

# 「第三屆高雄盃程式交易競賽」細則說明

## 一、細則：

1. 程式策略建構僅可使用主辦單位提供之資料。
2. 請依照規定的格式，紀錄所有交易紀錄、各項評比指標。
3. 程式語言請使用 python3.6.X 或 3.7.X 版本，需要安裝特殊套件時，請事先聯絡主辦單位進行溝通，程式無法進行測試時，參賽者須自行負責。
4. 程式與書面報告產生之交易紀錄、評比指標需一致，不一致時將取消參賽資格。
5. 計算績效指標時不考慮交易成本，但評審會根據交易次數自行衡量交易成本。
6. 最後交易日，請強制平倉所有部位以進行績效結算

## 二、日內資料欄位說明

### 1. ETF

#### 1-1. 成交資訊（日期\_Match.txt）

資料欄位：成交時間，商品代碼，成交價格，成交量，累計成交量。

#### 1-2. 委託資訊（日期\_Order.txt）

資料欄位：資料時間，商品代碼，下一檔價，下一檔量，下二檔價，下二檔量，下三檔價，下三檔量，下四檔價，下四檔量，下五檔價，下五檔量，上一檔價，上一檔量，上二檔價，上二檔量，上三檔價，上三檔量，上四檔價，上四檔量，上五檔價，上五檔量。

### 2. Future

#### 2-1. 成交資訊（日期\_I020.txt）

資料欄位：資料時間，成交時間，商品代碼，價格註記，成交價格，成交量，累計成交量，累計買方成交筆數，累計賣方成交筆數。

※ 2018/01/22 前交易所的時間格式為 8 碼，之後的時間格式為 12 碼，請參賽者注意。

### 3. Option

#### 3-1. 成交資訊（日期\_I020.txt）

資料欄位：資料時間，成交時間，商品代碼，價格註記，成交價格，成交量，累計成交量，累計買方成交筆數，累計賣方成交筆數。

※ 2018/01/22 前交易所的時間格式為 8 碼，之後的時間格式為 12 碼，請參賽者注意。

## 三、交易紀錄格式（請以 csv 檔記錄）：

輸出檔名：Record.csv（請參考範例檔案）。

輸出欄位：商品代碼，進場方向（B 代表多方、S 代表空方），進場日期，進場時間，進場價格，出場日期，出場時間，出場價格，該商品點數價值。

## 四、績效評比指標格式：

輸出檔名：KPI.csv（請參考範例檔案）。

輸出欄位：總損益，總交易次數，平均損益，勝率，獲利因子，賺賠比，最大資金回落，夏普比率。

※ 績效評比指標計算方法請參考「KPI.py」。