

台指期結算日傾向回測

概述

分析台指期貨在結算日的價格傾向模式，並建立相應的交易策略。

資料規格要求

時間範圍

- ****起始時間****：2015 年夜盤開始
- ****結束時間****：2025 年 9 月
- ****資料頻率****：日 K 線資料（包含開高低收、成交量）

結算週期定義

1. ****週選結算****

- 結算日：每週三
- 開倉日：結算後第一個交易日

2. ****月選結算****

- 結算日：每個月第三個週三
- 開倉日：結算後第一個交易日

核心策略邏輯

觀察指標

計算從開倉日開盤價到結算前一天收盤價（或結算當天開盤價）的台指移動方向，用以預測結算日當天開盤到結算價的方向。

交易策略

****基礎策略公式：****

、、、

趨勢指標 = 結算前一天收盤價 - 開倉日開盤價

、、、

****交易規則：****

- 若趨勢指標 > 0：結算日開盤做多台指期，收盤平倉（或持倉參與結算）
- 若趨勢指標 < 0：結算日開盤做空台指期，收盤平倉（或持倉參與結算）

進階濾網條件

技術面濾網

1. ****前一日 K 線型態****

- 紅 K/黑 K 分類
- K 線實體大小
- 上下影線比例

2. ****開高開低判斷****

- 開高/低

籌碼面濾網(加分項)

法人籌碼分析（未平倉量）

- 三大法人未平倉部位變化
- 外資、投信、自營商個別部位方向
- 總未平倉量增減變化
- 大額交易人未平倉集中度

資料處理

- [] 台指期歷史價格資料
- [] 結算日期自動識別（週選/月選）
- [] 開倉日計算
- [] (加分項)法人籌碼資料整合

濾網分析

1. **台指方向**：往上 vs 往下
2. **昨紅黑 K**：紅 K vs 黑 K
3. **開盤位置**：高 vs 低
4. 其他加分項

必要統計欄位

報表必須包含以下所有統計指標：

1. **基礎交易統計**

- 淨利：總獲利%數
- 總獲利：所有獲利交易的%數總和
- 總虧損：所有虧損交易的%數總和（負數顯示）
- 最大獲利：單筆最大獲利%數
- 最大虧損：單筆最大虧損%數（負數顯示）

2. **交易次數統計**

- 勝次：獲利交易次數
- 敗次：虧損交易次數
- 總次：總交易次數

3. **績效比率**

- 勝均：平均每筆獲利交易獲利%
- 敗均：平均每筆虧損交易虧損%（負數顯示）
- 無歸類：平衡交易次數（損益為 0）
- 總次：總交易次數統計
- 筆均：平均每筆交易損益

4. **關鍵績效指標**

- EventRate：事件發生率（以百分比顯示，如 96.8%）
- 盈虧比：平均獲利%數/平均虧損%數的比率
- 勝率：獲利交易次數/總交易次數（百分比）
- 凱利：凱利公式計算值（百分比）
- 最大回撤：策略執行期間的最大資金回撤

報表輸出格式

- 百分比欄位：顯示到小數點後 2 位，如 96.8%
- 比率欄位：顯示到小數點後 3 位，如 1.303
- 回落欄位：負數顯示，如-17%

注意事項

1. 確保資料的準確性和完整性
2. 可考慮夜盤交易對策略的影響
3. 注意結算日期的例外情況（國定假日調整）