

# 量化投資因子檢測－以機器學習方法檢測月營收資訊

陳信宏  
台灣經濟新報業務部

## 摘要

本文旨在探討月營收的資料內涵。透過 TEJ API 抓取月營收相關變化，以及運用統計分析與機器學習的方法，檢驗其與股票期望報酬率間的關係。並作為選股的指標建構投資組合，回測後比較之間的績效差異。