Dot.ai

聽人講，定自己驗？

用 AI Agent 驗證股票策略

Roger Lee | 2026 年 11 月 19 日
DotAI × Longbridge AI





Roger Lee

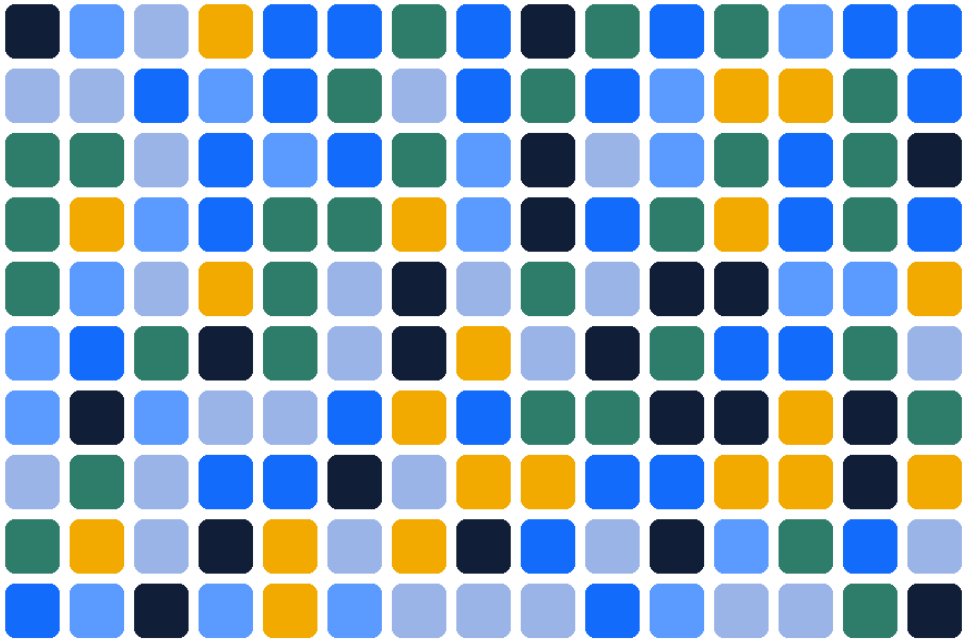
AI 重度用家 + 量化投資者

RtSS 即市提示系統創辦人

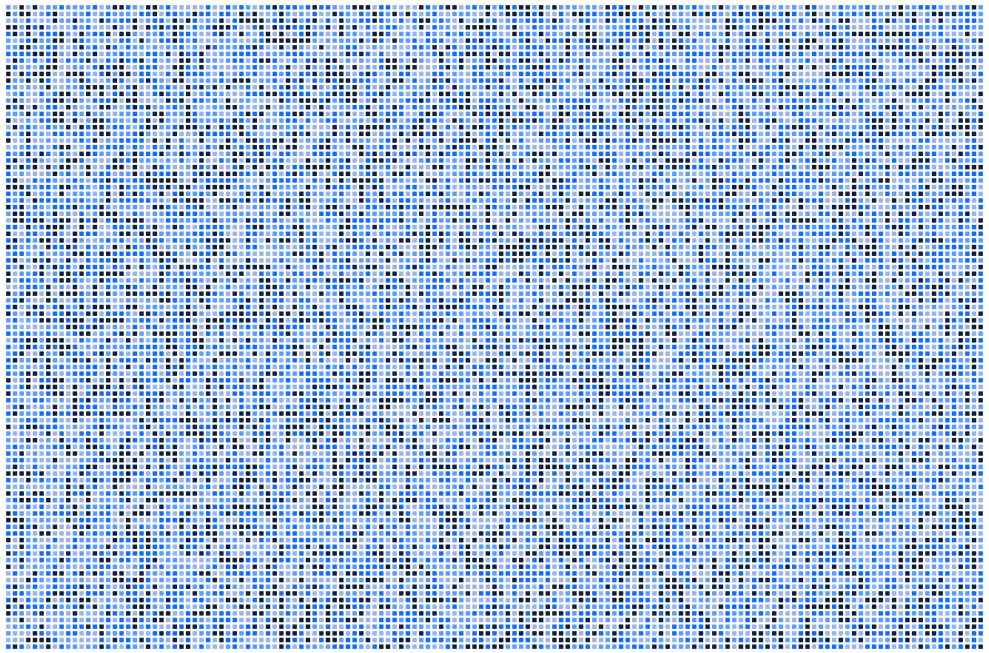
主力：美股 ETF ・量化交易・港股系統

Dot.ai

我怎樣做回測？



×



150+ 個指標

300 萬 + 個回測組合

人手做不到，一定要用量化 + AI

我怎樣處理 WhatsApp ？

群組太多，看不完

交給 AI 幫我總結

連拍片靈感都一併整理



我只傳了

2 張截圖

AI 自己已經知道：

- 🎨 我的 Story 風格
- 🔒 要遮學員名字
- ⚠ 要加免責聲明
- 📊 順手記錄學員成績

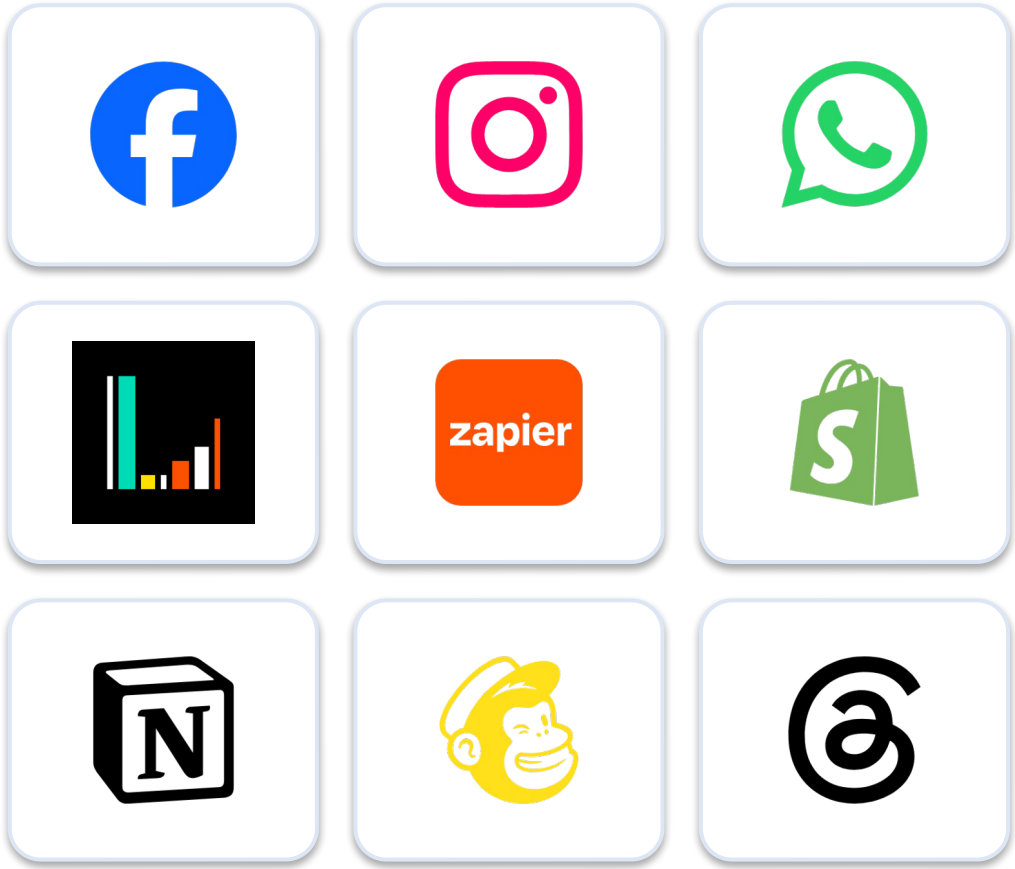




Dot.ai

以前開好多個網站，現在一個訊息

以前：逐個網站入去，自己按掣



現在： Discord 一個訊息

「幫我出 Story」

所有工具同時幫我做
我不用逐個入去看

Dot.ai

LIVE：打開我的 Discord，看 4 樣

- 👨‍💼 AI 總管派工
- 📄 AI 篩港股通告
- ☀️ 每朝 AI 早報
- 🤖 AI 交易員工

5 分鐘，看看我每天怎樣用 AI

Dot.ai

今晚 6 章

1	Hermes ：你的 AI 辦公室	2	投資兩大流派
3	回測與最大跌幅	4	實戰：驗證 KOL 貼士
5	新手怎樣開始	6	今晚回去做什麼

第 1 章

Hermes ：你的 AI 辦公室

它是什麼、能做什麼、怎樣用 Discord 跟它說話



什麼是 Hermes Agent ？

Dot.ai

一間 AI 辦公室：不同 AI 一起做

🤖 Hermes 主管：分工



Claude



ChatGPT



Gemini

同一時間用最好的工具，各做各擅長的

Dot.ai

24/7 營業

晚上照樣幫你工作

可以操作你的電腦

越用越了解你



交給它工具，它就學會使用

MCP

API



例如：長橋數據、 Google 、 Discord

Dot.ai

接駁 MCP 後，你可以問 AI ：

行情

- 最近一口價是多少？
- 近五日哪天升最多？

公司

- 公司做什麼生意？
- 最大股東是誰？

股息

- 去年派過幾次息？
- 下次何時除淨？

公告新聞

- 最近有什麼公告？
- 下次何時公布業績？

選股

- 哪些港股收入有增長？
- 可以按盈利排序嗎？

我的戶口

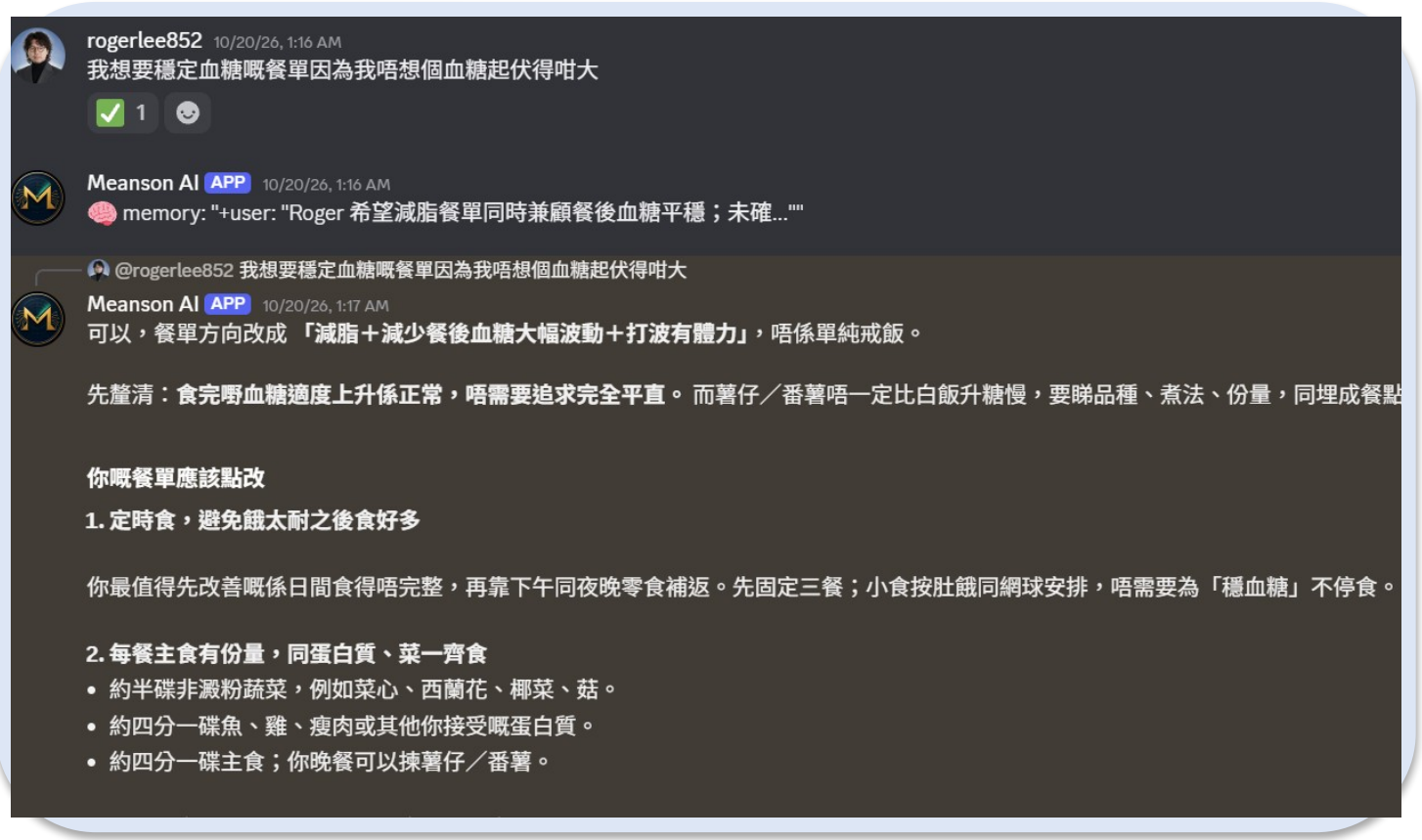
- 我持有哪幾隻股票？
- 到我指定價可以提我嗎？

為什麼用 Discord ？



手機電腦同步，一個 channel 一個部門

一個對話窗口，什麼都做到



上載相片

製作影片

發送訊息

不建議用語音對話



廣東話要先轉成文字，速度很慢

Dot.ai

但可以用語音輸入



比打字好得多：講出你真正的想法

Dot.ai

例子：一句話，Hermes 幫你做

Roger

幫我看看 QQQ 上一個交易日收市，距離高位跌了多少？

Hermes

QQQ 11 月 17 日收市 657
一年內高位 760 ，現在距離高位 – 13.5%
要不要我每日收市後自動通知你？

資料由長橋 MCP 即時攞

第 2 章

投資兩大流派

技術分析 vs 量化分析，我為什麼轉做量化



Dot.ai

投資世界有
兩大流派



看圖、看線
靠經驗判斷



技術分析 ①

要累積大量經驗才上手



技術分析 ②

Dot.ai

要花時間盯盤



技術分析 ③

Dot.ai

用數據做回測



量化分析 ①

電腦自動執行交易



量化分析 ②

Dot.ai

24/7 運作



量化分析 ③

好像信仰一樣



沒有絕對的好與壞，視乎個人喜好

記住目的：賺錢



能幫你賺錢的，就是好方法

Dot.ai

我以前做技術分析

太緊張

睡不着

心理壓力很大

影響情緒

Dot.ai

之後轉了做
量化分析



可以重複



我為什麼選量化 ①

Dot.ai

可以放大



我為什麼選量化 ②

普通人都做到



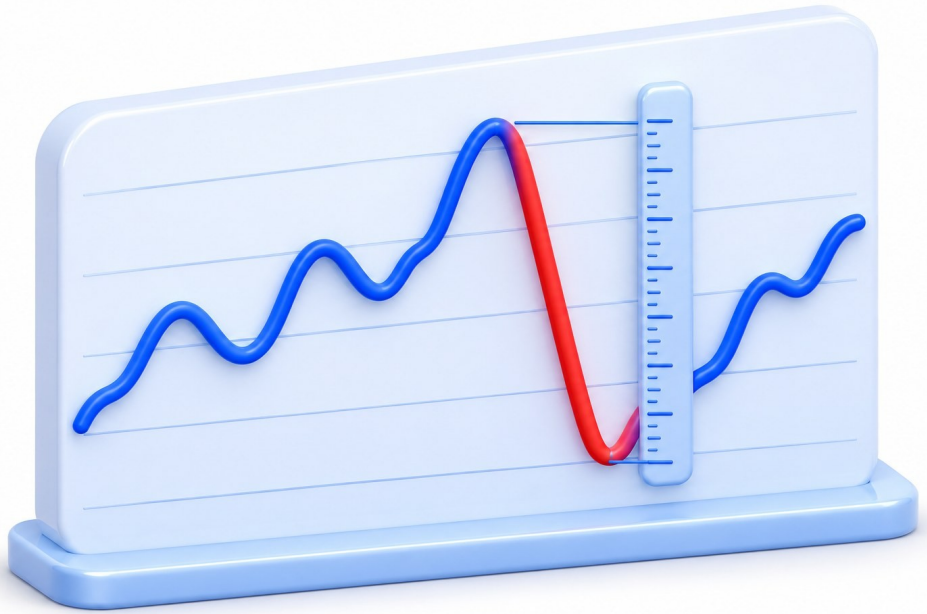
我為什麼選量化 ③

可以複製、有得跟



我為什麼選量化 ④

計得到最大跌幅



我為什麼選量化 ⑤

第 3 章

回測與最大跌幅

怎樣用數據驗證策略，為什麼要先看最差



什麼是回測？



Backtest

Dot.ai

一粒藥
沒做過臨床試驗，
你敢不敢吃？



回測 = 用過去的數據
有系統地驗證策略

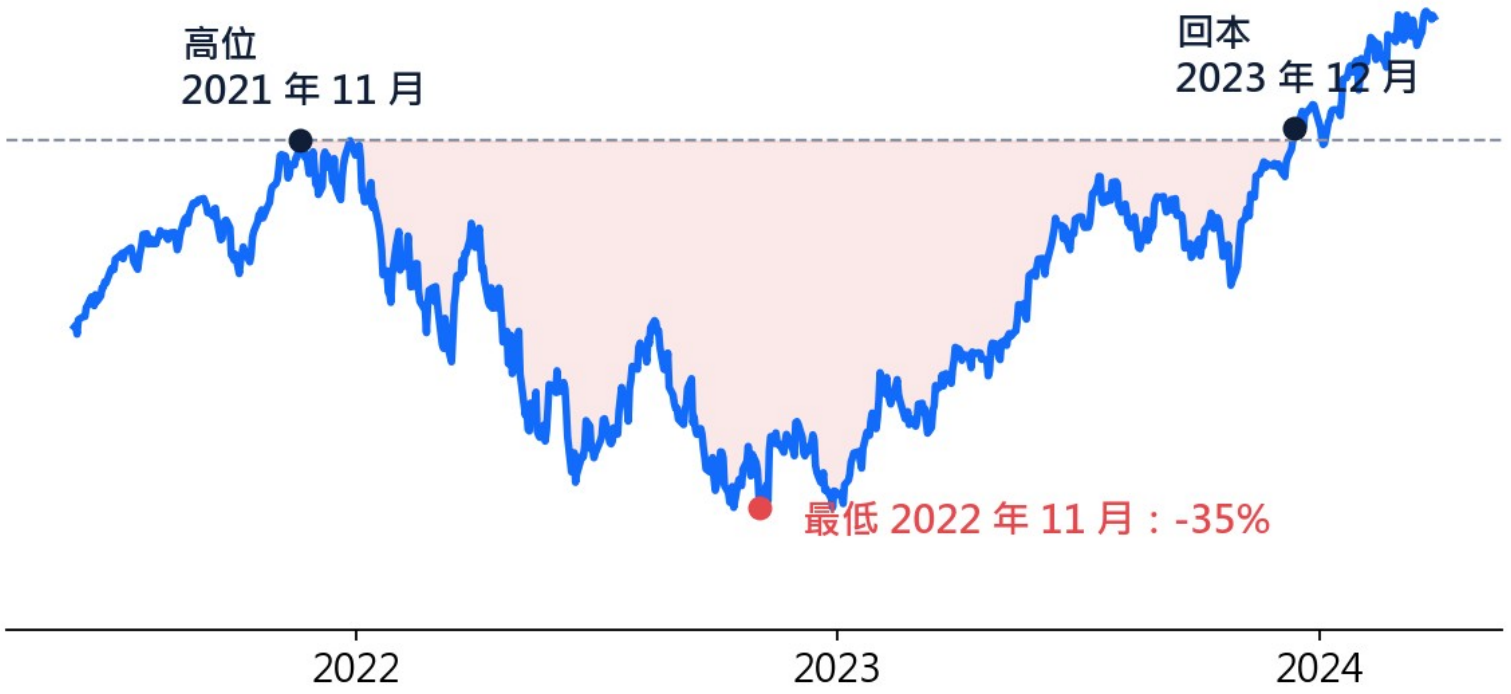


重點：找出最差的情況（最大跌幅 MDD ）

為什麼要看最差？



真實例子：QQQ 在 2022 年



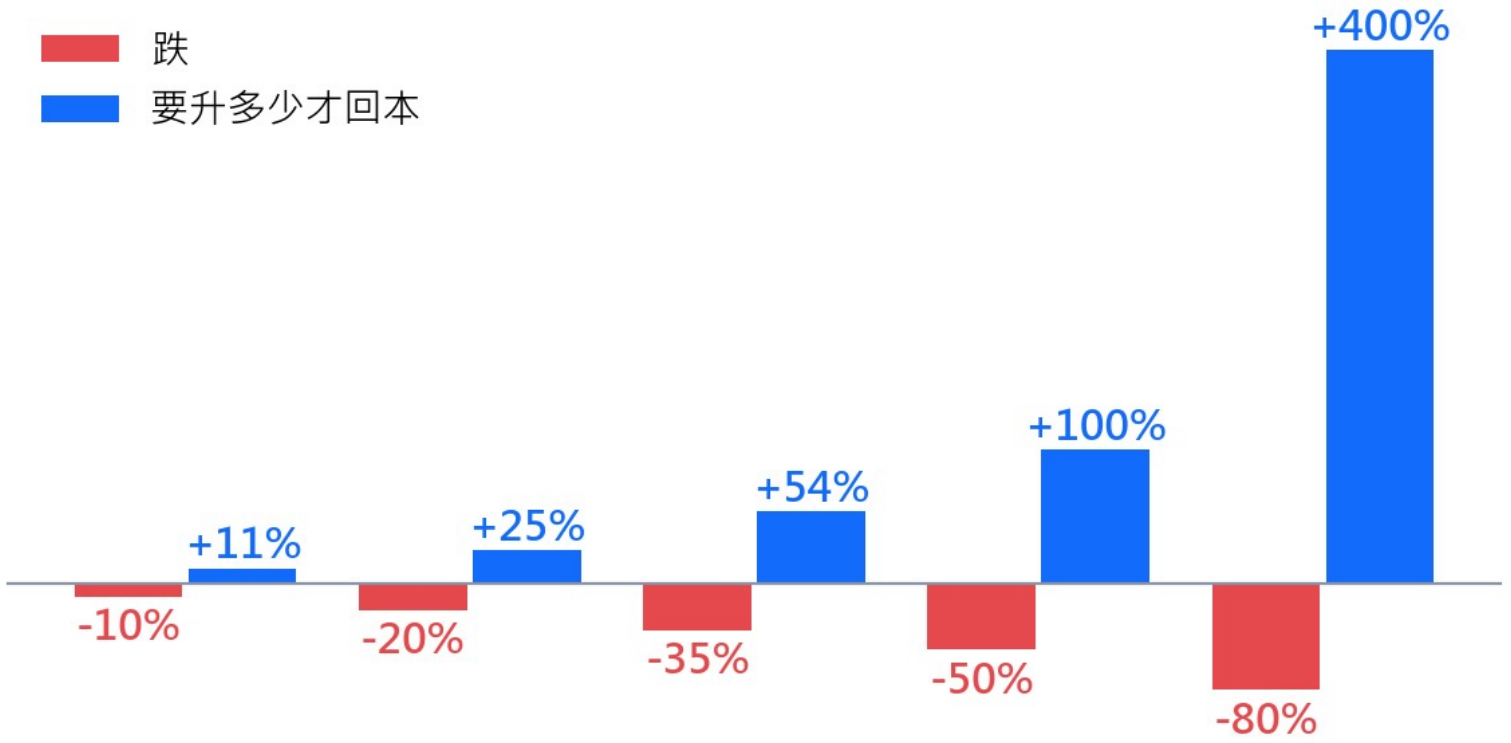
由高位跌了 – 35%

跌了 11 個月才見底

用了 2 年才回本

這就是「最大跌幅」：中間最痛的一段

跌得越深，越難回本



跌 50%

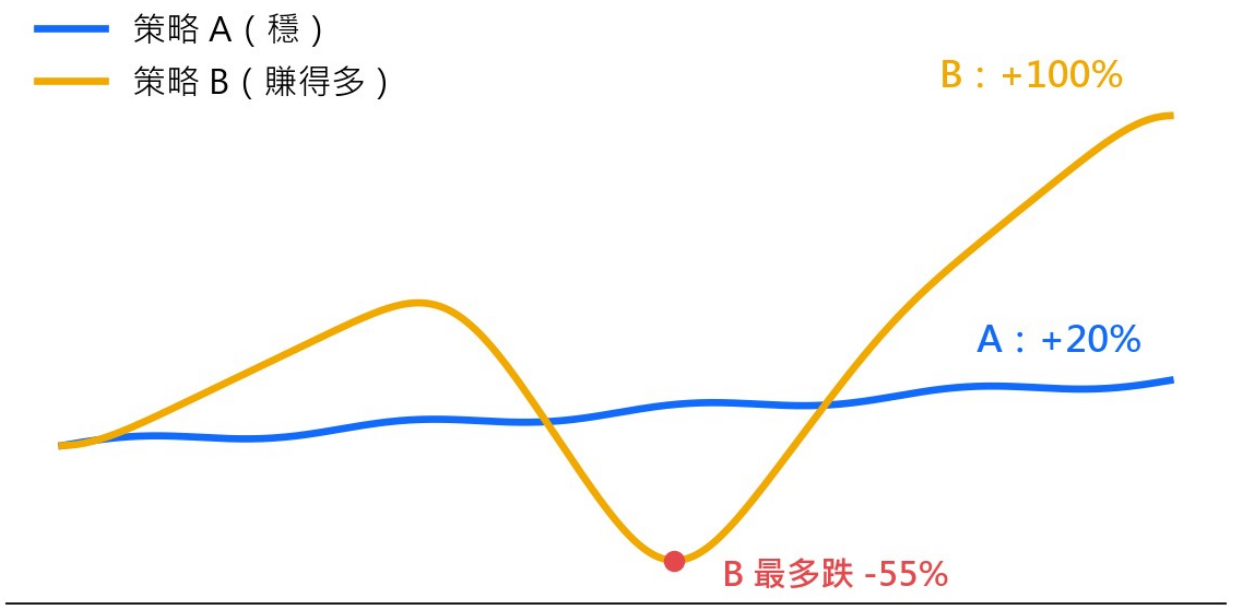
要升 100% 才回本

跌 80%，要升 400%

小測試：兩個策略，你揀哪一個？

策略 A ：最後賺 20%

策略 B ：最後賺 100%



B 中途跌 – 55%

很多人在最低位忍不住賣出

賺得多，不等於你拿得到

最大跌幅 =
你要捱的最痛一刻



揀策略：先看最大跌幅，再看回報

投資只有一件事
你控制得到



就是：你可以接受輸多少

Dot.ai

第 4 章

實戰：驗證 KOL 貼士

一條連結，看看冠軍策略你抄不抄得到



平時大家怎樣投資？



聽朋友說



你的消息從哪裏來？①

看 KOL



你的消息從哪裏來？②

看電視



你的消息從哪裏來？③

聽收音機



你的消息從哪裏來？④

有沒有聽過
哪位 KOL ？

2024 年

+353.9%

一位香港 KOL，贏得美國投資比賽冠軍

Dot.ai

一起試試：

有效還是無效？

只給 AI 一條連結

[redacted] › 台股 2026-10-30 ···

一門雙至尊，香港中學老師[redacted]，2024年以353.9%贏得美國投資錦標賽百萬美元以上股票組冠軍。

打破了[redacted]在2021年創下的紀錄，2025年又以252.3%奪冠。

最離譜的是，老婆[redacted]用他的方法做交易，居然也拿下了2024年同一組別的亞軍😂

[redacted]最常用的交易方法，叫多重優勢交易策略，簡稱M.E.T.S。他只在幾個優勢條件疊在同一個價位區時進場，規則清楚到可以交給另一個人照做。

這其中，均線是他認為非常重要的優勢條件。
他的每張圖表上都開著10日，20日，50日和200日線，既用來看趨勢往哪走，也拿來當支撐和阻力。

這次我們就分5個步驟，看[redacted]是怎麼用均線的。 翻譯



♡ 130 💬 9 🔁 10 ➤ 191

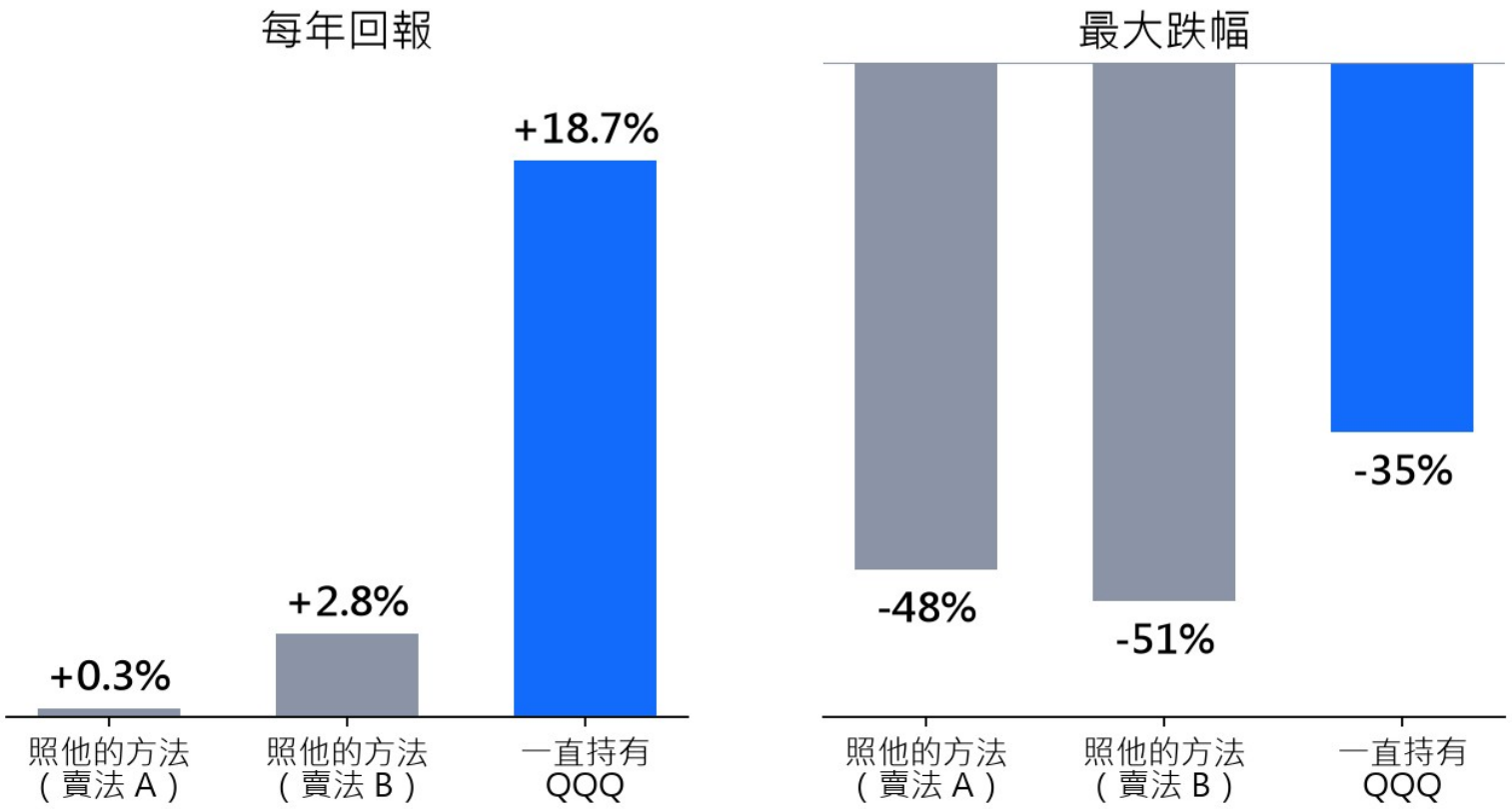
① 讀帖文

② 拆出規則

③ 回測

④ 出報告

他做得到，但你不是他



用他的方法，測試約 500 隻大型美股

2015 年至今，日線

一直持有 QQQ ：賺更多，跌得更少

只有他本人做得到；你照抄，不如一直持有 QQQ

Dot.ai

全程我只給了
一條 URL



Dot.ai

① 分析策略



沒有一步需要自己做

Dot.ai

② 取得數據



沒有一步需要自己做

③ 回測



沒有一步需要自己做

④ 出結果



沒有一步需要自己做

⑤ 看圖



沒有一步需要自己做

以前：自己找數據



以前 ①

Dot.ai

以前：自己整理、畫圖



以前 ②

以前：最少半小時



以前 ③

現在：一個 MCP 接駁數據



現在： AI 自己取數據、畫圖



現在 ②

Dot.ai

現在：幾分鐘完成



現在 ③

Dot.ai

策略驗證員



以量化交易專家的角度，驗證策略成效 | 貼一條連結就能驗證

第 5 章

新手怎樣開始

不要讓 AI 自動交易，先由 ETF 開始



Dot.ai

新手用 AI 投資？

Dot.ai

不建議把真錢交給 AI 自動交易

AI 不停交易，本金容易歸零

黑客有機會取走你的錢

先學基本網絡安全，保護自己



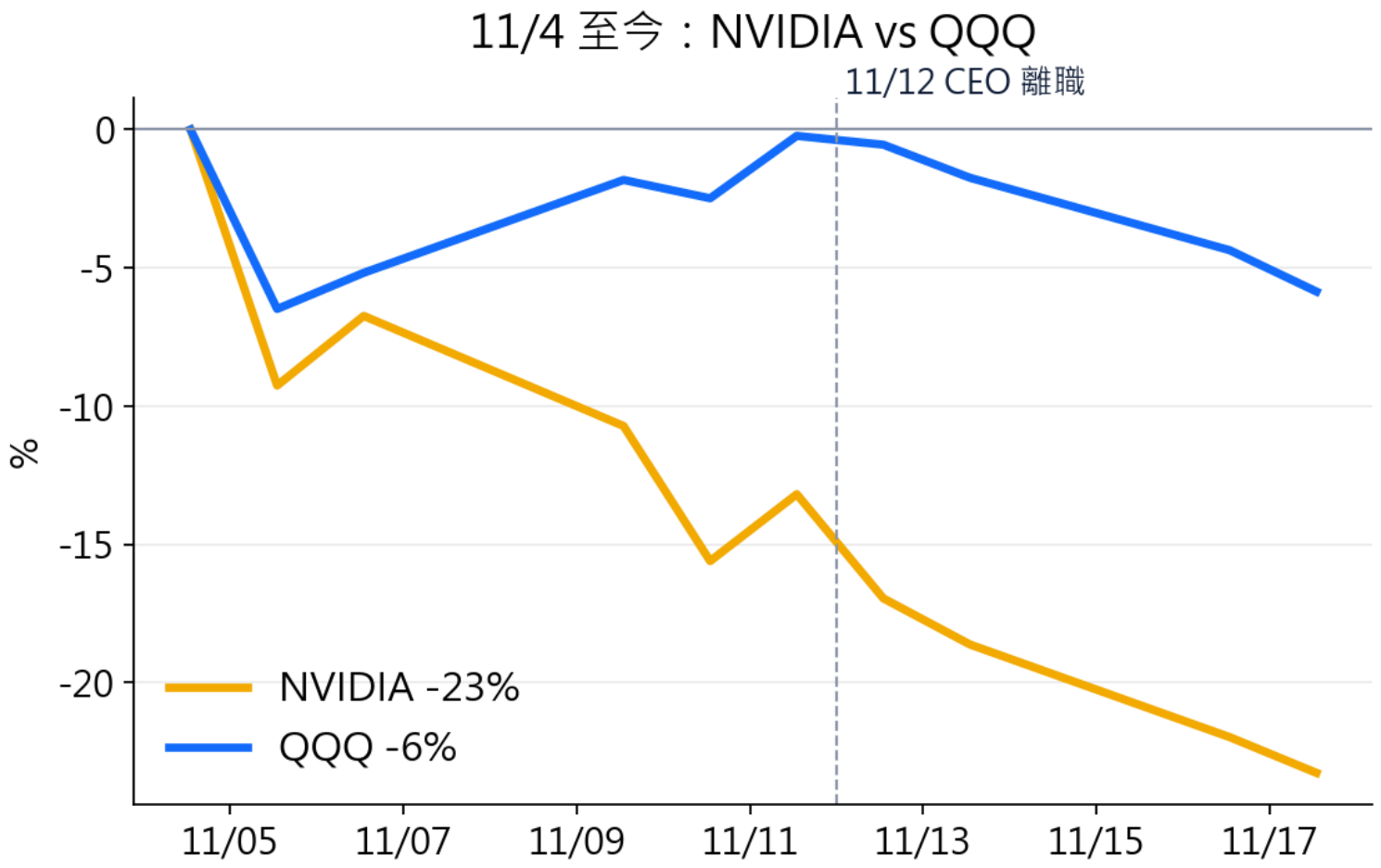
Dot.ai

建議新手用

美股 ETF



沒有個股風險



11 月 4 日至 17 日

11/12 NVIDIA CEO 離職

NVIDIA –23%

QQQ 只是 – 6%

沒有破產風險



一籃子股票：一間公司出事，不會歸零

巴菲特：
普通人買
低成本指數基金就夠

美股長期一直向上

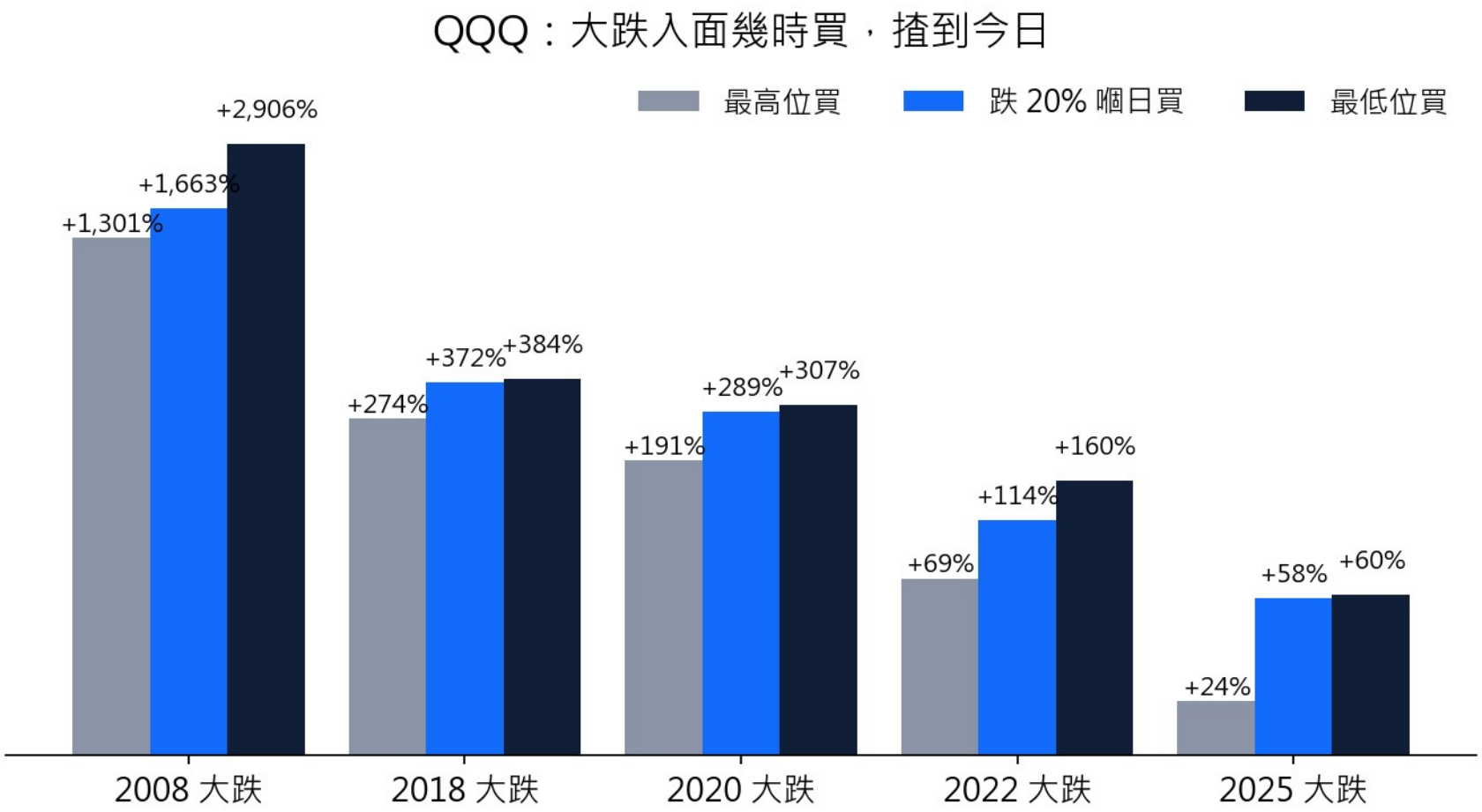


Photo: Mark Hirschey, CC BY-SA 2.0

很簡單：找低位入場
已經很好



QQQ 回測：大跌中什麼時候買？



持有到今日｜最高位買都賺，不用估最低位，但要捱得住

就算遇到股災

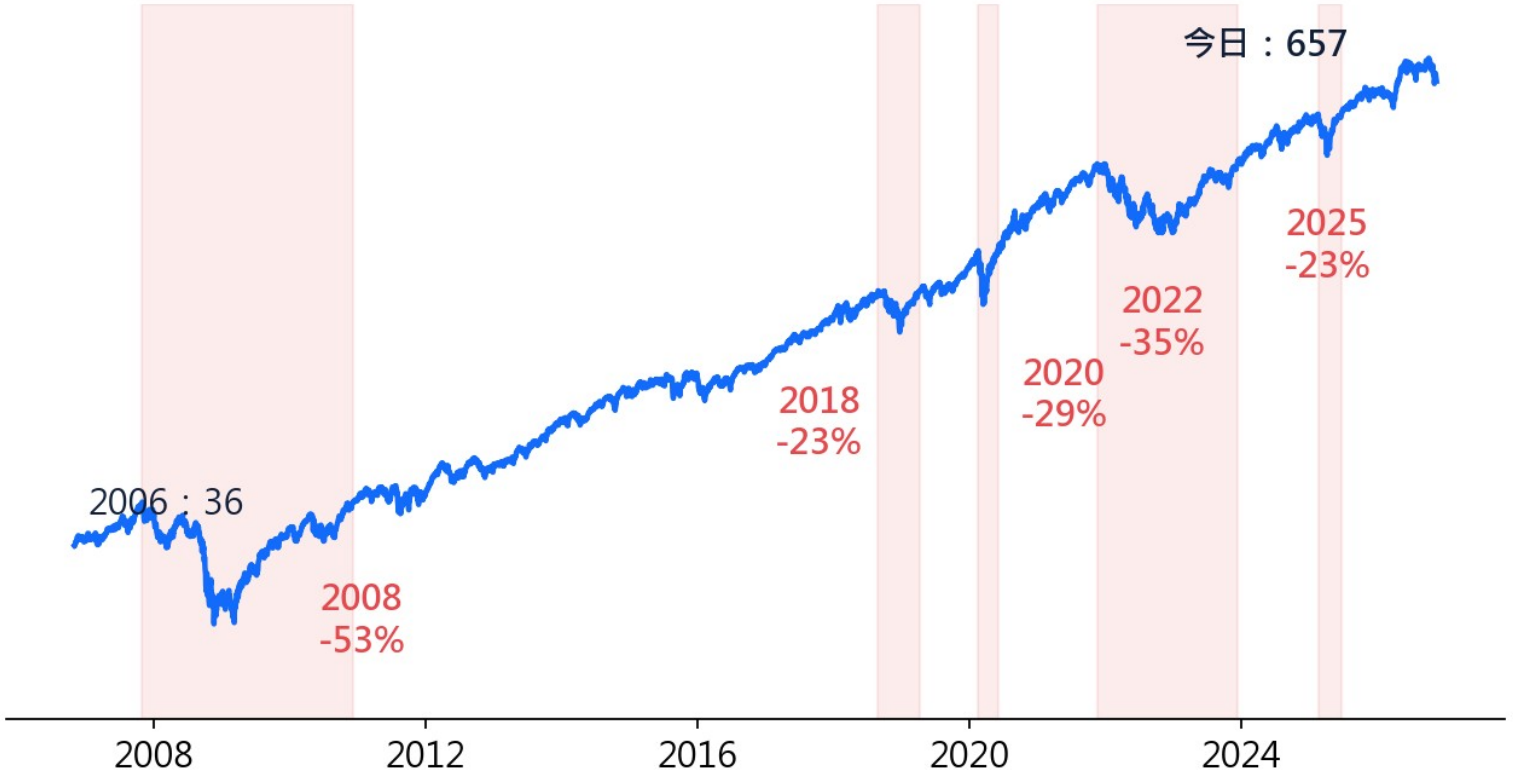
+1,301%

2008 年最高位買入，持有到今日

我們只需要找低位買入

Dot.ai

過去 20 年 QQQ：大跌 5 次，每次都創新高



20 年升了 18 倍

平均每年 +15.6%

大跌過後，每次都回到新高

紅色 = 由跌到回本的時間 | 2006 年 11 月至 2026 年 11 月

最近科技股大跌： QQQ 何時值得留意？



距離高位 – 13.5%

跌 10% = 調整

跌 20% = 值得留意

11 月 17 日收市

Dot.ai

每朝 Hermes 早報，只看三樣

① 我持有的股票

② QQQ 距離高位幾多

③ 策略有沒有訊號



一句設定：「每日美股收市後，幫我睇這三樣，用 Discord 通知我」

Dot.ai

第 6 章

今晚回去做什麼

三件事，加上想學深一步的方法



Dot.ai

今晚回去，做三件事

① 裝好 Hermes，駁上 Discord

② 叫它每日收市後幫你睇 QQQ

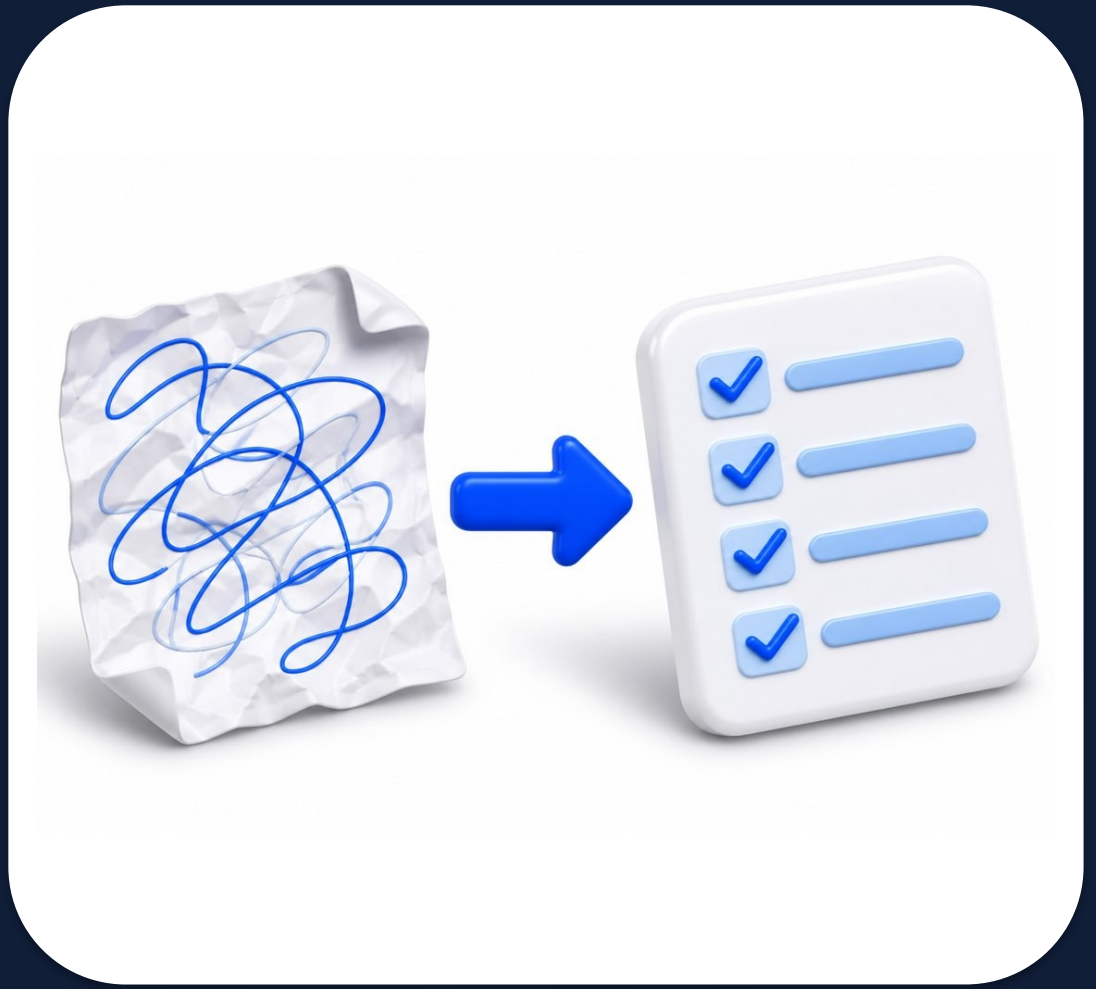
③ 揀一句你聽過的貼士，叫 AI 驗證



Dot.ai

想再學深一步？

正式班 | 7 章 23 個單元



Dot.ai

正式班｜7 章

① 認識 AI Agent 股票研究助理

② AI 可以做幾多？要防什麼風險？

③ 看懂一份策略成績表

④ 用 AI 整理投資組合

⑤ 用 AI 研究 ETF 和市場消息

⑥ 用歷史股價試一個買賣方法

⑦ 用看板和手機通知跟進

Dot.ai

三個月，同一課程參與三次

第 1 個月 | 首次上堂

第 2 個月 | 帶問題再聽

第 3 個月 | 換例子再試

Dot.ai

兩個月陪跑（實體方案）

每月一次 Online 一對一

每月一次 Online 學生聚會

WhatsApp 群組分享

純交流：不代裝、不代跑、不承諾投資回報

Dot.ai

你適合實體，還是 Online ？

實體

HK$15,000

原價 HK$18,500

- ✔ 12 小時實體正式課
- ✔ 限 15 位
- ✔ 兩個月陪跑交流

Online

HK$7,500

- ✔ 遙距跟課
- ✔ 直播 + 錄影重溫

兩個方案都包三個月內同一課程參與三次（首次上課 + 之後兩期直播 / 錄影）

今晚哪一步，
你想 Roger 再示範一次？

Q&A

Dot.ai

帶一條你真正想研究的問題
來 Coffee Chat

完場跟我們說「我想約 Coffee Chat 」| 最多 30 位

只供教學參考，不構成投資建議

歷史回測不代表將來表現，投資決定由你自己作出

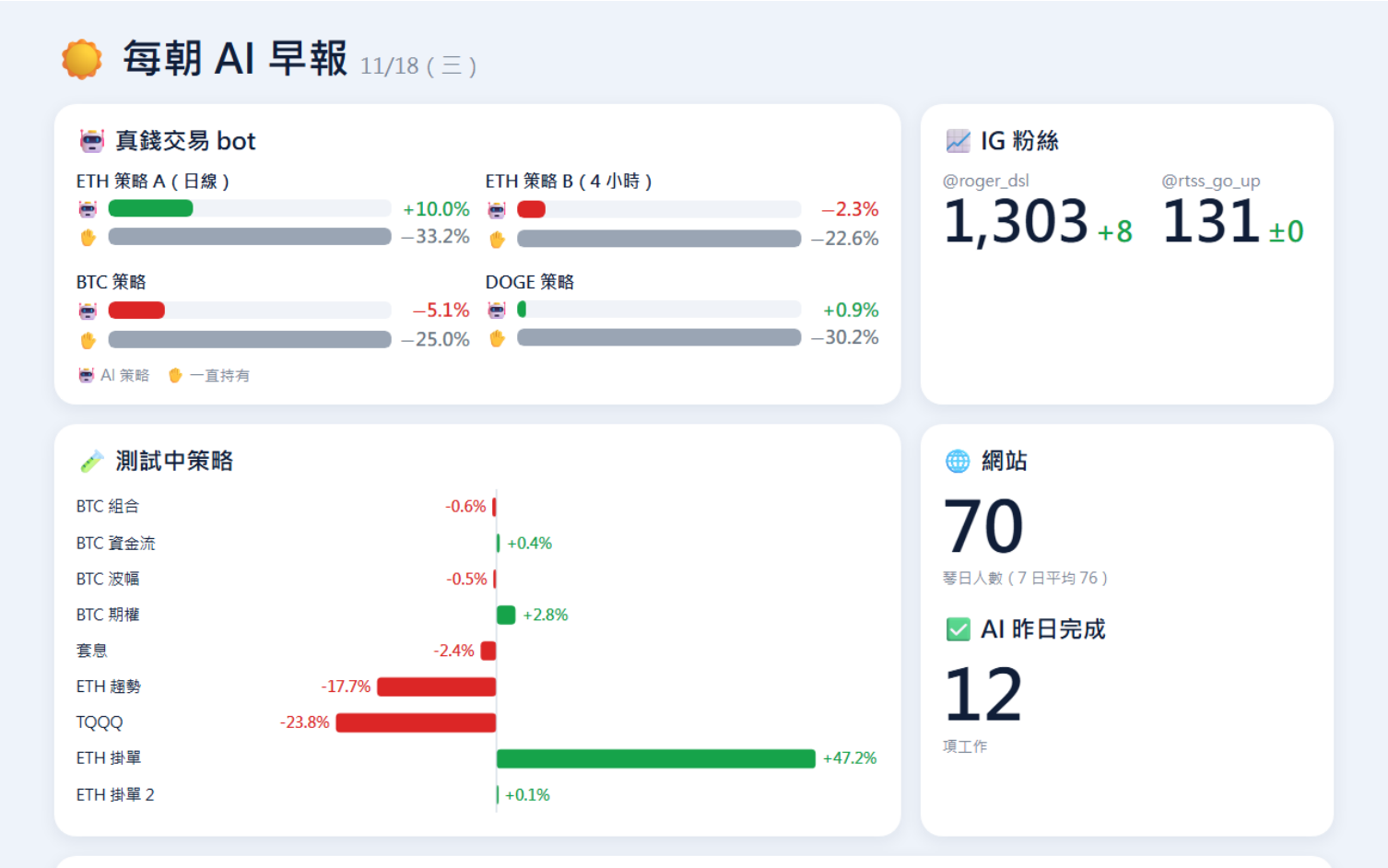
後備｜AI 總管派工


總管
roger 今日 20:08
1.即場開discord live show, 2.5分鐘,3 3-4 4.平時睇通告,5.可以 6.唔好,7唔好用咁多,8.dotai 做
AI 總管 今日 20:09
✅ 已經派咗去 #dotai
📋 交代咗嘅嘢
- Jimmy 嘅意見，連埋錄音檔案位置
- 你嘅 8 個決定：
- Discord 即場 live 5 分鐘
- 揀 3–4 樣
- 加 睇通告
- 真倉 bot 只 show 百分比
- 用真 Discord
- 少講品牌名
- 候選清單，等你同 #dotai 揀：
- AI 員工 + 團隊分工
- 一條 link 驗證 KOL 策略
- 每朝早報
- 睇通告
- 真倉 bot / 總控台
📦 #dotai 會交俾你
- 5 分鐘 live 腳本：開邊個 channel、打咩、講咩，每樣附一句 before / after
- 每個示範都準備後備截圖，live 出錯可以即刻轉用
- ⚠️ 腳本會列明 live 之前要收埋邊啲私人 channel，因為係用真 Discord
👉 之後去 #dotai 同佢揀 3–4 樣、睇腳本就得。

後備｜AI 每日篩港股通告



後備｜每朝 AI 早報


每朝 AI 早報 11/18 (三)
真錢交易 bot
ETH 策略 A (日線)
+10.0%
−33.2%
ETH 策略 B (4 小時)
−2.3%
−22.6%
BTC 策略
−5.1%
−25.0%
DOGE 策略
+0.9%
−30.2%
AI 策略
一直持有
IG 粉絲
@roger_dsl
1,303 +8
@rtss_go_up
131 ±0
測試中策略
BTC 組合 -0.6%
BTC 資金流 +0.4%
BTC 波幅 -0.5%
BTC 期權 +2.8%
套息 -2.4%
ETH 趨勢 -17.7%
TQQQ -23.8%
ETH 掛單 +47.2%
ETH 掛單 2 +0.1%
網站
70
琴日人數 (7 日平均 76)
AI 昨日完成
12
項工作

後備｜AI 交易員工（只顯示 % ）

我的 AI 交易員工

24 小時自動執行｜只顯示百分比｜更新：2026-11-18 10:00 HKT

ETH 策略 A（日線）

由 10/07 開始 · 真錢 · 自動執行

AI 策略	同期一直持有 ETH
+10.0%	−33.2%

ETH 策略 B（4 小時）

由 10/27 開始 · 真錢 · 自動執行

AI 策略	同期一直持有 ETH
−2.3%	−22.6%

BTC 策略

由 10/07 開始 · 真錢 · 自動執行

AI 策略	同期一直持有 BTC
−5.1%	−25.0%

DOGE 策略

由 09/13 開始 · 真錢 · 自動執行

AI 策略	同期一直持有 DOGE
+0.9%	−30.2%

只顯示策略本身回報（%），不顯示金額。過往表現不代表將來；只供教學參考，不構成投資建議。