即時總覽 (Real-time Overview):** A callout box points to the '即時總覽' button, stating '即時總覽：當日監控中策略情形' (Real-time Overview: Daily monitored strategy status).
- 我的策略 (My Strategies):** A callout box points to the '我的策略' button, stating '管理我的策略' (Manage my strategies).
- 策略市集 (Strategy Market):** A callout box points to the '策略市集' button, stating '內建的策略市集' (Built-in strategy market).

The main content area displays a table of trading activities with the following columns: 價格 (Price), 預估損益 (Estimated P&L), 已實現損益 (Realized P&L), and 報酬率 (Return Rate). The table lists various trades for different stocks and strategies.

時間	股票	策略	操作	價格	預估損益	已實現損益	報酬率
12:57	營邦(3693)	近期持續強勢股階梯式上漲	買進	326.5	10,417	--	3.19%
12:49	順藥(6535)	近期持續強勢股階梯式上漲	賣出	186.5	--	1,625	0.88%
12:30	宇環(3276)	近期持續強勢股階梯式上漲	賣出	20.2	--	106	0.53%
12:08	亞泥(1102)	毛利成長冷門股	賣出	45.85	--	5,790	14.52%
12:05	順藥(6535)	近期持續強勢股階梯式上漲	買進	184	1,625	--	0.88%
11:34	恒耀(8349)	毛利成長冷門股	賣出	76.7	--	9,887	14.48%

如何建立新的策略-自訂方向、週期、商品

◆ 量化積木→即時總覽→①新增策略→②選方向、週期→③選商品。



如何建立新的策略-自訂進出場條件

◆ 4 自訂進場條件 → 5 自訂出場條件。

統一贏家

我的策略 + 新增標籤

取消編輯 儲存策略

1 股票池 2 進場條件 3 出場條件 4 回測

開盤前符合全部條件 共2個條件

多方 漲幅 >= 2%
中立 成交量 >= 100張

符合全部條件(And)

且

開盤前符合部分1個條件 例:可2擇1 共2個條件

中立 週成交量 >= 500張
多方 昨天KD黃金交叉

符合部分條件(Or)

且

盤中符合全部條件 共2個條件

中立 當日漲幅大於5%
多方 KD出現黃金交叉

符合全部或部分條件

< 上一步 下一步 >

搜尋條件 重設所有條件

最近使用 8 價量 籌碼 財務 事件 即時 多方 全部

< 漲跌幅

期別 最新一期 連續N期 至少M期 前N期 不符合 更多

漲幅 >= 2% 漲幅 < 2%

編輯參數條件 可以變更指標參數

跌幅 < 2%

漲幅 >= 2 %

連續 5 日漲幅 >= 2 %

最近 5 日內至少 3 日漲幅 >= 2 %

昨天 漲幅 >= 2 %

近5日累計漲幅 < 近5日平均漲幅 >

展開進階條件

取消 加入

如何建立新的策略-回測

- ❖ 6 執行回測 → 7 儲存策略。
- ❖ 若不符合預期就可以返回【上一步】，繼續修改策略，再次執行回測。

統一贏家

取消編輯 儲存策略

我的策略 基本面

7

1 股票池 2 進場條件 3 出場條件 4 回測

策略說明

此策略複製自 毛利成長冷門股

交易方向 作多
投資週期 中線
執行商品 上市櫃普通股
排除商品 KY個股

進場條件

開盤前符合全部條件

- 多方 收盤價 > 3日均線0%以上
- 多方 漲幅 >= 1%
- 中立 成交金額 >= 0.1億

< 上一步

回測區間 2022/01/01 - 2024/05/10

6

策略績效 交易記錄

報酬率 ROI	23.1% \$ 606.27萬	勝率	51%	交易筆數	4,843
最大拉回	-16% -\$349.15萬	風報比	1.44	最大投入 金額	\$ 2,624.82 萬



績效報告/策略績效
[詳細名詞&計算說明](#)

如何建立新的策略-複製修改公版策略

❖ ① 策略市集(挑選公版策略)→ ② 複製策略→ ③ 編輯→ ④ 修改條件/回測→ ⑤ 儲存成自己的策略。

統一證券

搜尋策略

作多 作空 不限 當沖 短線 中線 長線

千張大戶人數增加

報酬率 16.3% 勝率 85.7%

2024/02/05 04

複製策略

已成功建立"千張大戶人數增加-複製"

編輯策略 前往目錄 確定

複製成我的策略

低檔回升且外資投信同...

投信燒冷灶

報酬率 勝率 最大拉回

自訂策略

搜尋策略

作多 作空 不限 當沖 短線 中線 長線

3M 6M 1Y 2Y 3Y 88

我的策略

策略名稱	報酬率	勝率	最大拉回	操作
千張大戶人數...	--	--	--	尚未回測, 無資料
跌不下去的高...	--	--	--	

編輯

編輯策略

千張大戶人數增加-複製

我的策略 籌碼面

取消編輯 儲存策略

1 股票池 2 進場條件 3 出場條件 4 回測 5 儲存

4 修改條件

5 儲存

開盤前符合全部條件 共2個條件

多方 三大法人近1日買超佔成交量的20%以上

多方 1000張持大戶較上週增加5人

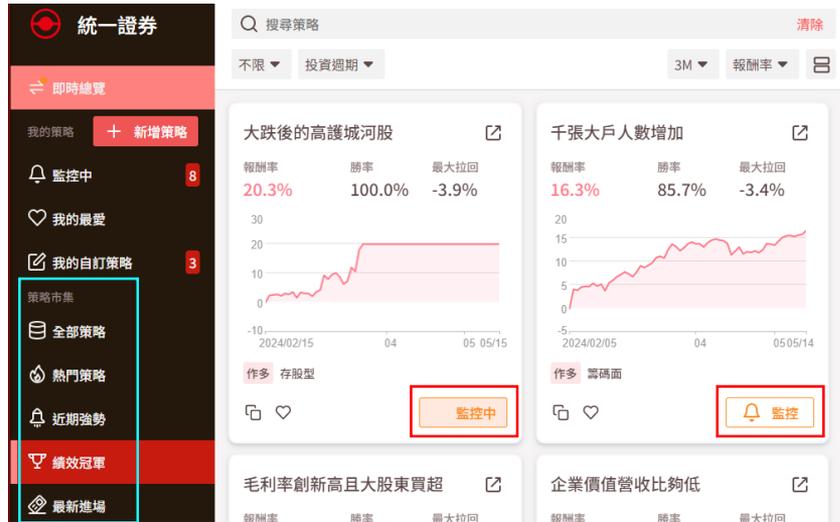
且

開盤前符合部分1個條件

尚未選擇任何條件

自訂的策略如何開啟監控？

1. 當我們已經自訂完自己的策略後，可以到【我的自訂策略】開啟【監控】，開啟監控後，若有觸發標的會在盤中通知。
2. 也可到策略市集有提供許多策略可以參考，點選右下方的【監控】即可訂閱。



監控中觸發的標的在哪查?

❖ 監控中觸發的標的可在哪查詢呢?

路徑1：量化積木→即時總覽→進出場明細。

商品	策略	下	價格	預估損益	已實現損益
營邦(3693)	近期持續強勢股階梯...	買進	326.5	953	--
順藥(6535)	近期持續強勢股階梯...	賣出	186.5	--	1,625
久威(6114)	毛利成長冷門股	賣出	26.4	--	(-3,0...
宇環(3276)	近期持續強勢股階梯...	賣出	20.2	--	106
亞泥(1102)	毛利成長冷門股	賣出	45.85	--	5,790
順藥(6535)	近期持續強勢股階梯...	買進	184	已實現 1,625	--

路徑2：新金贏島→資訊→警示中心→即時監控。

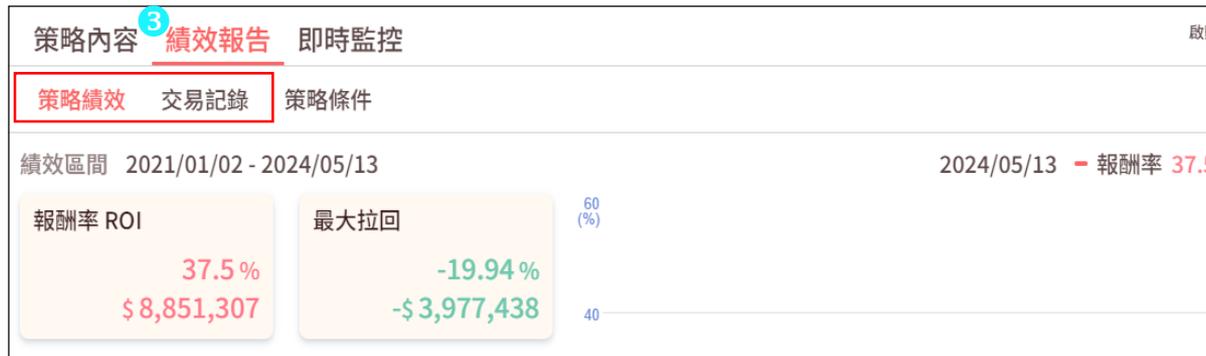
商品	觸發時間	成交	漲跌	單量	警示名稱
是方	11:43:00	346.5	▼ 9.50	--	(系統)毛利成長
恒耀	10:34:00	76.7	▲ 2.60	--	(系統)毛利成長
固緯	10:01:00	42.30	▼ 1.50	--	(系統)毛利成長
聯光通	09:59:00	20.50	▲ 1.65	--	(系統)毛利成長
宇環	09:51:00	20.00	▲ 0.15	--	(系統)近期持續
高僑	09:50:00	26.60	▼ 0.60	--	(系統)毛利成長
建榮	09:47:00	50.6	▼ 1.40	--	(系統)毛利成長
長榮航太	09:36:00	112.0	▲ 1.50	--	(系統)近期持續
旭軟	09:29:00	29.20	▲ 0.75	--	(系統)近期持續
中光電	09:27:00	98.5	▲ 2.60	--	(系統)近期持續
中光電	09:22:00	97.1	▲ 1.20	--	(系統)近期持續

策略詳細資訊-績效報告

❖ 量化積木 → ① 監控中 → ② 策略詳細資訊 → ③ 績效報告。

策略名稱	報酬率	勝率	最大拉回	交易時間
統一贏家	37.5%	51.2%	-19.9%	12:49 買出-晶達
毛利成長冷門股	38.6%	51.1%	-19.9%	12:49 買出-晶達

❖ 績效報告包含【策略績效】、【交易紀錄】可做運用。



績效報告/策略績效
詳細名詞&計算說明

策略詳細資訊-即時監控

- ◆ 即時監控包含【進出場明細】、【持有商品】、【平倉紀錄】。

策略內容 績效報告 **即時監控**

進出場明細 持有商品 平倉記錄

交易損益	累計損益
當日已實現+未實現損益加總	2021/1/2至今已實現損益加總
\$ 22,252	\$ 8,964,921

持有商品	投入金額
267 檔	目前持有商品投入總金額
	\$ 21,804,770

當日買進	當日賣出
20 檔	12 檔

策略內容 績效報告 **即時監控**

進出場明細 **持有商品** 平倉記錄

未實現損益	累計損益
當日未實現損益加總	
-\$ 415	\$ 8,964,921

持有商品	投入金額
267 檔	\$ 21,804,770

當日買進	當日賣出
20 檔	12 檔

策略內容 績效報告 **即時監控**

進出場明細 持有商品 **平倉記錄**

平倉損益	累計損益
當日已實現損益加總	
\$ 42,226	\$ 8,964,921

持有商品	投入金額
267 檔	\$ 21,804,770

當日買進	當日賣出
20 檔	12 檔

Q&A

◆ 問：量化積木可以自動下單嗎？

答：現階段尚未支援自動下單，不過可以盤中即時監控策略。👉 [如何監控](#)

◆ 問：請問可以回測期貨或股票期貨商品嗎？

答：現階段尚未支援期貨以及股期，後續優化。

◆ 問：量化積木的回測區間有多長？

答：目前量化積木回測區間是3年。

◆ 問：量化積木跟其他選股方式有何不同？

	 量化積木	雲端策略	贏家選股
盤中即時選股	✓	✓	
盤後選股	✓		✓
盤中警示提醒	✓	✓	
自訂參數/條件	✓		✓

附件1-績效報告→策略績效/回測報告-意義

- ◆ **報酬率ROI**：像看你投了多少錢，最後能賺回多少。就是把你每筆交易的損益加起來，這個數字占投入的總金額的百分比。
- ◆ **最大拉回**：從最高點到最低點的那段距離，有兩種算法：一種是用金額算，一種是用百分比算。
- ◆ **勝率**：出手獲利次數佔總交易筆數的百分比。
- ◆ **風報比**：衡量投資報酬和所承擔風險的比值，數值越高，代表著相對於承受的風險，獲得了更多的回報。
- ◆ **交易筆數**：總共做了多少筆交易。
- ◆ **最大投入金額**：回測期間投入的總資金。



附件2-績效報告→策略績效/回測報告-計算方式

名詞	計算說明
報酬率ROI	金額：每筆損益金額加總 百分比%：每筆損益金額加總/最大投入金額
最大拉回	金額：每日累加淨利變化，依時間序列將淨利高峰-淨利谷底 百分比%：每日累加淨利變化，依時間序列將(淨利高峰/最大投入金額)-(淨利谷底/最大投入金額)
勝率	獲利交易次數 / 總交易次數
風報比	報酬率%/最大拉回%
交易筆數	總交易次數
最大投入金額	回測區間資金最大投入
近半月報酬率	報酬曲線上%·本月份-上月份 Ex.12月報酬：12月月末報酬率-11月月末報酬率
損益計算方式	交易數量1張；手續費6折；進場價即時條件以分K收盤價進場， <u>盤後條件</u> 以分K開盤價進場；出場價以分K收盤價進場

名詞	計算說明
利潤統計	百分比為除以初始資金 淨利：每筆損益金額加總 毛利：每筆獲利金額加總 毛損：每筆虧損金額加總 獲利因子：毛利/毛損*淨利
交易次數統計	總交易次數：交易總筆數 獲利交易次數：交易獲利筆數 虧損交易次數：交易虧損筆數
平均統計	平均交易：淨利/總交易次數 平均獲利交易：毛利/獲利交易次數 平均虧損交易：毛損/虧損交易次數 平均獲利虧損比：平均獲利交易/平均虧損交易
最大交易統計	最大獲利交易：單筆交易獲利金額最大 最大虧損交易：單筆交易虧損金額最大

簡報結束，請多指教



統一綜合證券股份有限公司
PRESIDENT SECURITIES CORPORATION