



VIX-William回檔交易策略

組員：陳柏融

策略資訊

商品：台指期

週期：日K

交易時段：日盤

樣本內區間：2009/1/1 ~ 2019/12/31

樣本外區間：2020/1/1 ~ 2025/6/30

手續費：單邊600

初始資金：1,000,000

策略邏輯 & 參數

市場恐慌與情緒波動 (VIX): VIX 高 → 市場恐慌 → 大盤可能短期反彈或回檔加劇

威廉指標 (Williams %R): 判斷短線超買超賣區間, 找短線反轉點
當市場恐慌 (VIX 高) + 威廉指標顯示超賣 → 進場做多 (預期短線反彈); 反之則可能做空或觀望。

進場邏輯: 當 Williams %R < -95 and VIX > 18 進場

出場邏輯: 當 Williams %R > -1 出場

交易限制: 只做多, 一次只交易一口, 如果出現多個訊號會先把原本的部位平倉, 手中永遠只保留一口的部位

參數選擇邏輯

最大化Sharp, 並且選擇樣本內穩定的參數避免過擬合



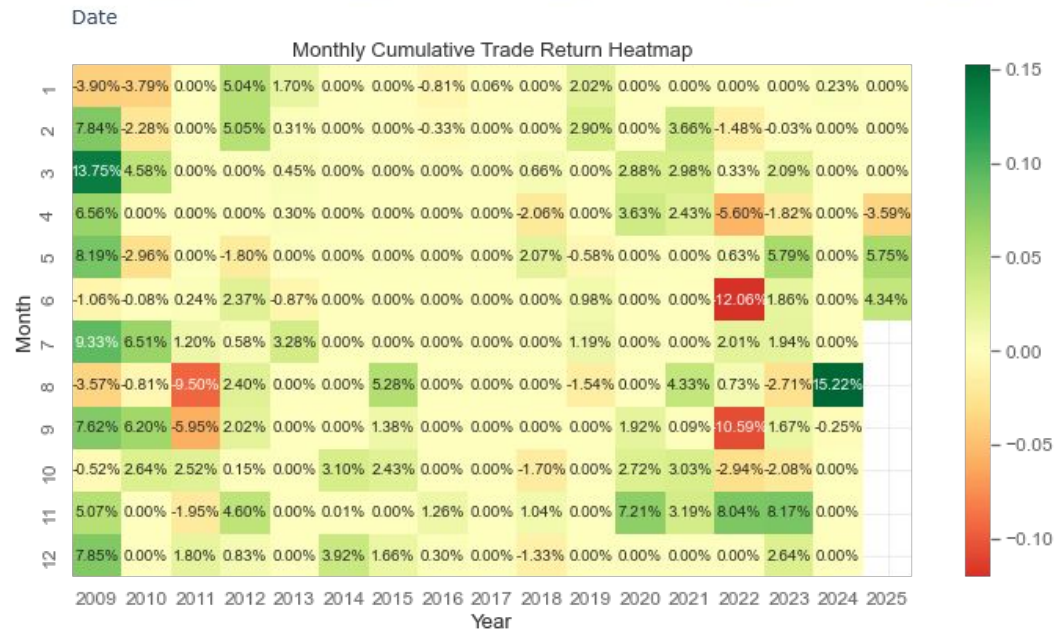
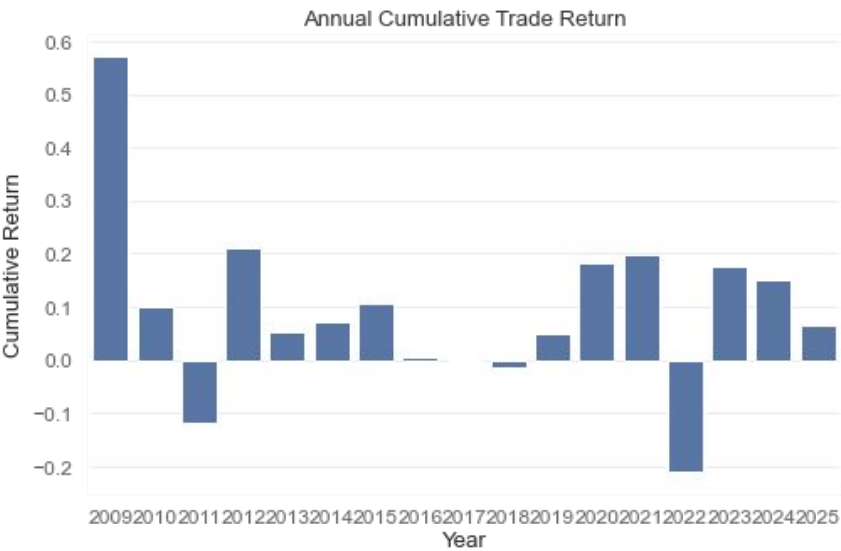
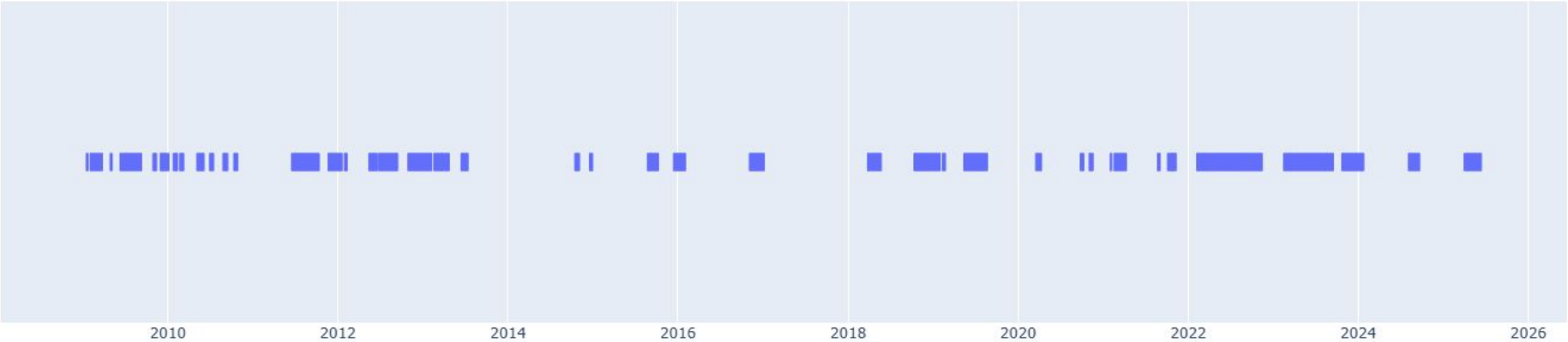
策略績效總結結果



	全樣本	樣本內	樣本外
年化報酬	0.09	0.09	0.10
年畫波動度	0.12	0.10	0.14
MDD	0.29	0.19	0.29
年化夏普	0.86	0.97	0.75
風報比	11.86	8.67	2.28

其他績效圖表

Trading Days Timeline





感謝聆聽，敬請指教