

# 美股全天候量化投資策略

# 投資路上的五個痛點

1. 買什麼？

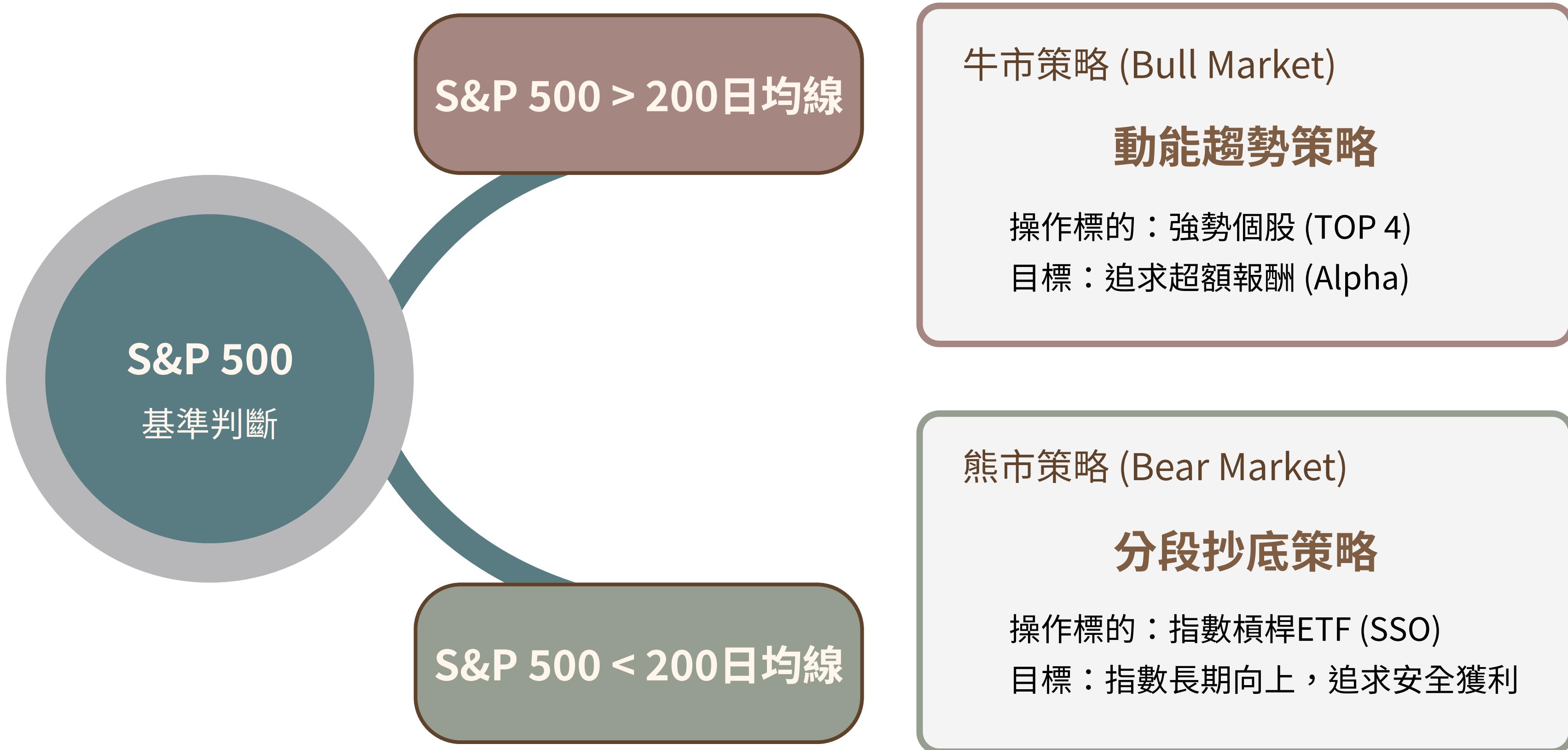
2. 抱不住

3. 高點套牢

4. 跌不敢買

5. 資金運用效率

# 策略核心架構：牛熊分流機制

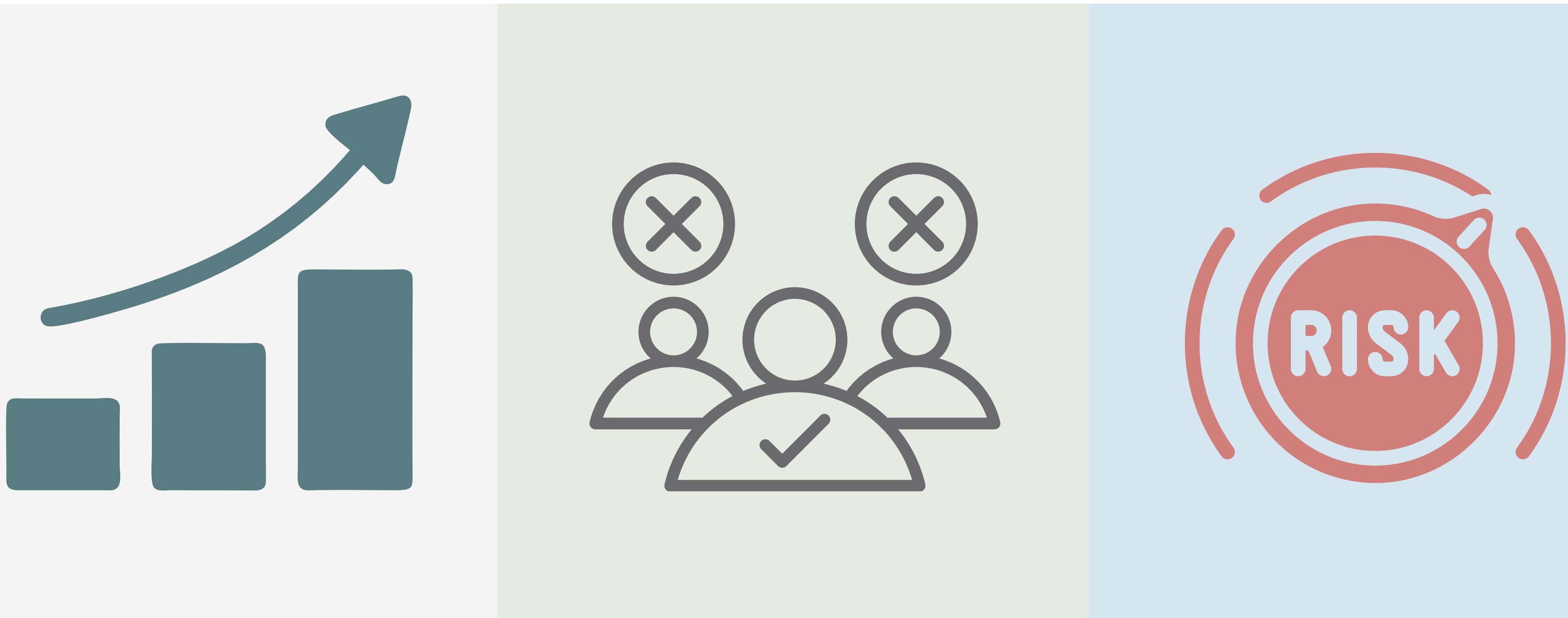


# 牛市策略三大核心精神

順勢而為

汰弱留強

嚴格風控



# 牛市策略進場機制

市場多空濾網  
(Market Filter)

SP500

先決條件：牛市

$SP500 > 200\text{日均線}$

邏輯：指數整體偏多才進行個股操作

符合條件



## 個股篩選標準 (Stock Selection)

必須同時符合以下條件：

### 1. 長中短期趨勢

股價  $> 20\text{MA} > 50\text{MA} > 100\text{MA}$ 。

### 2. 趨勢可信度

股票近90天的最大跳空缺口  $< 15\%$ 。

### 3. 動能斜率計算 (核心)

資料分析與數據量化來評估股票動能排名。

# 牛市策略資金管理

## 1. 動能排名

Rank 1

Rank 2

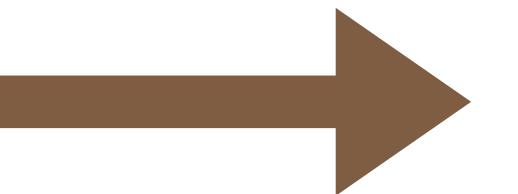
Rank 3

Rank 4

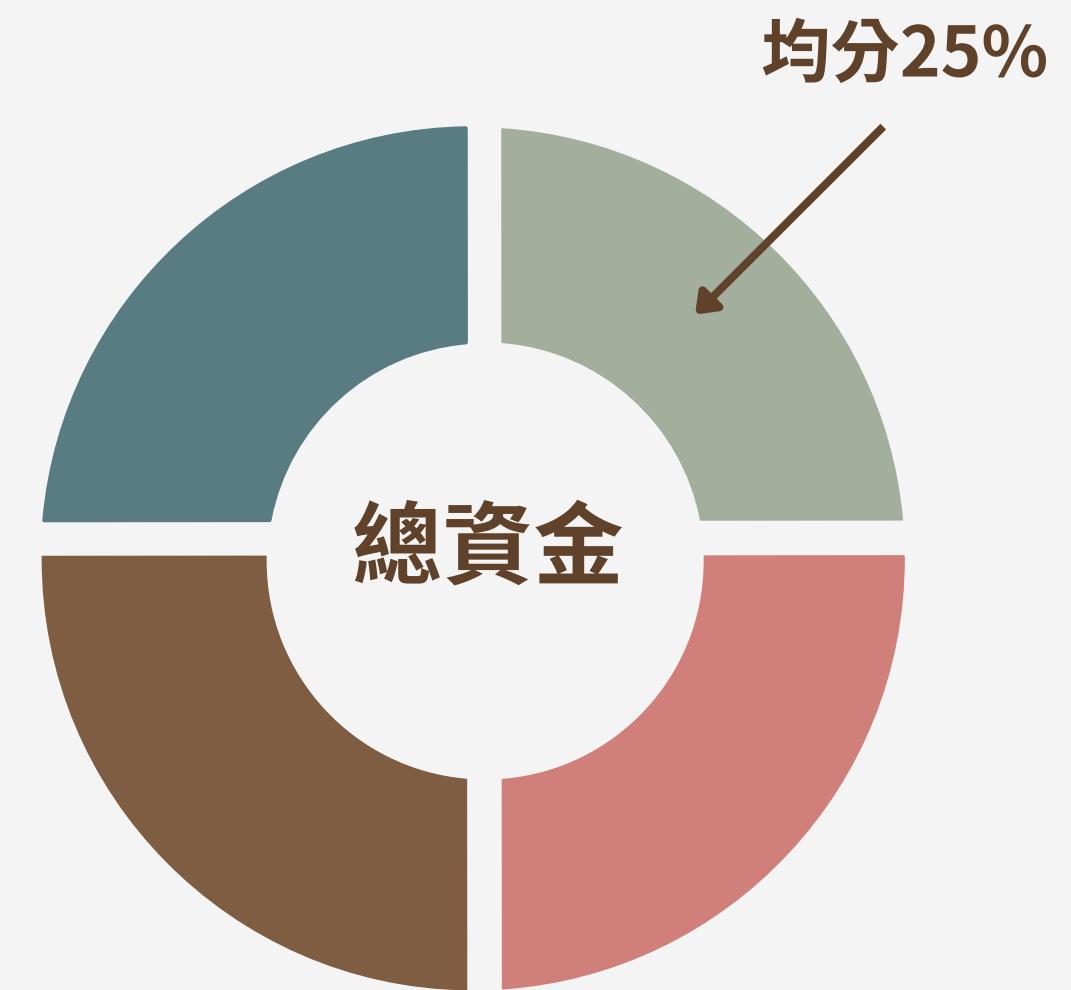
Rank 5

⋮  
⋮  
⋮

TOP 4



## 2. 資金分配



# 牛市策略出場與風控機制

轉入熊市策略

## A. 定期調倉 (Rebalance)

例行檢查

每2週的週三

賣出條件：  
跌出動能TOP10或  
跌破股票的50 EMA。

## B. 強制停損 (Stop Loss)

個股風控

跌破成本價的10%

目的：  
防止單一股票重創  
總資產。

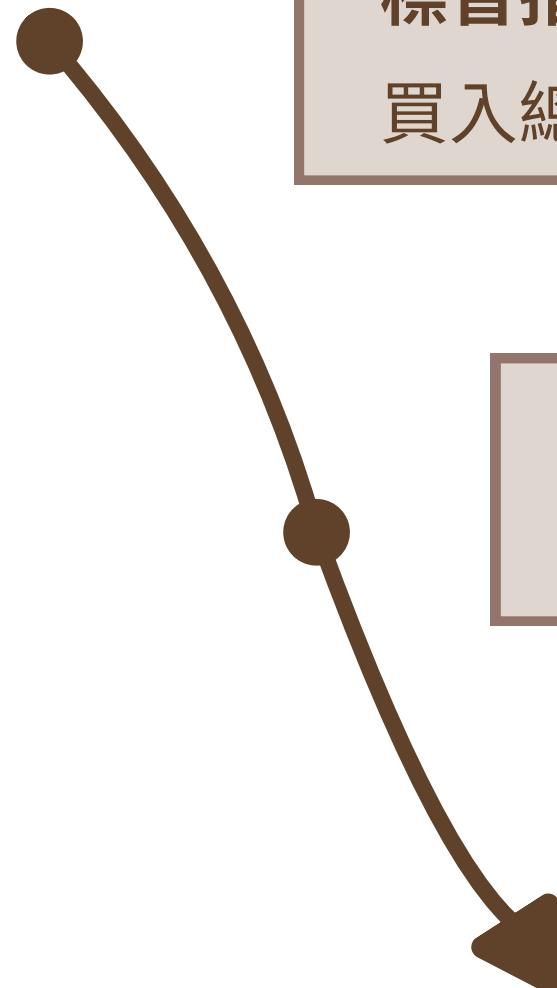
## C. 熊市清倉 (Crash Protection)

大環境撤退

SP500 < 200 日均線

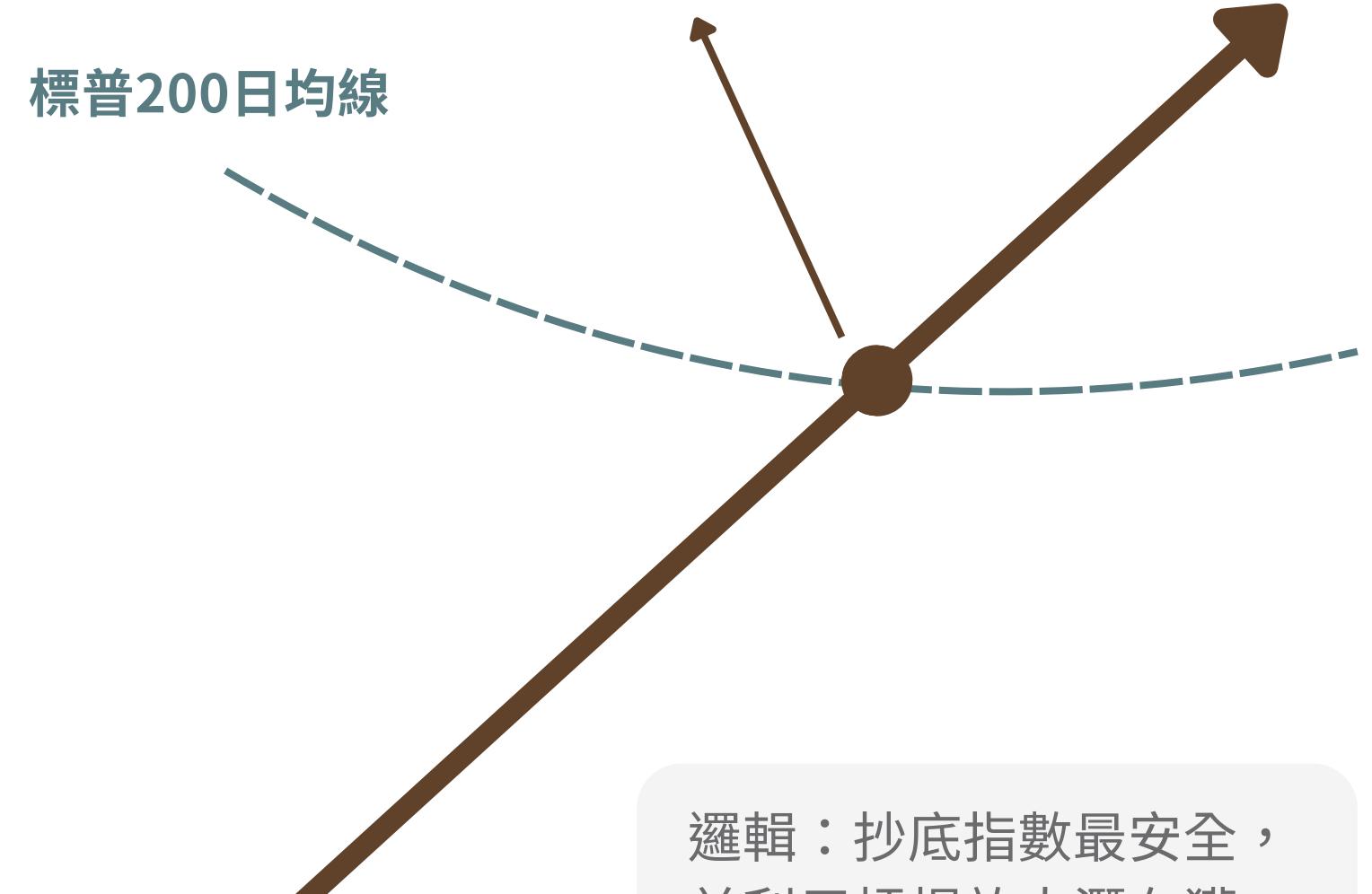
執行動作：  
**賣出所有持股，  
轉入熊市策略**

# 熊市對策



**核心標的：SSO**  
(標普500兩倍做多ETF)

觸發：標普站上200日均線  
動作：清倉SSO



邏輯：抄底指數最安全，  
並利用槓桿放大潛在獲利。

# 策略優勢：踢開五顆絆腳石

## 1. 解決「買什麼」與「抱不住」

方法：動能排名 + 股價均線

利用動能排名篩出強勢股，並搭配均線系統化續抱，在整理期不被輕易洗出場。

HOLD

## 3. 解決「跌不敢買」

方法：槓桿ETF紀律化抄底

利用市場恐慌搭配紀律的操作，轉化成獲利的機會。

BUY

## 2. 解決「高點套牢」

方法：10%停損 + 定期替換

停損防止虧損擴大，定期剔除轉弱的股票，資金轉移至更好的標的。

CUT

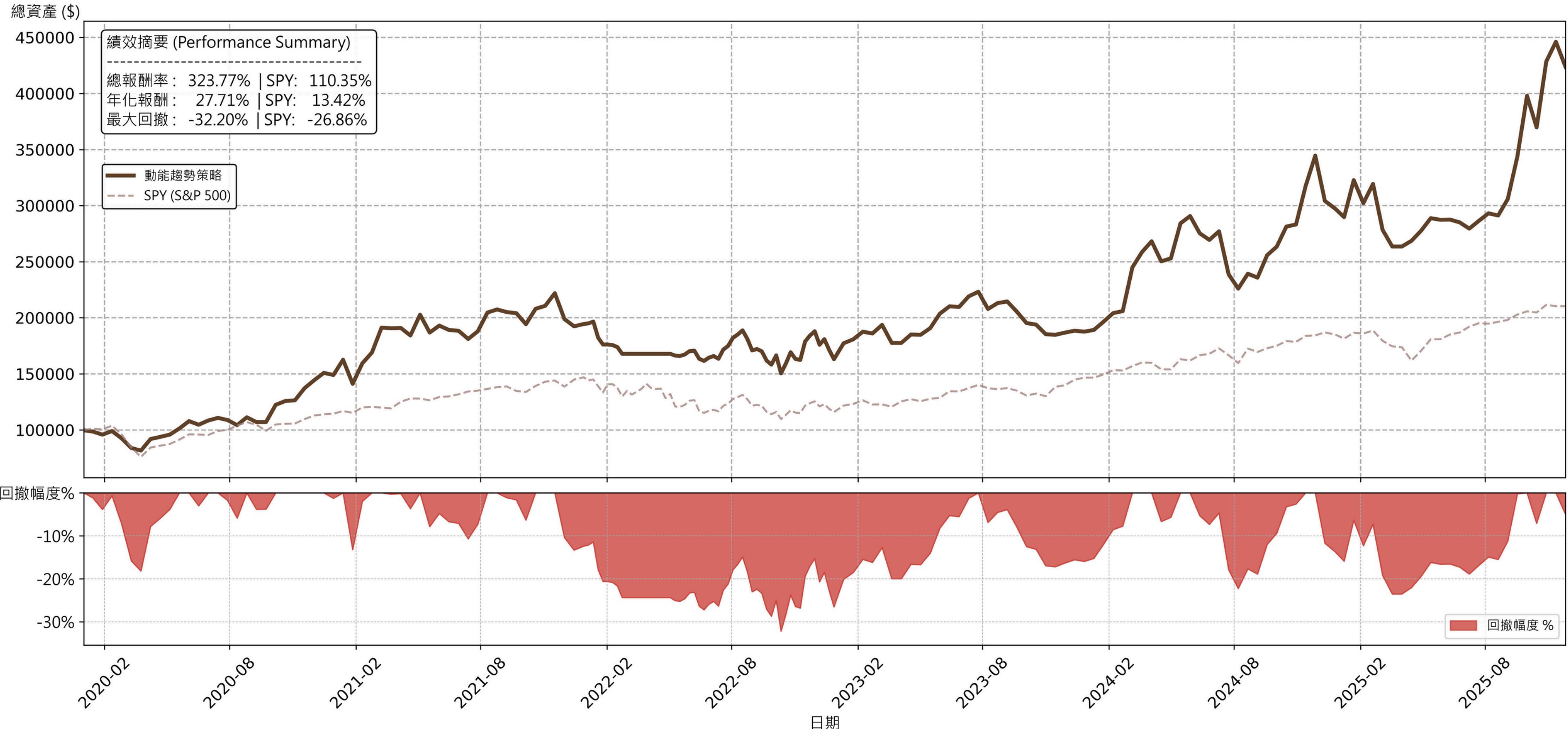
## 4. 解決「資金運用效率」

方法：牛熊切換 + 複利雪球

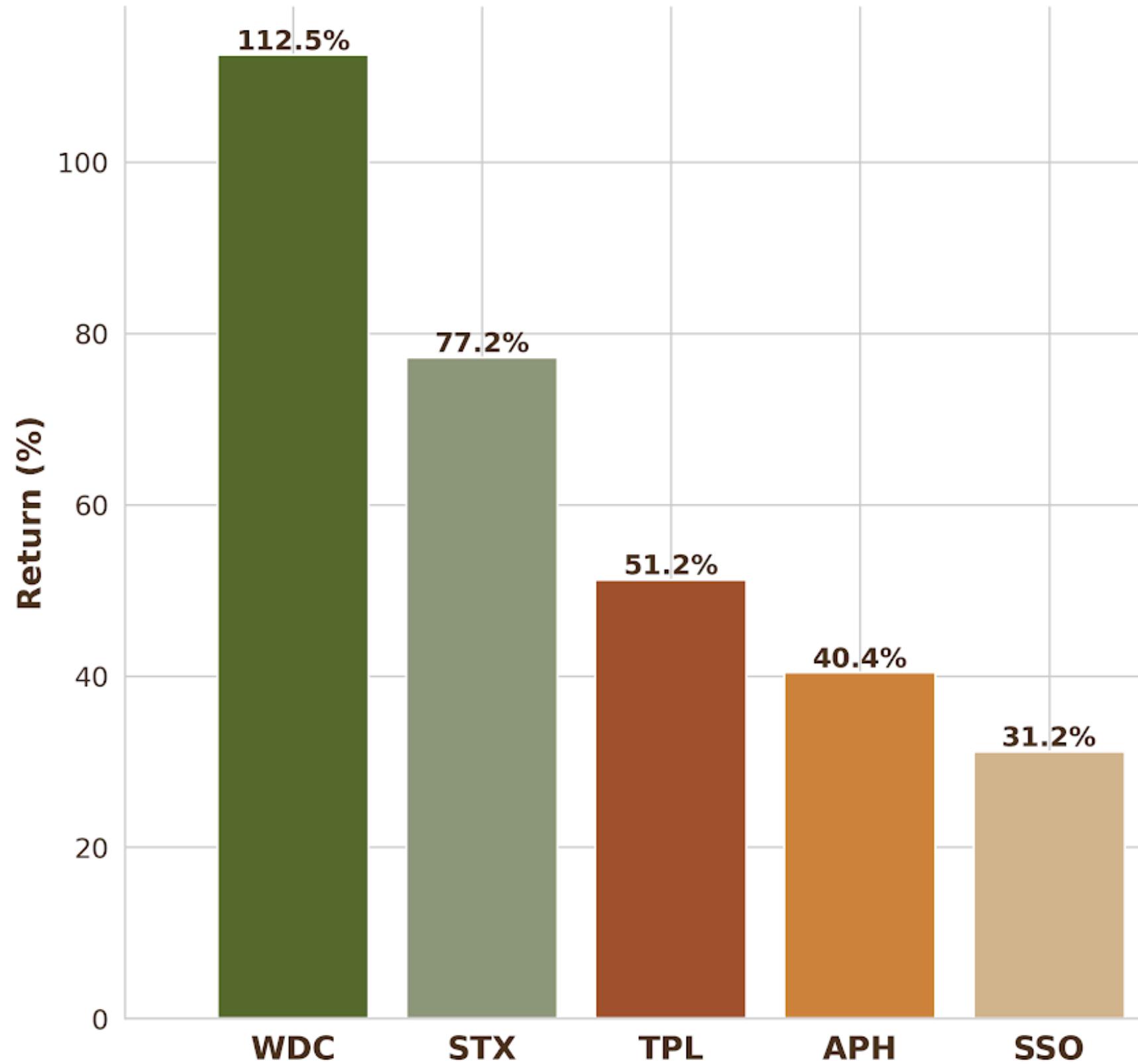
牛市做個股趨勢，熊市做指數反彈，資金持續在市場內複利滾動，創造報酬。

ROI

# 附錄A. 歷史回測績效



# 附錄B. 近兩年最佳交易 Top 5 (24/01/01~25/11/31)



Ticker	Buy Date	Sell Date	Return (%)	Buy Action	Sell Action
WDC	2025/8/6	2025/11/26	113%	BUY	SELL (End of Backtest)
STX	2025/7/23	2025/11/26	77%	BUY	SELL (End of Backtest)
TPL	2024/7/24	2024/12/11	51%	BUY	SELL (Rebalance)
APH	2025/7/9	2025/11/26	40%	BUY	SELL (End of Backtest)
SSO	2025/4/4	2025/5/28	31%	BUY (SPY -15%)	SELL (DIP Clear)

# 附錄C. 近半年交易紀錄

Ticker	Buy Date	Sell Date	Return (%)	Buy Action	Sell Action
MU	2025/11/26	2025/11/26	-1%	BUY	SELL (End of Backtest)
SNDK	2025/11/12	2025/11/26	-10%	BUY	SELL (Stop Loss -10%)
ANET	2025/9/3	2025/11/12	-2%	BUY	SELL (Rebalance)
WDC	2025/8/6	2025/11/26	113%	BUY	SELL (End of Backtest)
STX	2025/7/23	2025/11/26	77%	BUY	SELL (End of Backtest)
APH	2025/7/9	2025/11/26	40%	BUY	SELL (End of Backtest)
GEV	2025/7/9	2025/9/3	7%	BUY	SELL (Rebalance)
MCK	2025/5/28	2025/8/6	-2%	BUY	SELL (Rebalance)
WRB	2025/5/28	2025/7/9	-5%	BUY	SELL (Rebalance)
MNST	2025/5/28	2025/7/9	-7%	BUY	SELL (Rebalance)