



# 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 0.0003

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



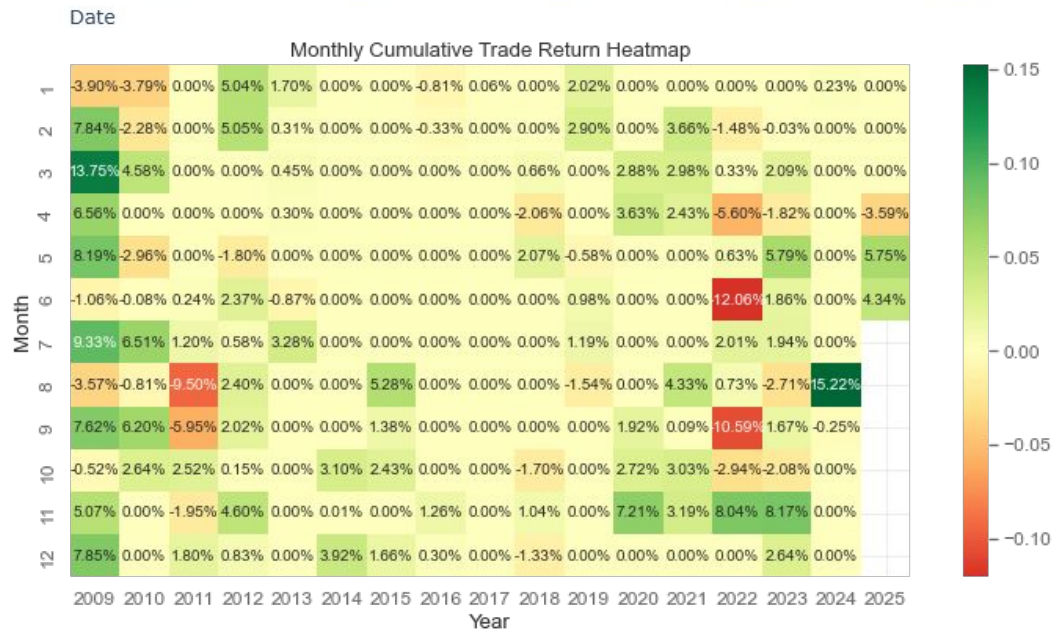
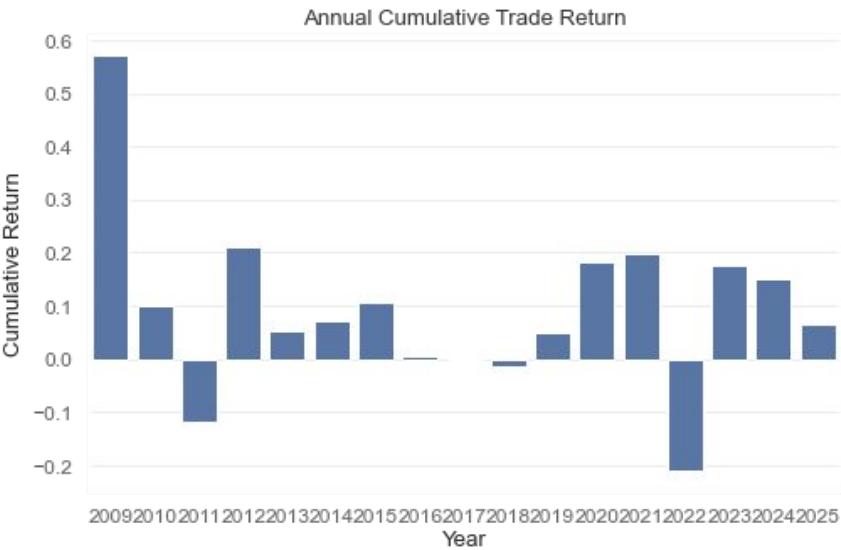
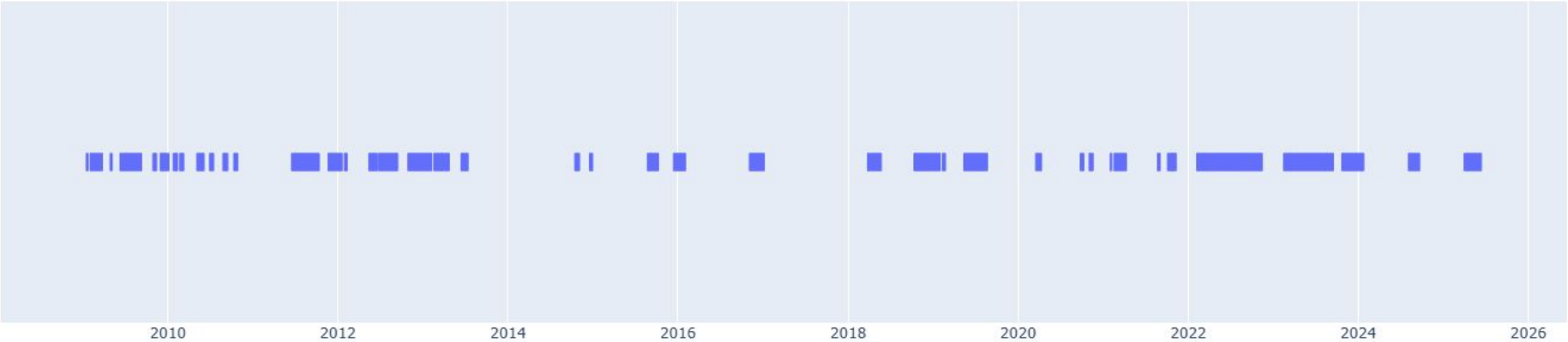
# 策略績效總結結果



	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**