

策略交易平台使用手冊

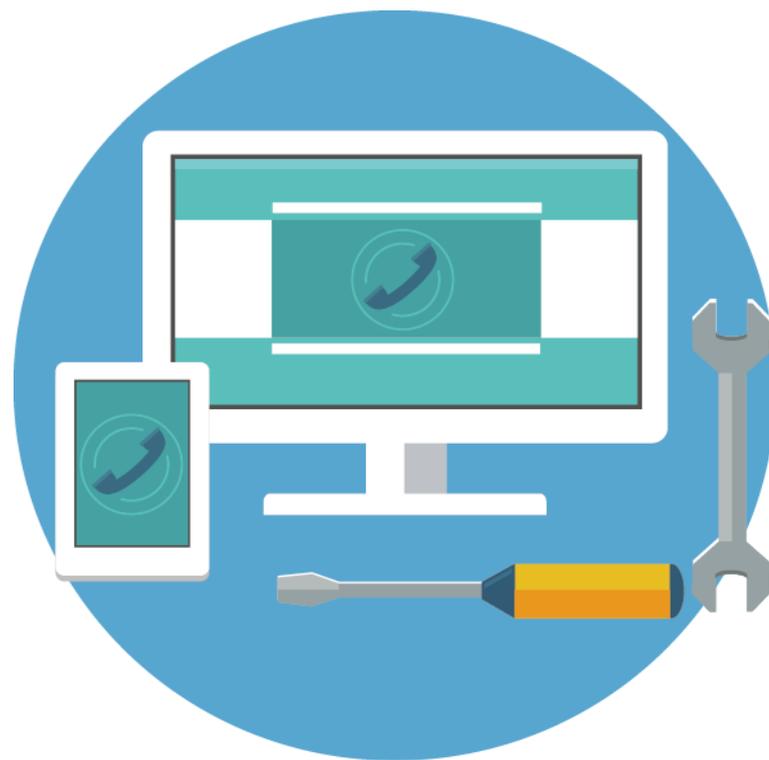


我們有策略交易囉！
使用前請參閱使用手冊

目錄索引

1. 如何開始.....	3
• 系統簡介.....	4
• 系統特色.....	5
• 啟動策略平台.....	9
• 版面介紹.....	11
2. 功能介紹.....	18
• 策略回測.....	19
• 自訂策略.....	24
• 精簡模式.....	27
• 策略明細.....	29

系統簡介





系統簡介

元大證券推出「策略交易平台」，提供投資人數十種交易策略，透過簡單三步驟，幫助投資人輕鬆篩選標的，並抓住投資時機：

- 1、策略交易平台提供豐富的回測資訊，大量使用圖像化方式呈現，讓人一目了然，投資人可參考策略的勝率、期間長短、指標等，自行選擇喜愛的策略。
- 2、投資人可自行調整策略參數及股票做回測驗證，亦可儲存成自己的專屬策略（限符合資格投資人）。
- 3、透過監控功能，當標的符合「觸發進場」或「觸發出場」條件時，系統將自動發送訊息提醒投資人，再也不怕錯過買賣點。

“Pro級股市玩家 投資也能開外掛”

投資警語

此分析僅係過去績效數據回測之結果，不代表未來報酬表現，投資人應獨立判斷，審慎評估並自負投資風險及盈虧。





客戶權限說明

客群分類	可用平台	策略數量	自訂策略 (回測、監控、儲存)
交易10筆(含)以上 (日線)	AP/APP	15	5組
交易10筆以下 (日線)	APP	2	X



系統特色





系統特色

1 具有專業的策略團隊，
提供**多種頂尖策略**，
任您挑選。

系統擁有最專業的策略開發團隊、豐富的投資know-how，
可提供數十種優質投資策略組合供您參看與選擇。



2 您可以**自由地調整參數**，
設定成您的專屬策略。

可隨時自由調整策略參數，並立即回測驗證，儲存成
您自己的專屬策略！





系統特色

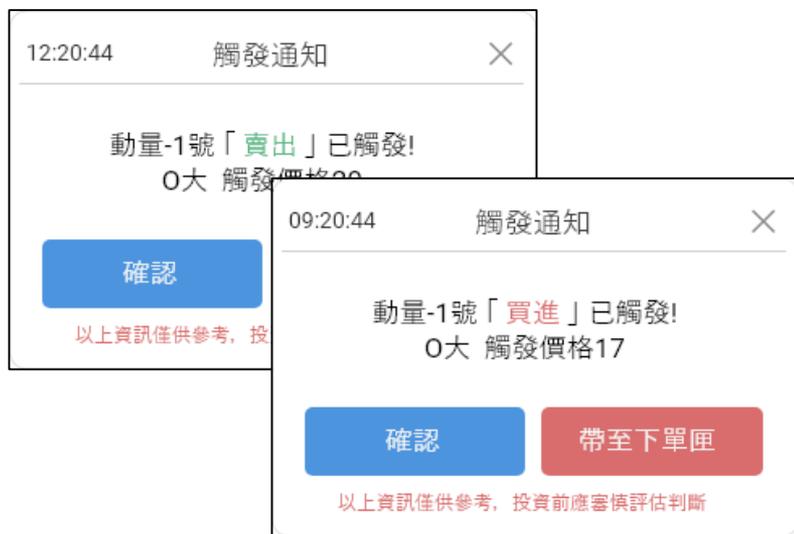
3 擁有極豐富的回測內容與資訊。

提供該策略的報酬曲線、買賣點、策略五力分析等，具豐富多元的回測資訊。



4 當股票觸發選定或儲存之策略條件時，即時通知!

即時自動發送進出場訊息，再也不用怕錯過買賣點!





系統特色

5 雲端策略，跨平台提供服務！

點金靈AP / 越是贏AP / 投資先生APP



“不只是一個交易平台，更是您的策略規劃師”



啟動策略平台



[越是贏安裝說明](#)



[點金靈安裝說明](#)



如何啟動策略平台



越贏策略交易平台啟動位置



點金靈策略交易平台啟動位置

1. 開啟「越贏」或「點金靈」系統並登入。
2. 點選功能列上方的「策略交易平台」文字，即可進入該系統。



版面介紹





版面介紹

The screenshot shows the 'Strategy Center' (策略中心) interface. It is divided into several main sections:

- Strategy Area (策略區):** A grid of strategy cards. Each card displays the strategy name (e.g., BB-1號, KD-1號), win rate (e.g., 48.13%), annualized return rate (e.g., 9.39%), and total return rate (e.g., 28.19%). It also shows a star rating and a 'Monitor' (監控) button.
- Monitoring Area (監控區):** A table on the right side titled 'Strategy Monitoring' (策略監控). It lists monitored strategies, the corresponding stock (e.g., 漢來美食, 豐泰), and the estimated profit/loss (e.g., --, --, -351).
- Backtest Information Area (回測資訊區):** A detailed view for a specific strategy (隔日沖-5號). It shows historical win rate (61.33%), total transactions (1735), and a radar chart comparing performance metrics like 'Score Speed' (得分雷達), 'Return Curve' (報酬曲線), 'Stability' (穩定性), and 'Safety' (安全性).
- Order/Return Area (下單/回報區):** Located at the bottom right, it contains buttons for 'Place Order' (下單交易) and 'Commission Report' (委託回報).

Annotations in yellow text are placed over the interface to identify these four main functional blocks: 策略區, 回測資訊區, 監控區, and 下單/回報區.

策略交易平台之主版面可分為「策略區」、「回測資訊區」、「監控區」及「下單/回報區」四大區塊





版面介紹-策略區

策略卡牌以區塊呈現重要資訊

(勝率、報酬率、評等、期間)

1. 預設顯示全部策略，可自行切換「多方」、「空方」、「收藏」及「自訂」

2. 客戶可切換排序規則 (權限、期間、評等、勝率)

3. 點選「」可切換策略區塊呈現或條列呈現

4. 點選「」快速加入喜好收藏

5. 點選「」可接收推播訊息

6. 從五大面向進行策略評等，並以「」呈現 (滿分:五顆星)

The screenshot shows the 'Strategy Center' (策略中心) interface. It features a grid of strategy cards and a detailed view for a selected strategy. Numbered callouts highlight the following elements:

- 1:** Filter tabs at the top: 全部 (All), 多方 (Long), 空方 (Short), 收藏 (Favorites), 自訂 (Custom).
- 2:** Sort and Limit dropdown menus.
- 3:** Grid/List view toggle icon.
- 4:** Heart icon for adding to favorites.
- 5:** Monitor/Unmonitor button.
- 6:** Star rating system for strategy evaluation.

The detailed view for '隔日沖-5號' (Overnight Reversal - 5 days) includes:

- Historical Win Rate: 61.33%
- Total Trade Count: 1735
- Profit Count: 1064
- Loss Count: 671
- Profit Factor: 1.95
- Annualized Return Rate: 42.53%
- Maximum Continuous Profit Count: 58
- Maximum Continuous Loss Count: 24
- Maximum Continuous Loss Rate: -0.97%
- Maximum Simultaneous Holdings: 104

Strategy Conditions (策略條件):

- 商品標的: 1.上市權(排除ETF、與權)
- 2.上個月日平均交易量 >= 1500 張
- 週期: 5分鐘
- 回測區間: 3個月
- 交易成本(單邊): 0.2%



版面介紹-回測資訊區



依所選擇的策略提供相關資訊

1. 策略回測資訊 (勝率、獲利次數、虧損次數等)
2. 策略內容說明 (標的、週期、策略指標)
3. 「設定」按鈕可進行策略參數編輯與儲存
4. 可選擇「得分雷達」或「報酬曲線」；雷達圖呈現五大面向計算的策略評等 (報酬率、勝率、穩定性、安全性、獲利因子)；報酬曲線提供策略報酬與大盤報酬的比較
5. 點選「」該區塊放大至滿版，可查詢策略歷史進出場明細



版面介紹-回測資訊區



回測資訊區

承上頁，頁面放大後提供該策略完整資訊，說明如下：

1. 該策略歷史進出場明細 (進出場日期、進出場價位、損益等)
2. 可選擇「報酬率分佈」及「報酬曲線圖」
3. 標示該策略觸價買賣點位置
4. 點選「米」縮小該區回復至初始版型
5. 點選「商品異動」，展開該策略的商品標的異動清單(依照不同策略，可能每季(每月)調整商品標的範圍。





版面介紹-監控區

策略中心 策略交易平台

全部 多方 空方 收藏 自訂 排序 權限

策略監控

已監控 BB-1號 全部

訊號/條件	商品	觸發出場	預估損益
BB-1號	漢來美食	--	--
BB-1號	豐泰	--	--
BB-1號	台玻	--	-351
BB-1號	寶成	--	-600
BB-1號	聯強	--	-664
BB-1號	僑豐	--	-15,136
BB-1號	聯電	--	16
BB-1號	漢唐	--	-8,083
BB-1號	中光電	--	-1,918
BB-1號	生泰	88.10	-1,543
BB-1號	英業達	--	-1,681
BB-1號	全家	--	-5,809
BB-1號	日友	--	670
BB-1號	兆利	70.90	5,057
BB-1號	艾訊	--	-87
BB-1號	大成	--	2,075
BB-1號	佳格	--	628
BB-1號	和大	--	-7,522
BB-1號	華邦電	--	-867
BB-1號	神基	--	-1,618
BB-1號	鴻碩	--	-1,515
BB-1號	世界	--	-707
BB-1號	大江	265.00	-20,882
BB-1號	富邦媒	--	-97,730
BB-1號	臻鼎-KY	--	--
BB-1號	凡甲	--	-4,481
BB-1號	群創	--	-142

9887-9 xxxx 4 李 00 午安! 下單交易 委成回報 版本: 4.2020.716.0 連線狀態 14:44:00

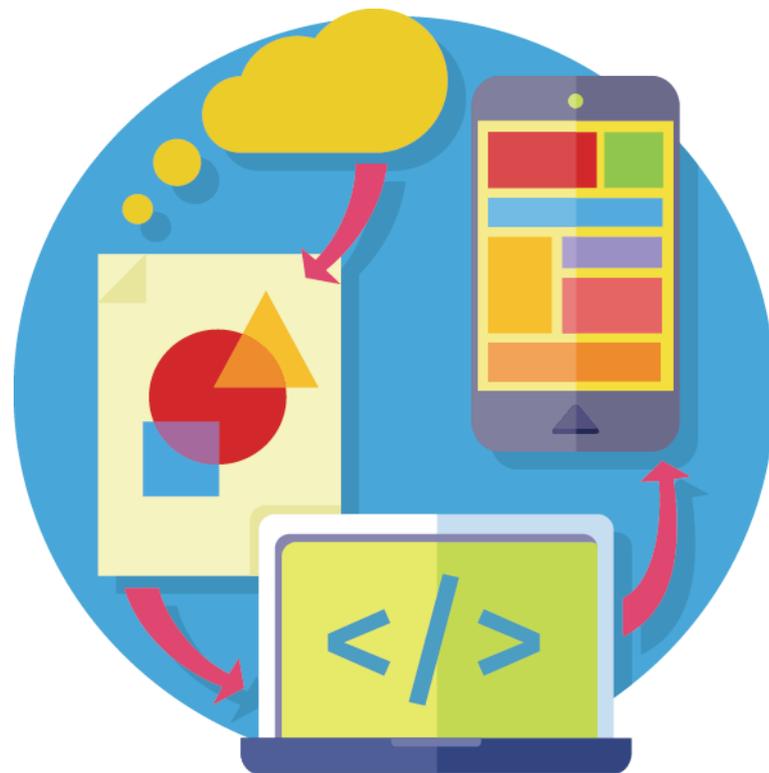
即時監控策略，掌握買賣點，盤中即時洗價，計算預估損益

1. 點選「🔔」可以關閉推播通知
2. 可擇「全部」、「已監控」及「未監控」策略進行策略監控
3. 即時監控策略，觸發個股若為庫存股，股名將用黃色提示
4. 點選「🔍」該區塊放大至滿版

功能介紹



策略回測





策略回測-進入回測設定

雙擊卡牌

策略名稱	勝率	年化報酬率	總報酬率	狀態
MA-1號	53.61%	7.97%	23.92%	監控中
KD-1號	50.27%	6.87%	20.63%	未監控
能量-1號	47.71%	6.32%	18.97%	監控中
動量-1號	45.67%	6.18%	18.54%	未監控
RSI-1	48.92%	5.63%	16.90%	未監控
D-1號	48.92%	5.59%	16.78%	監控中
TS-1號	36.71%	4.69%	14.07%	監控中
BB-2號	42.31%	1.81%	1.81%	未監控
MA-2號	-	-	-	-
MACD-2號	-	-	-	-
KD-2號	-	-	-	-
動量-2號	-	-	-	-

MA-1號 設定

歷史勝率: 53.61% | 總報酬率: 23.92% | 得分雷達

總交易次數: 1869 | 獲利次數: 1002

虧損次數: 867 | 獲利因子: 1.63

年化報酬率: 7.97% | 最大獲利次數: 22

最大連續獲利(%): 1.73% | 最大虧損次數: 40

最大連續虧損(%): -3.05% | 最大同時持有檔數: 136

策略條件: 1. 進場; (1) 收盤價 > 5日日均收向上



1. 策略選擇

全部 | 全部 | MA-1號

進場策略: 收盤價交叉 5

日均收向上

進場策略: 5 日均收 > 12

日均收且 12 日均收 > 25 日均收

出場策略: 收盤價交叉 5

2. 回測設定

1. 交易方向: 多方

2. 週期: 天

3. 回測/監控範圍: 商品 0

4. 開始日期: 2019/6/4

5. 結束日期: 2020/6/4

6. 觸發進場: 次期開盤價

7. 觸發出場: 次期開盤價

8. 交易成本(單邊): 0.25 %

3. 回測結果

回測區間: 2017/06/04~2020/06/04

報酬曲線圖

勝率: 53.61%

總報酬率: 23.92%

總交易次數: 1869

獲利次數: 1002

虧損次數: 867

獲利因子: 1.63

年化報酬率: 7.97%

最大獲利次數: 22

最大虧損次數: 40

最大連續獲利(%): 1.73%

最大連續虧損(%): -3.05%

策略名稱: 自訂MA-1號

2. 進入該策略回測設定

1. 雙擊策略卡牌或點擊 [設定]





策略回測-策略選擇

策略選擇



1. 策略選擇

1 全部 ▾ 全部 ▾ MA-1號 ▾

2 進場策略：收盤價交叉 5

日均收向上

進場策略：5 日均收 > 12

日均收且 12 日均收 > 25 日均收

出場策略：收盤價交叉 5

日均收向下

3 停利 / 停損

停利 10 % ON

停損 10 % ON

4 還原條件 清空條件

1. 策略提供多方、空方及短、中、長期
2. 可自行調整進、出場策略參數
3. 設定停損和停利參數，開啟or關閉通知
4. 還原所有策略參數至預設值，或清除所有策略參數預設值





策略回測-回測設定

回測設定



2.回測設定

1.交易方向 多方

2.週期 天

3.回測/監控範圍 商品 0

4.開始日期 2019/6/4

5.結束日期 2020/6/4

區間依選擇週期最多提供近1000根K棒

6.觸發進場 次期開盤價

7.觸發出場 次期開盤價

進/出場價格依週期提供方式不同

8.交易成本(單邊) 0.25 %

開始回測

1. 點擊[商品]，選取想要回測的商品(最多50檔)
2. 點選[日期]，可以調整回測區間
3. 選取次期開盤價或當期收盤價當作進出場價格
4. 點選[交易成本]，可以設定每次進出場的
交易成本(單邊)



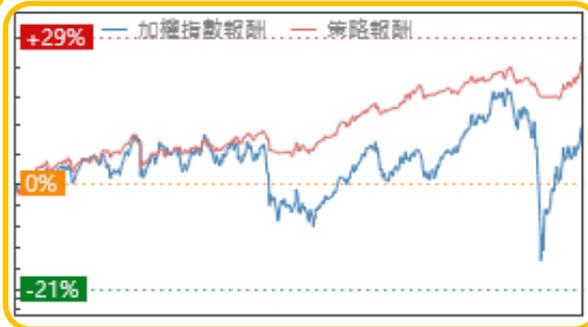


策略回測-回測結果

3.回測結果

回測區間:2017/06/04~2020/06/04

1 報酬曲線圖



2

勝率	53.61%
總報酬率	23.92%
總交易次數	1869
獲利次數	1002
虧損次數	867
獲利因子	1.63
年化報酬率	7.97%
最大獲利次數	22
最大虧損次數	40
最大連續獲利(%)	1.73%
最大連續虧損(%)	-3.05%



1. 依回測參數設定，提供大盤指數與自訂策略

報酬率曲線比較圖

2. 提供基本的回測數據，包括勝率、總報酬率、

總交易次數等資訊，如果想看更詳細的買賣點，

可以儲存自訂策略後至策略明細查詢



完成回測之策略，可才儲存成自訂策略。



自訂策略

(限符合資格之投資人)





自訂策略-編輯自訂策略

1. 點擊 [編輯] 開啟策略參數設定
 2. 選取策略，可自行調整參數及回測內容，開始進行回測。
 3. 回測完成後，才可以儲存為自己的策略。
- (下一頁有更詳細儲存策略說明喔~)



※注意! 策略需回測後，才能儲存成自訂策略





自訂策略-儲存策略

1. 策略選擇

全部 全部 自訂MA-1號

進場策略: 收盤價交叉 5

日均收向上

進場策略: 5 日均收 > 12

日均收且 12 日均收 > 25 日均收

出場策略: 收盤價交叉 5

停利 / 停損

停利 10 % ON

停損 10 % ON

請原條件 清空條件

2. 回測設定

1. 交易方向 多方

2. 週期 天

3. 回測/警示範圍 交易 共7檔

4. 開始日期 2019/3/1 (15)

5. 結束日期 2020/3/1 (15)

6. 進場價格 次期開盤價

7. 出場價格 次期開盤價

8. 交易成本 0.2 %

開始回測

3. 回測結果

回測區間: 2019/03/01 - 2020/03/01

報酬曲線圖

47.83%

勝率 10.61%

總交易次數 23

獲利次數 11

虧損次數 12

獲利因子 2.88

平均報酬率 10.58%

最大獲利次數 3

最大虧損次數 6

最大連續獲利(%) 5.09%

最大連續虧損(%) -2.90%

策略名稱 自訂MA-1號 儲存

儲存策略

策略1

策略2

策略3

策略4

策略5

*選擇策略後將覆蓋原設定

完成

監控商品選擇

監控範圍限已回測商品(7)

全選	代碼	名稱
<input type="checkbox"/>	1101	台泥
<input type="checkbox"/>	1102	亞泥
<input type="checkbox"/>	1104	環泥
<input type="checkbox"/>	1108	幸福
<input type="checkbox"/>	1110	東泥
<input type="checkbox"/>	1103	嘉泥
<input type="checkbox"/>	1109	信大

監控商品(0)

全刪	代碼	名稱
----	----	----

完成

1. 可自行調整參數及調整策略名稱後做[儲存]

※注意! 策略需回測後, 才能儲存成自訂策略

2. 選取欲取代的策略, 按[完成]進行儲存

※注意! 取代策略後, 將覆蓋原設定

3. 儲存策略後, 可以選擇想要監控的商品, 往後就能收到最即時的訊號推播了。

※監控商品數量上限為30檔



精簡模式





回測設定-精簡模式

完整模式

1



1. 點選[精選模式]按鈕，策略監控區將縮成

精簡模式

2. 調整透明度

3. 開啟or關閉釘選視窗在最上層

4. 切換為完整模式

5. 將精簡模式隱藏至工具列

6. 雙擊監控策略股名or價格，可以連動

至「越是贏」及「點金靈」進行交易

精簡模式



策略明細





策略明細

MA-1號 區間 2017/06/04-2020/06/04 ★★★★★ 多方 中長線 監控中

歷史勝率 53.61% 總報酬率 23.92%
 總交易次數 1869 獲利次數 1002
 虧損次數 867 獲利因子 1.63
 年化報酬率 7.97% 最大獲利次數 22
 最大連續獲利(%) 1.73% 最大虧損次數 40
 最大連續虧損(%) -3.05% 最大同時持有檔數 136

策略條件：
 1. 商品標的：1.0050,0051成份股
 2. 上櫃治理公司成份股
 週期：日線
 回測區間：3年
 交易成本(損益)：0.25%
 主要參考指標
 1. 進場
 (1)收盤價成交5日均收向上

1. 點擊 可以展開策略明細

策略中心 MA-1號 回測區間 2017/07/16-2020/07/16 ★★★★★ 多方 中長線 未監控

2. 點擊[設定]，可以開啟該策略參數與回測參數設定

3. 提供策略投資明細及相關回測績效

明細	股票代碼	股票名稱	總交易次數	勝率	獲利次數	虧損次數	總報酬率	平均報酬率
<input type="checkbox"/>	9945	潤泰新	11	54.54%	6	5	96.68%	8.79%
<input type="checkbox"/>	8454	富邦煤	9	88.88%	8	1	92.76%	10.31%
<input type="checkbox"/>	2404	漢唐	11	81.81%	9	2	86.43%	7.86%
<input type="checkbox"/>	2454	聯發科	13	69.23%	9	4	84.17%	6.47%
<input type="checkbox"/>	2313	華通	8	87.50%	7	1	83.17%	10.40%
<input type="checkbox"/>	3105	慧懋	7	85.71%	6	1	74.22%	10.60%
<input type="checkbox"/>	2207	和泰車	14	71.42%	10	4	69.80%	4.99%
<input type="checkbox"/>	6269	台郡	9	88.88%	8	1	69.77%	7.75%
<input type="checkbox"/>	5483	中美品	10	80.00%	8	2	67.18%	6.72%
<input type="checkbox"/>	5347	世界	10	70.00%	7	3	66.08%	6.61%
<input type="checkbox"/>	3218	大華光	10	70.00%	7	3	65.05%	6.50%
<input type="checkbox"/>	1229	聯華	12	66.66%	8	4	64.63%	5.39%
<input type="checkbox"/>	6669	緯穎	8	75.00%	6	2	64.43%	8.05%
<input type="checkbox"/>	4974	亞泰	11	63.63%	7	4	63.10%	5.74%
<input type="checkbox"/>	1210	大成	11	90.90%	10	1	58.28%	5.30%
<input type="checkbox"/>	3034	聯詠	15	66.66%	10	5	57.56%	3.84%

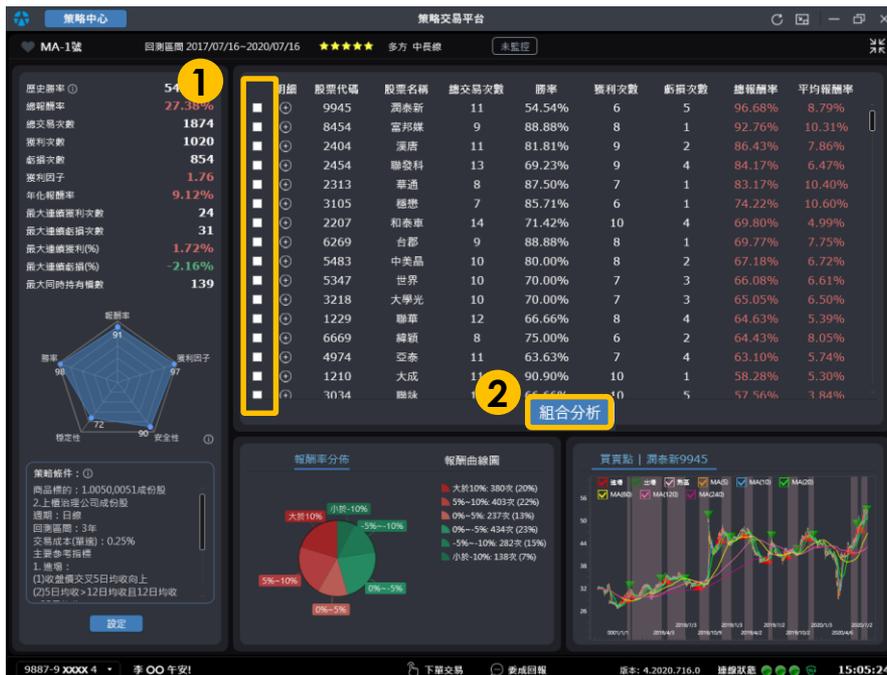
4. 提供「報酬率分佈」與「報酬曲線圖」

5. 提供策略買賣點，滑鼠滾輪縮放大小，長按滑鼠左鍵拖拉來左右移動視窗

1. 點擊 可以展開策略明細
2. 點擊[設定]，可以開啟該策略參數與回測參數設定
3. 提供策略投資明細及相關回測績效
4. 提供「報酬率分佈」與「報酬曲線圖」
5. 提供策略買賣點，滑鼠滾輪縮放大小，長按滑鼠左鍵拖拉來左右移動視窗



策略明細-組合分析



1. 勾選想要進行組合分析的個股

2. 點擊[組合分析]，進行組合分析

3. 呈現組合分析後的策略報

酬曲線與簡單的回測績效



策略明細-買賣點

1

明細	股票代碼	股票名稱	總交易次數	勝率	獲利次數	虧損次數	總報酬率	平均報酬率
+	8454	富邦媒	9	88.88%	8	1	92.76%	10.31%
+	2313	華通	8	87.50%	7	1	83.81%	10.48%
+	2404	漢唐	12	75.00%	9	3	78.95%	6.58%
+	2454	聯登科	15	60.00%	9	6	78.04%	5.20%
+	6176	瑞儀	12	58.33%	7	5	70.56%	5.88%
+	3105	穩懋	7	85.71%	6	1	68.72%	9.82%
+	3218	大學光	10	70.00%	7	3	65.05%	6.50%
+	6669	緯穎	8	75.00%	6	2	64.43%	8.05%
+	3023	信邦	11	72.72%	8	3	60.92%	5.54%
+	1210	大成	12	83.33%	10	2	59.95%	5.00%
+	6269	台郡	8	87.50%	7	1	57.22%	7.15%
+	5347	世界	8	75.00%	6	2	56.85%	7.11%
+	3211	順達	12	66.66%	8	4	56.19%	4.68%
+	8436	大江	11	63.63%	7	4	54.62%	4.97%

組合分析



1. 點擊投資策略明細後，下方圖會帶出策略觸發的買賣點

縮放圖表：滑鼠滾輪
左右移動：長按滑鼠左鍵拖拉

2

明細	股票代碼	股票名稱	總交易次數	勝率	獲利次數	虧損次數	總報酬率	平均報酬率
+	8454	富邦媒	9	88.88%	8	1	92.76%	10.31%

進場時間	進場價格	出場時間	出場價格	持有區間	區間報酬率
2020/05/04	482.00	2020/05/08	571.00	4	17.92%
2020/02/11	319.00	2020/02/18	373.50	7	16.54%
2019/11/14	279.00	2020/02/03	312.00	81	11.30%
2019/09/05	260.00	2019/11/07	287.00	63	9.86%
2019/02/21	242.00	2019/04/12	275.00	50	13.10%
2019/01/24	216.00	2019/02/13	233.00	20	7.35%
2018/11/16	189.50	2019/01/18	209.00	63	9.76%
2018/01/16	227.50	2018/01/31	255.50	15	11.78%
2017/08/10	218.00	2017/08/28	208.50	18	-4.85%

+	2313	華通	8	87.50%	7	1	83.81%	10.48%
+	2404	漢唐	12	75.00%	9	3	78.95%	6.58%

組合分析



2. 點擊 展開策略買賣點明細

3. 點擊買賣點明細，下方圖會標出該次進出場位置



END

Thanks!