

回測標的：台灣 50(0050)

回測設定：

1. 日線，不考慮交易成本，每日收盤判斷條件，若符合則隔日開盤價進場。
2. 進場張數=100 萬元/當日收盤價/1000，無條件捨去至整數位。以進場張數做為明天開盤進場的張數。
3. 若 A 進場條件符合，隔天進場。5 天後 B 進場條件也符合，則不再進場，因為資金已用掉，沒錢了。
4. 出場則為全部庫存出清。
5. 回測期間：2004/1/1~2018/12/28

● 定義參數：

- $C$  = 收盤價(Close)。
- $SL$  = 停損價(StopLoss)=進場價\*0.8。
- $TG$  = 停利價(TarGet)=進場價\*1.6。
- $MA$  = 均線(Moving Average)= 120 日均線
- $BD$  = 低點(Bollingerband Down)=  $MA - 0.75$  倍的 120 日標準差
- $BU$  = 高點(Bollingerband Up)=  $MA + 0.75$  倍的 120 日標準差
- $C[1]$ =前一收盤價， $C[2]$ =前二收盤價， $BD[3]$ =前三  $BD$ 。中括號 $[X]$ 代表前  $X$  個的值