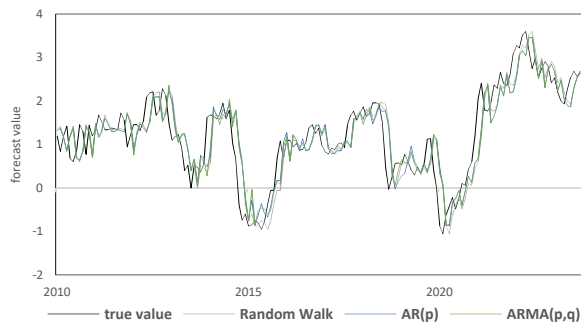
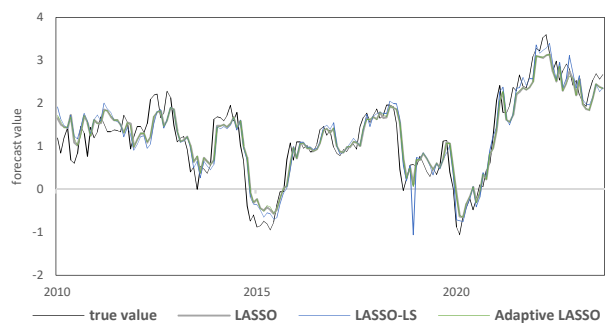


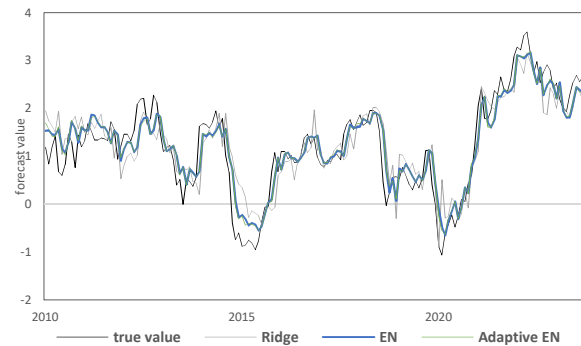
圖 3 向前一期樣本外預測走勢圖



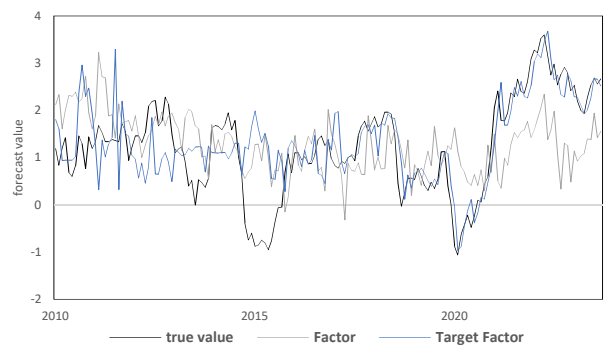
(1) 基準模型



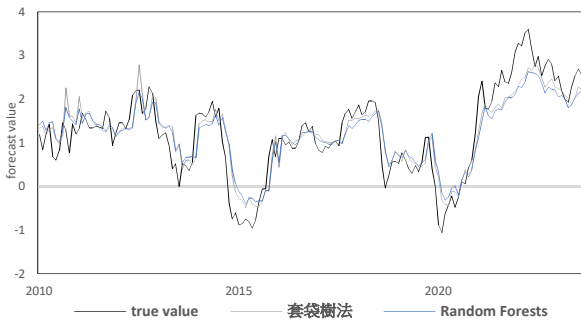
(2) LASSO 模型家族 1



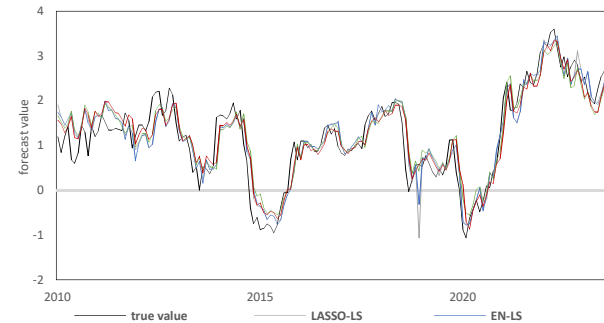
(3) LASSO 模型家族 2



(4) 因子模型



(5) 非線性機器學習模型



(6) 組合模型

註： LASSO 模型家族 1 除包括原有 LASSO 模型家族中之 LASSO 模型外，我們加入 LASSO-LS 模型之預測走勢，以便於比較及參考