LLT + Garch model

類型：Trend following

使用指標

LLT（低延遲趨勢線）：使用通信領域的低通濾波器建構，當作均線

Garch model（快線）：捕捉波動，並加減LLT建構通道（藍線）

平滑Garch（慢線）：用20天平滑快線

中線：快線是平坦的平均

A graph showing a line graph

AI-generated content may be incorrect.

進出場邏輯

判斷市場狀態

牛市：快線明確向上時

熊市：快線明確向下時

Entry long：處於牛市、LLT上揚，並且快線上升的夠多

Entry short：處於熊市、LLT下降，並且快線下降的夠多

Exit long / short：移動出場

測試

使用標的：加權指數（^TWII）

資料期間：2018-01-01 ~ 2024-08-10

資料頻率：日K

手續費（單邊）：600

回測方式：Rolling window

每個window切樣本內外，0.7 / 0.3

共10個windows

績效

平均持有期間：23.825 days

交易次數：40 times

報酬率：179.75 %

CAGR：14.75 %

Sharpe：1.22

MDD：-23.62

Profit factor：1.29

A graph of stock market

AI-generated content may be incorrect.

A graph of a graph showing the number of the year

AI-generated content may be incorrect.