



台指期交易策略

施彥安

目錄

- 相關資訊
- 使用指標
- 交易邏輯(做多)
- 使用參數
- 回測績效
- 做多加碼
- 程式碼連結

相關資訊

商品：台指期

週期：60 分K

交易時段：全日盤

樣本內區間：2010/01/01 ~ 2019/12/31

樣本外區間：2020/01/01 ~ 2023/06/30

本金：1,000,000 TWD

手續費：單邊一口 600 TWD(大台)

使用指標

1. RSI

- 用途: 用來判斷相對走勢強弱, 進一步推測未來走勢可能漲或是跌

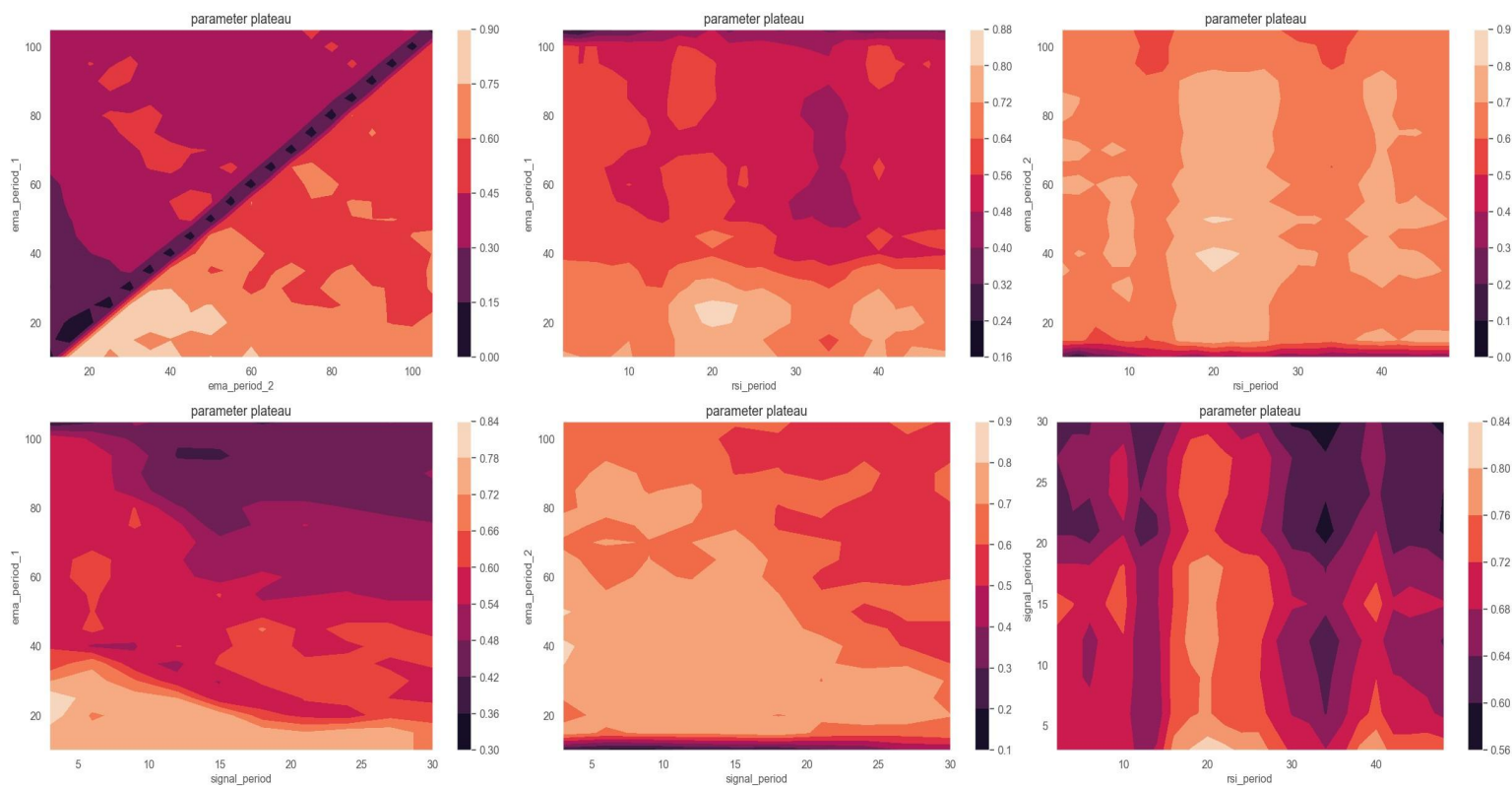
2. MACD

- 用途: 用來確定波段漲幅並找到買賣點
- 組成:
 - MACD : 短週期 EMA 減 長週期 EMA
 - Signal : 將 MACD 線取指數移動平均 EMA
 - 柱狀圖 : 將 MACD 減掉Signal得到柱狀圖

交易邏輯(做多)

- 進場: MACD 向上突破 Signal
- 出場: MACD 向下跌破 Signal 且 $RSI < 50$
- 停損: 以達成進場條件當作關鍵 K 棒, 並設其最低點為停損點
- 換月轉倉: 結算日當天直接平倉
- 進場限制: 結算日當天不進場

使用參數

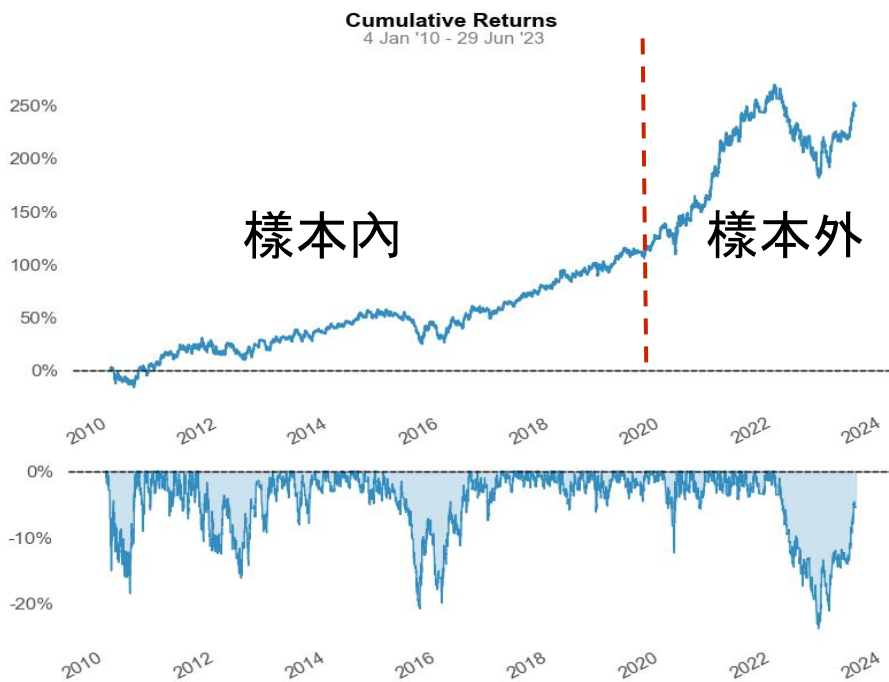


使用兩兩參數繪製參數高原，在進行參數優化：

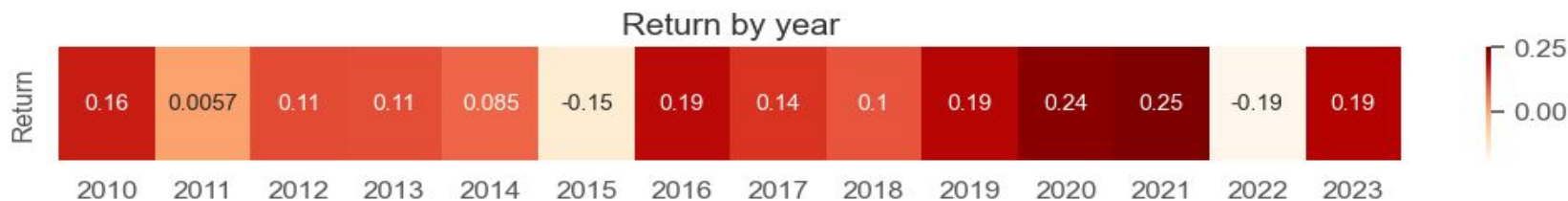
RSI : 22

MACD : 25 , 45 , 6

回測績效



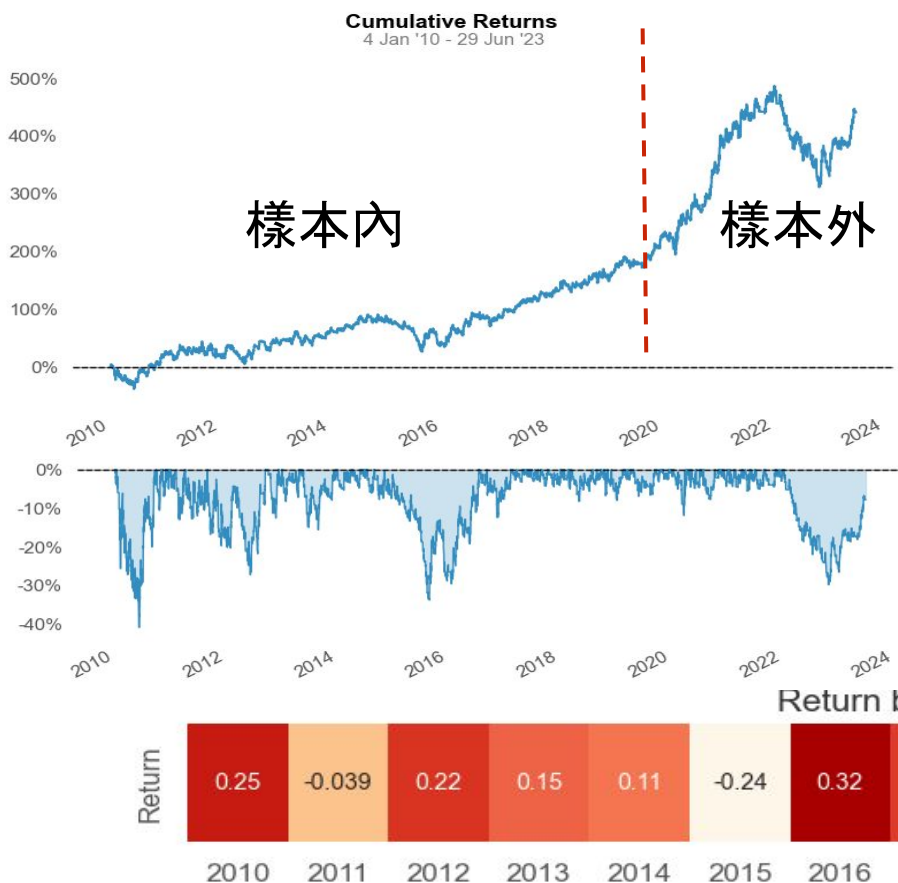
績效指標	樣本內	樣本外	全樣本
累積報酬	126.72%	124.9%	249.72%
年化報酬	5.82%	17.39%	6.62%
年化波動度	6.27%	10.88%	6.06%
MDD(%)	26.17%	33.72%	23.84%
年化夏普	0.928	1.635	1.092
風報比	4.85	3.7	10.48
勝率	29.88%	31.79%	42.24%



做多加碼

加碼條件：當市場價格朝著預期方向發展(市場價高於進場價)

加碼數量：每次加碼都增加持倉數一倍



績效指標	樣本內	樣本外	全樣本
累積報酬	189.06%	206%	440.96%
年化報酬	7.61%	24.76%	9.02%
年化波動度	16.81%	18.56%	10.1%
MDD(%)	59.56%	49.94%	41.05%
年化夏普	0.453	1.332	0.893
風報比	3.17	4.12	10.74
勝率	55.37%	37.5%	37.47%

程式碼連結

- <https://github.com/anthonyshih/TMBA>



感謝聆聽，敬請指教