



富邦金控

Be Your Own Strategy 建構自己的交易策略-

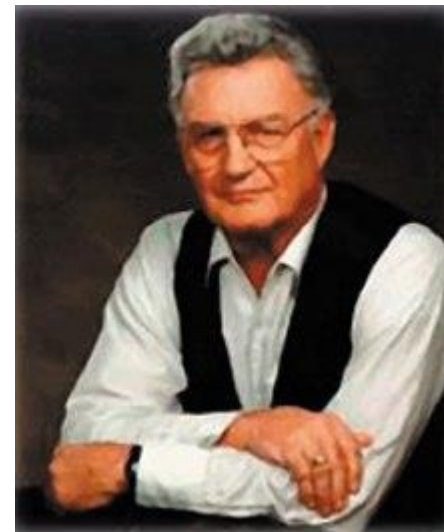
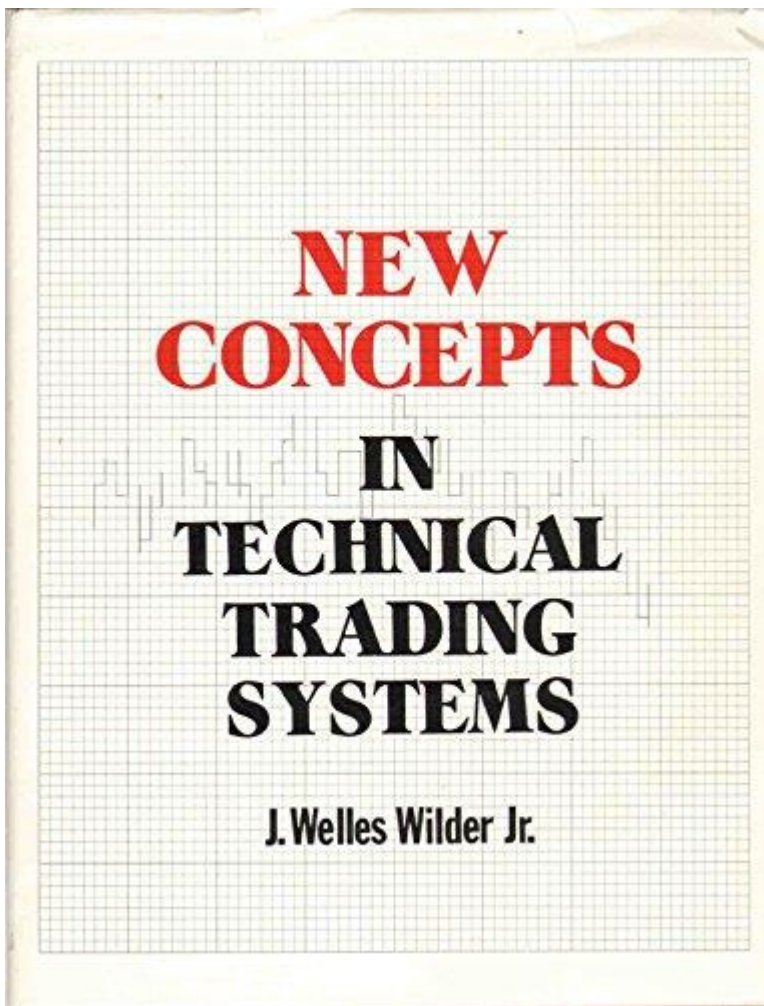
# RSI指標與ATR

富邦期貨 期顧業務部

2023/11/24



# 技術分析的王者-威爾斯·威爾德(Welles Wilder)



著有：  
技術交易系統原理  
亞當理論  
三角洲理論

## 在技術分析領域的貢獻

- Swaing Index(ASI，振動升降指標)
- RSI ( 相對強弱指標 )
- ATR ( 平均真實波幅指標 )
- ADX指標 ( 平均趨向指標 )
- SAR ( 拋物線轉向指標 )
- CSI指標 ( 選擇指標 )
- DMI指標(動向指標).....

## RSI相對強弱指標

- 評估股市中「買賣盤雙方力道的強弱」  
屬技術分析的動量指標，用以衡量近期價格變化的幅度，評估目前股價處於超買或超賣情況，做為進出場的時機點
- $RSI \text{ (相對強弱指標)} = n\text{日漲幅平均值} \div (n\text{日漲幅平均值} + n\text{日跌幅平均值}) \times 100$   
 $n\text{日漲幅平均值} = n\text{日內上漲日總上漲幅度加總} \div n$   
 $n\text{日跌幅平均值} = n\text{日內下跌日總下跌幅度加總} \div n$
- 計算範例：最近14天中，  
10天上漲，累積漲幅28%，平均漲幅： $28\% \div 14 = 2\%$   
4天下跌，累積跌幅-7%，平均跌幅： $7\% \div 14 = 0.5\%$   
 $RSI = 2\% / (2\% + 0.5\%) \times 100 = 80$

## RSI應用

- **RSI值>70**：代表市場快速上漲，要評估是否趨勢可能反轉向下、或是可以尋找賣出機會。
- **RSI值<30**：代表市場快速下跌，要評估是否趨勢可能反轉向上，如果下跌後繼無力，可以伺機買進。
- **RSI值在50附近**：代表沒有明顯趨勢。
- 短期RSI黃金交叉長期RSI，買進
- 短期RSI死亡交叉長期RSI，賣出
- 短期RSI取6日，長期RSI取12日。

# RSI應用

- 黃金交叉偏多訊號出現



- 偏空訊號相對不明顯，勝率較低





# RSI交易策略

XScript 編輯器 - [RSI指標(交易)\*]

檔案(F) 編輯(E) 檢視(V) 編譯(C) 視窗(W) 說明(H)

策略雷達 自動交易中心 選股中心 函數搜尋 教學指南

腳本資料庫

- 1-常用下單方式 (10)
- 2-下單出場方式 (9)
- 3- Algo策略委託 (5)
- 常見技術分析 (28)
  - 多頭 (14)
    - ATR觸發上通道
    - DIF-MACD從負翻正
    - DIF黃金交叉MACD
    - KD低檔黃金交叉
    - MTM黃金交叉0
    - RSI低檔價格背離
    - 布林通道觸碰下軌
    - 平滑CCI超賣
    - 均線黃金交叉
    - 股價黃金交叉三均線
    - 股價黃金交叉單均線
    - 股價黃金交叉雙均線
    - 帶量黃金交叉均線
    - 短期RSI黃金交叉長期RSI
  - 空頭 (14)

屬性

分類	分類
名稱	RSI指標
儲存位置	自訂/

```

1 // 宣告參數
2 input: ShortLength(6, "短期期數"), LongLength(12, "長期期數");
3 var: RSI_Short(0), RSI_Long(0);
4
5 // 設定資料讀取筆數
6 settotalbar(maxlist(ShortLength, LongLength, 6) * 8 + 8);
7
8 RSI_Short=RSI(Close, ShortLength);
9 RSI_Long=RSI(Close, LongLength);
10
11 //多方進場策略：短期RSI黃金交叉長期RSI；空方進場策略：短期RSI死亡交叉長期RSI
12 if RSI_Short Crosses Above RSI_Long then setposition(1);
13 if RSI_Short Crosses below RSI_Long then setposition(-1);
  
```

Ln11, Col28 已編譯

訊息

# 績效檢視





# 多空績效勝率為37%，獲利因子1.27

回測報告[自動交易]-RSI指標 (執行時間:11:09:12) (未儲存) - XQ全球贏家(企業版)

儲存
匯出
重新回測

腳本設定	淨利	134.48%	毛利	634.86%
RSI指標(短期期數=6, 長期期數=12)	獲利因子	1.27	毛損	-500.38%
	總交易成本	32.30%	最大投入金額	6,837,200
	總交易次數	323	獲利交易次數	119
	勝率	36.84%	虧損交易次數	202
	平均交易	0.42%	平均獲利交易	5.33%
	平均獲利虧損比	2.15	平均虧損交易	-2.48%
	最大獲利交易	46.20%	最大虧損交易	-26.94%
	最大區間獲利	152.44%	最大區間虧損	-80.50%
	全部交易的平均持倉K線根數	5.45	獲利交易的平均持倉K線根數	7.28
	回測K線根數	1444	虧損交易的平均持倉K線根數	4.40
	時間加權報酬	459.63%	最大投入報酬率	19.67%
	買進持有報酬	98.30%	大盤指數報酬	104.24%

# 純作多RSI績效



# 純作多績效勝率為46%，獲利因子接近2

回測報告[自動交易]:短期RSI黃金交叉長期RSI(系統) (執行時間:10:58:41) (未儲存) - XQ全球贏家(企業版)

儲存 匯出 重新回測

整體統計

每日報表

商品統計表

商品分析

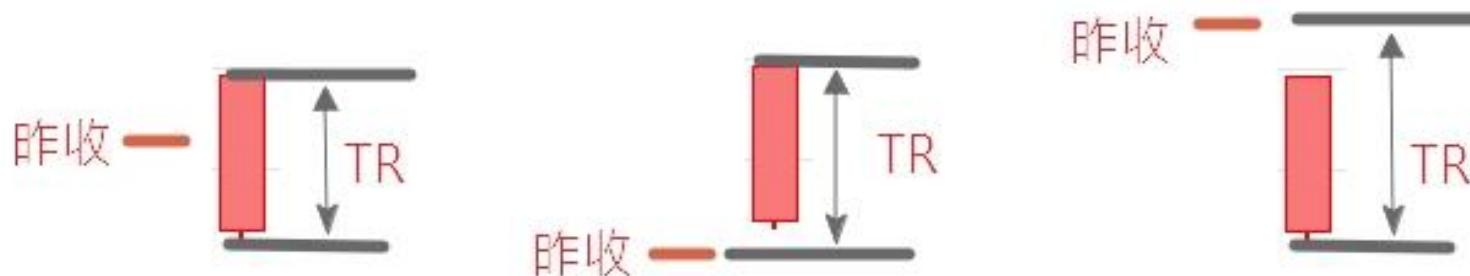
交易分析

腳本資料

腳本設定	淨利	166.00%	毛利	337.36%
短期RSI黃金交叉長期RSI(短期期數=6, 長期期數=12)	獲利因子	1.97	毛損	-171.36%
	總交易成本	15.20%	最大投入金額	2,460,800
	總交易次數	152	獲利交易次數	70
	勝率	46.05%	虧損交易次數	81
	平均交易	1.09%	平均獲利交易	4.82%
	平均獲利虧損比	2.28	平均虧損交易	-2.12%
	最大獲利交易	35.90%	最大虧損交易	-12.30%
	最大區間獲利	170.93%	最大區間虧損	-43.46%
	全部交易的平均持倉K線根數	5.37	獲利交易的平均持倉K線根數	6.93
	回測K線根數	1368	虧損交易的平均持倉K線根數	4.06
	時間加權報酬	94.00%	最大投入報酬率	67.46%
	買進持有報酬	97.16%	大盤指數報酬	102.97%

## ATR平均真實波幅指標

- 英文名稱-Average True Range ,
- 將真實波動幅度做算術平均





# ATR的運用

- 月線  $\pm 20$ 日ATR，收盤價突破時買進，跌破時放空，回到通道時平倉。
- 判斷市場的波動，當ATR指標的數值開始放大，表示最近行情的波動範圍越大。
- 動態調整停損停利設定

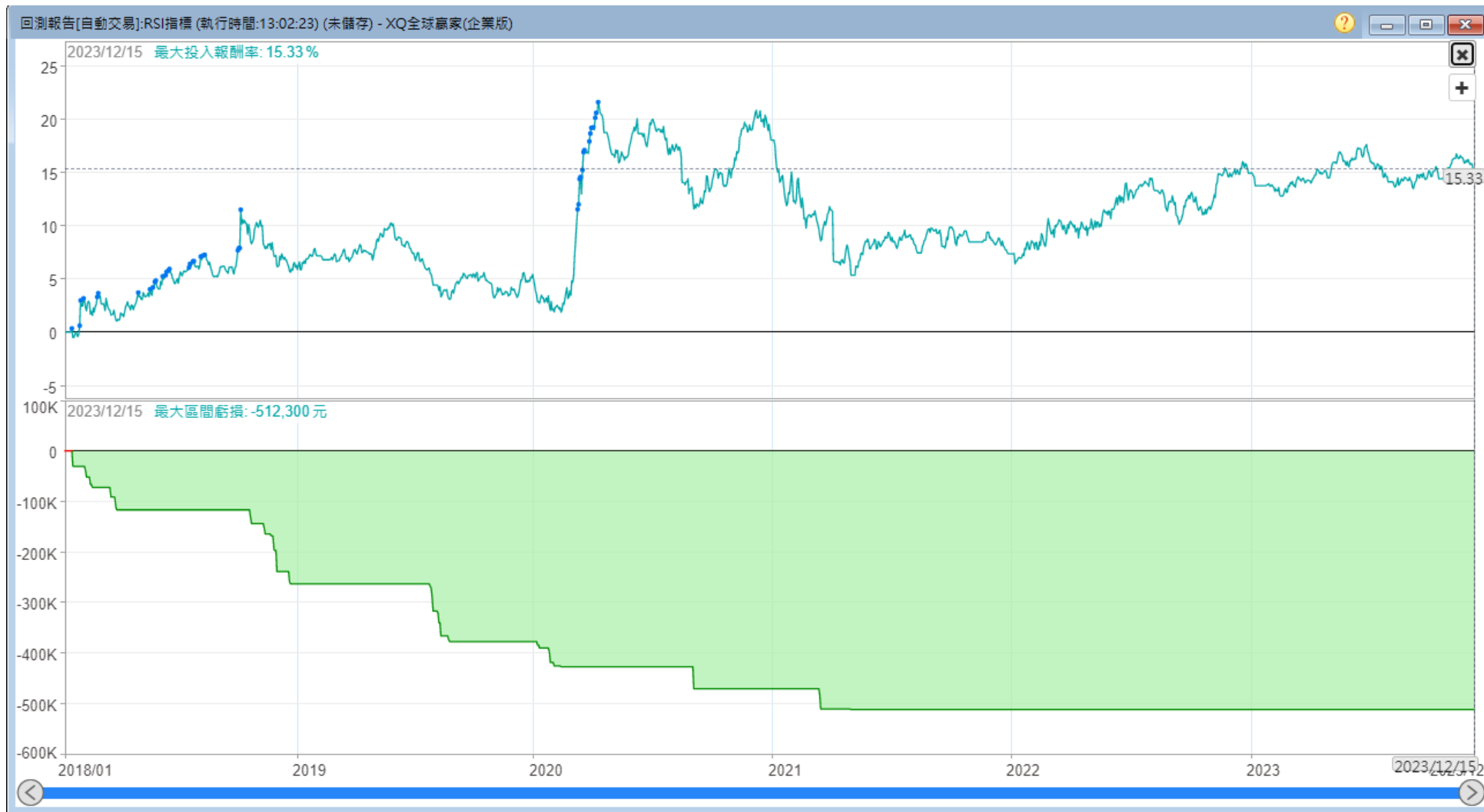


# 回測績效檢視

		全部	做多	做空	%	\$
道	淨利				137.60%	三
	獲利因子				2.50	三
	總交易成本				0.46%	三
	總交易次數				23	三
	勝率				43.48%	三
	平均交易				5.98%	三
	平均獲利虧損比				3.25	三
	以上獲利之月				77.00%	三

		全部	做多	做空	%	\$
道	淨利				-75.04%	三
	獲利因子				-0.54	三
	總交易成本				0.44%	三
	總交易次數				22	三
	勝率				27.27%	三
	平均交易				-3.41%	三
	平均獲利虧損比				...	三
	以上獲利之月				...	三

# 搭配RSI做停損-2倍ATR

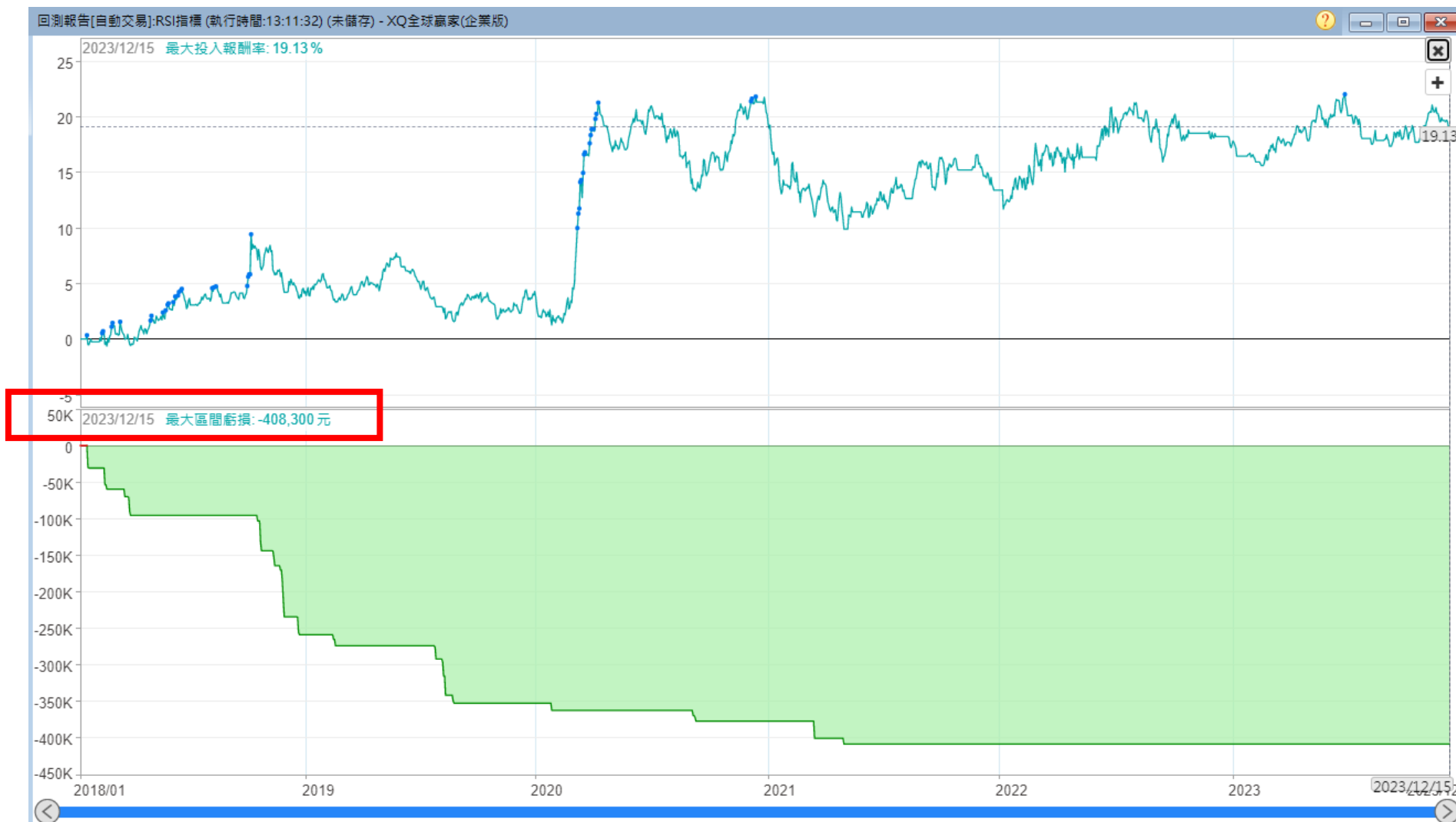


# 勝率降為36%，獲利因子1.26，淨利率提高10%





# 搭配RSI做停損-1倍ATR



## 改為突破1倍通道後停損，淨利率下降

腳本設定		全部 做多 做空		% \$	
RSI指標(短期期數=6, 長期期數=12, 計算TrueRange的區間=20, N倍通道=1)	淨利	125.94%	毛利	619.14%	
	獲利因子	1.26	毛損	-493.20%	
	總交易成本	35.30%	最大投入金額	6,584,600	
	總交易次數	353	獲利交易次數	130	
	勝率	36.83%	虧損交易次數	218	
	平均交易	0.36%	平均獲利交易	4.76%	
	平均獲利虧損比	2.11	平均虧損交易	-2.26%	
	最大獲利交易	46.20%	最大虧損交易	-26.94%	
	最大區間獲利	147.76%	最大區間虧損	-40.83%	
	全部交易的平均持倉K線根數	4.37	獲利交易的平均持倉K線根數	6.38	
	回測K線根數	1444	虧損交易的平均持倉K線根數	3.20	
	時間加權報酬	383.37%	最大投入報酬率	19.13%	
	買進持有報酬	98.30%	大盤指數報酬	104.24%	

# 作空績效改善

交易設定 安控: 單一商品最大部位:無限制, 單一商品每日最多進場次數:無限制 初始資金: 100萬元 交易費用: 股票0.2%(成交金額)、期貨500元(口) 每日部位歸零: 關閉				
<div>             全部 做多 做空 % \$           </div>				
腳本設定	淨利	-13.82%	毛利	292.60%
RSI指標(短期期數=6, 長期期數=12, 計算TrueRange的區間=20, N倍通道=2)	獲利因子	-0.95	毛損	-306.42%
	總交易成本	18.40%	最大投入金額	10,319,600
	總交易次數	184	獲利交易次數	51
	勝率	27.72%	虧損交易次數	131
	平均交易	-0.08%	平均獲利交易	5.74%
	平均獲利虧損比	2.45	平均虧損交易	-2.34%
	最大獲利交易	46.20%	最大虧損交易	-18.44%
	最大區間獲利	167.64%	最大區間虧損	-51.23%
	全部交易的平均持倉K線根數	4.55	獲利交易的平均持倉K線根數	7.31
	回測K線根數	1444	虧損交易的平均持倉K線根數	3.49
	時間加權報酬	71.46%	最大投入報酬率	-1.34%
	買進持有報酬	98.30%	大盤指數報酬	104.24%

交易設定 安控: 單一商品最大部位:無限制, 單一商品每日最多進場次數:無限制 初始資金: 100萬元 交易費用: 股票0.2%(成交金額)、期貨500元(口) 每日部位歸零: 關閉				
<div>             全部 做多 做空 % \$           </div>				
腳本設定	淨利	3.80%	毛利	283.50%
RSI指標(短期期數=6, 長期期數=12, 計算TrueRange的區間=20, N倍通道=1)	獲利因子	1.01	毛損	-279.70%
	總交易成本	18.10%	最大投入金額	7,857,000
	總交易次數	181	獲利交易次數	54
	勝率	29.83%	虧損交易次數	123
	平均交易	0.02%	平均獲利交易	5.25%
	平均獲利虧損比	2.31	平均虧損交易	-2.27%
	最大獲利交易	46.20%	最大虧損交易	-26.94%
	最大區間獲利	147.76%	最大區間虧損	-40.83%
	全部交易的平均持倉K線根數	4.33	獲利交易的平均持倉K線根數	6.48
	回測K線根數	1444	虧損交易的平均持倉K線根數	3.41
	時間加權報酬	70.31%	最大投入報酬率	0.48%
	買進持有報酬	98.30%	大盤指數報酬	104.24%

# 市場上的策略-RSI

<a href="#">KV皮卡秋</a>	台股期貨	全時段	波段	雙向	<p>商品：台指（全時段）</p> <p>說明：台指期波段策略，多單以RSI超買作依據，空單則以跌破多單進場點作為反向進場，搭配停損停利與移動停利</p> <p>屬性：波段/雙向/最大口數1口/不加碼</p> <p>風險：請參考MDD數值；請留意夜盤因流動性不足而造成的大幅滑價風險</p> <p>停損：固定停損+百分比停損</p> <p>分級：C5進階型</p>
<a href="#">JS安本003</a>	台股期貨	全時段	波段	雙向	<p>說明：RSI順勢交易策略，並加入反手做單機制</p> <p>屬性：波段/雙向/最大口數1口/不加碼</p> <p>停損：百分比停損</p>
<a href="#">風華FT30K</a>	台股期貨	全時段	波段	雙向	<p>說明：本策略以RSI交叉作為搭配技術指標輔以平均線穿越作為進出依據基礎。</p> <p>屬性：波段/雙向/最大口數1口/不加碼。</p> <p>停損：百分比停損。</p>





# 使用ATR停損的策略

FJ月尊50號	臺股期貨	全時段	波段	雙向	說明：台指期全天盤波段策略，當特定時間價格突破區間高點多單進場，當特定時間價格突破區間低點空單進場本策略具有百分比停利、ATR停損、移動停利 屬性：雙向/波段 風險：請參考MDD數值，歷史績效僅供參考，不代表未來保證獲利 <b>停損邏輯：ATR停損</b>
CT阿拉密004	臺股期貨	日盤	波段	多	說明：根據期貨與現貨價格本身走勢和各個指標的搭配來判斷目前位置，若判斷行情將發動即進場，此策略為順勢操作。 屬性：波段/只做多/不加碼 停損說明：個別策略皆有附加停損模組，系統會依照市況行情判斷選擇以固定停損、移動停損、 <b>平均真實波幅(ATR)停損</b> 等方式出場以避免單筆交易損失過大 ★本策略因有使用換月價差還原資料，故不提供歷史回測資料★
智富寶27	臺股期貨	全時段	波段	空	說明：台指期波段空方策略，以籌碼動向作為判斷依據，監控短線籌碼變化，若判斷空方籌碼勝出就會進場，進出較波段策略彈性。 屬性：單向做空 停損：個別策略皆有附加停損模組，系統會依照市況行情判斷選擇以%固定停損、移動停損、 <b>平均真實波幅(ATR)停損</b> 等方式出場以避免單筆交易損失過大。
CT孟章一號	臺股期貨	全時段	波段	雙向	說明：根據價格本身走勢與轉折高低點來判斷目前位置，若判斷行情將發動即進場，此策略為順勢操作。 屬性：波段/雙向 停損說明：個別策略皆有附加停損模組，系統會依照市況行情判斷選擇以固定停損、移動停損、 <b>平均真實波幅(ATR)停損</b> 等方式出場以避免單筆交易損失過大
FJ迅雷31號	臺股期貨	日盤	波段	空	說明：台指期短線空方策略，當價格突破低點加波動值進場，本策略 <b>具有ATR停利、ATR停損</b> 屬性：波段型/只做空/無加碼 停損：ATR停損
FJ獵鷹41號	臺股期貨	日盤	短波段	多	★提醒您，本策略交易頻率較低建議與其他策略搭配使用★ 說明：台指期短線多方策略，當特定時間突破區間高點多單進場，平均持倉時間一天，本策略具有百分比停利、ATR停損 屬性：短波段/只做多/不加碼 風險：C4積極型 停損： <b>ATR停損</b> 建議於判斷行情處於多方勢時再進行訂閱，或是訂閱組合包。
CT阿多斯006	臺股期貨	日盤	波段	多	策略說明：根據價格本身走勢與各個指標的搭配來判斷目前位置，若判斷行情將發動即進場，此策略為順勢操作。 屬性：波段/只做多 停損說明：個別策略皆有附加停損模組，系統會依照市況行情判斷選擇以固定停損、移動停損、 <b>平均真實波幅(ATR)停損</b> 等方式出場以避免單筆交易損失過大
W15	臺股期貨	全時段	波段	空	說明：偵測空方趨勢指標，條件符合時進場做空。建倉後，反向轉折訊號出現即出場。 屬性：只做空/波段型 停損說明：個別策略皆有附加停損模組，系統會依照市況行情判斷選擇以%固定停損、移動停損、 <b>平均真實波幅(ATR)停損</b> 等方式出場以避免單筆交易損失過大。
CT監兵三號	臺股期貨	全時段	波段	雙向	說明：根據價格本身走勢來判斷目前位置，若判斷行情將發動即進場，此策略為順勢操作。 屬性：波段/雙向 停損：個別策略皆有附加停損模組，系統會依照市況行情判斷選擇以固定停損、移動停損、 <b>平均真實波幅(ATR)停損</b> 等方式出場以避免單筆交易損失過大
智富寶11	臺股期貨	全時段	波段	多	★本策略因有使用換月價差還原資料，故不提供歷史回測資料★ 說明：台指期波段多方策略，偵測趨勢線作為判斷多空方向，若趨勢偏多且價格突破區間就會進場。建倉後，反向轉折訊號出現即出場。搭配智富系列策略的停利與停損機制，達到最佳效果。 屬性：只做多/波段/全時段 停損：個別策略皆有附加停損模組，系統會依照市況行情判斷選擇以%固定停損、移動停損、平均真實波幅(ATR)停損等方式出場以避免單筆交易損失過大。
智富寶07	臺股期貨	日盤	波段	空	說明：偵測空方趨勢指標，條件符合時進場做空。建倉後，反向轉折訊號出現即出場。當行情處於多方趨勢時可能會無訊號，建議於判斷行情處於空方勢時再進行訂閱，或是訂閱組合包。 屬性：只做空不做多/波段型/最大口數一口/無加碼 停損說明：個別策略皆有附加停損模組，系統會依照市況行情判斷選擇以%固定停損、移動停損、平均真實波幅(ATR)停損等方式出場以避免單筆交易損失過大。
FJ樂空14	臺股期貨	日盤	波段	空	說明：台指期波段空方策略，當價格呈現連續下跌時進場，本策略 <b>具有ATR移動停利、ATR停損</b> 屬性：波段/只做空/不加碼 停損邏輯說明：ATR停損
W60	臺股期貨	全時段	波段	空	策略說明：偵測空方趨勢指標，條件符合時進場做空。建倉後，反向轉折訊號出現即出場。 屬性：只做空不做多/波段型/最大口數一口/無加碼 停損說明：個別策略皆有附加停損模組，系統會依照市況行情判斷選擇以%固定停損、移動停損、 <b>平均真實波幅(ATR)停損</b> 等方式出場以避免單筆交易損失過大。
智富寶21	臺股期貨	全時段	波段	空	★本策略因有使用換月價差還原資料，故不提供歷史回測資料★ 說明：台指期波段空方策略，偵測趨勢線作為判斷多空方向，若趨勢偏空且價格跌破區間就會進場。建倉後，反向轉折訊號出現即出場。搭配智富系列策略的停利與停損機制，達到最佳效果。當行情處於多方趨勢時可能會無訊號，建議於判斷行情處於空方勢時再進行訂閱。 屬性：單向做空/不加碼 停損：個別策略皆有附加停損模組，系統會依照市況行情判斷選擇以%固定停損、移動停損、 <b>平均真實波幅(ATR)停損</b> 等方式出場以避免單筆交易損失過大。
CT金巴利	臺股期貨	全時段	波段	雙向	說明：參考指標KD，根據價格本身走勢與指標高低點來判斷目前位置，若判斷行情將發動即進場，此策略為順勢操作。 屬性：波段/雙向 停損：個別策略皆有附加停損模組，系統會依照市況行情判斷選擇以固定停損、移動停損、 <b>平均真實波幅(ATR)停損</b> 等方式出場以避免單筆交易損失過大
智富寶22	臺股期貨	全時段	波段	空	★本策略因有使用換月價差還原資料，故不提供歷史回測資料★ 說明：台指期波段空方策略，偵測趨勢線作為判斷多空方向，若趨勢偏空且價格跌破區間就會進場。建倉後，反向轉折訊號出現即出場。搭配智富系列策略的停利與停損機制，達到最佳效果。此策略整合日盤模組與夜盤模組兩套子系統做判斷，以達到全時段交易的功效。 屬性：波段/只做空/最大口數一口/不加碼 停損：個別策略皆有附加停損模組，系統會依照市況行情判斷選擇以%固定停損、移動停損、 <b>平均真實波幅(ATR)停損</b> 等方式出場以避免單筆交易損失過大
智富寶25	臺股期貨	全時段	波段	空	★本策略因有使用換月價差還原資料，故不提供歷史回測資料★ 說明：台指期波段空方策略，以區間突破作為判斷多空方向，建倉後，反向轉折訊號出現即出場。搭配智富系列策略的停利與停損機制，達到最佳效果。 屬性：只做空/波段/全時段 停損：個別策略皆有附加停損模組，系統會依照市況行情判斷選擇以%固定停損、移動停損、 <b>平均真實波幅(ATR)停損</b> 等方式出場以避免單筆交易損失過大。
W55	臺股期貨	日盤	波段	空	說明：偵測空方趨勢指標，條件符合時進場做空。建倉後，反向轉折訊號出現即出場。 屬性：只做空/波段型/ 停損說明：個別策略皆有附加停損模組，系統會依照市況行情判斷選擇以%固定停損、移動停損、 <b>平均真實波幅(ATR)停損</b> 等方式出場以避免單筆交易損失過大。
智富寶26	臺股期貨	全時段	波段	空	說明：台指期波段空方策略，以區間突破作為判斷多空方向，建倉後，反向轉折訊號出現即出場。搭配智富系列策略的停利與停損機制，達到最佳效果。 屬性：只做空/不加碼/波段 停損：個別策略皆有附加停損模組，系統會依照市況行情判斷選擇以%固定停損、移動停損、 <b>平均真實波幅(ATR)停損</b> 等方式出場以避免單筆交易損失過大

# RSI策略績效參考

	類型	多空	目前 部位	訊號日期	月份勝 率 策略勝 率	98.1%	98.3%	95.0%	75.4%	65.6%	41.0%	41.0%	26.2%	75.4%
						2019	2020	2021	2022	2023	2023/08	2023/09	2023/10	2023/11
<a href="#">JS安本003</a>	波段	雙向	1	2023/11/21	70.7%	\$506,800	\$1,292,000	\$823,400	\$12,600	\$375,800	-\$73,800	-\$25,800	\$9,800	\$199,000
<a href="#">風華FT30K</a>	波段	雙向	1	2023/11/21	60.3%	\$310,200	\$357,800	\$54,200	\$79,600	\$331,800	-\$1,800	-\$4,400	-\$20,800	\$148,000
<a href="#">KV皮卡秋</a>	波段	雙向	-1	2023/11/21	72.4%	\$236,400	\$375,000	\$1,075,600	\$1,442,400	-\$288,800	-\$161,000	\$106,800	-\$111,000	-\$51,600

# ATR停損策略績效參考

	類型	多空	目前部位	訊號日期	月份勝率 策略勝率	98.1% 2019	98.3% 2020	95.0% 2021	75.4% 2022	65.6% 2023	41.0% 2023/08	41.0% 2023/09	26.2% 2023/10	75.4% 2023/11
<a href="#">智富寶11</a>	波段	多	1	2023/11/15	29.4%			\$89,800	-\$308,600	\$463,200	-\$87,400	-\$17,600	-\$71,800	\$190,200
<a href="#">CT孟章一號</a>	波段	雙向	1	2023/11/21	58.6%	\$358,800	\$176,800	\$125,800	\$180,400	\$235,000	\$67,200	-\$11,000	-\$27,000	\$154,000
<a href="#">CT阿多斯006</a>	波段	多	0	2023/11/13	53.4%	\$255,800	\$325,800	-\$4,400	-\$137,000	\$311,000	\$39,600	\$6,400	\$13,200	\$93,400
<a href="#">FJ月尊50號</a>	波段	雙向	1	2023/11/21	67.2%	\$248,400	\$883,000	\$589,000	\$411,400	-\$44,600	-\$118,600	-\$49,600	-\$85,400	\$75,400
<a href="#">CT金巴利</a>	波段	雙向	0	2023/11/21	50.0%	\$243,000	\$166,400	\$9,200	-\$6,600	-\$100,600	-\$33,600	-\$18,200	\$18,600	\$57,000
<a href="#">CT阿拉密004</a>	波段	多	1	2023/11/21	56.9%	\$352,200	\$260,400	\$203,400	-\$145,800	\$68,000	\$8,000	\$23,000	-\$26,000	\$51,400
<a href="#">W15</a>	波段	空	0	2023/10/24	24.1%	\$19,800	\$385,000	\$22,400	\$99,200	-\$150,400	-\$6,000	-\$26,800	-\$12,800	\$0
<a href="#">W55</a>	波段	空	0	2023/10/24	17.2%	\$70,400	\$66,800	-\$191,600	\$56,600	-\$202,800	-\$5,200	-\$19,600	-\$12,400	\$0
<a href="#">W60</a>	波段	空	0	2023/10/24	17.2%	\$19,400	\$390,800	-\$112,400	\$10,600	-\$175,400	-\$22,800	-\$30,600	-\$11,800	\$0
<a href="#">智富寶07</a>	波段	空	0	2023/10/20	34.5%	\$122,000	\$129,600	\$119,000	\$43,000	-\$118,400	\$9,000	\$7,600	-\$9,200	\$0
<a href="#">智富寶22</a>	波段	空	0	2023/11/1	32.4%			\$14,000	\$150,200	-\$159,600	\$23,000	-\$8,400	\$51,400	-\$17,800
<a href="#">FJ獵鷹41號</a>	短波段	多	0	2023/11/14	32.8%	\$42,600	\$195,000	\$178,000	\$132,600	-\$65,000	\$0	\$0	-\$15,000	-\$29,000
<a href="#">智富寶27</a>	波段	空	0	2023/11/1	50.0%		\$137,000	\$349,600	\$271,800	-\$233,200	-\$80,200	\$5,600	-\$79,200	-\$34,400
<a href="#">FJ迅雷31號</a>	波段	空	0	2023/11/13	43.1%	\$11,000	\$205,600	\$163,000	\$283,800	-\$86,800	-\$52,400	\$52,200	-\$9,400	-\$56,200

## 結論

- RSI適合多頭市場使用，尤其當下走多的盤勢，或偏多的主流類股
- ATR做空方策略的停損有絕佳的表現



# 回測的程式碼

```

1 // 宣告參數
2 input: ShortLength(6, "短期期數"), LongLength(12, "長期期數"), period(20, "計算TrueRange的區間"), N(2, "N倍通道");
3 var: RSI_Short(0), RSI_Long(0);
4
5 // 設定資料讀取筆數
6 settotalbar(maxlist(ShortLength, LongLength, 6) * 8 + 8);
7
8
9 RSI_Short=RSI(Close, ShortLength);
10 RSI_Long=RSI(Close, LongLength);
11 value1=average(truerange, period);
12 value2=average(close, period);
13 value3=value2+N*value1;
14 value4=value2-N*value1;
15
16 //多方進場策略：短期RSI黃金交叉長期RSI；空方進場策略：短期RSI死亡交叉長期RSI
17 if RSI_Short Crosses Above RSI_Long then setposition(1);
18 if RSI_Short Crosses below RSI_Long then setposition(-1);
19
20 // 空方出場策略：向上突破上通道。多方出場策略：向下跌破下通道。
21 if position = 1 then begin;
22 if close crosses below value4 then setposition(0);
23 end;
24
25 if position = -1 then begin;
26 if close crosses over value3 then setposition(0);
27 end;

```

