

商品：台指期

週期：日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

手續費：來回1200

策略邏輯

**策略主邏輯: 只做多單，可加碼，用SAR + ADX指標
進場，吃大波段紅利**

進場邏輯：收盤價小於SAR，ADX大於25且收盤價突破60日均線，下一根開盤價以市價進場

出場邏輯：收盤價大於SAR，ADX大於25且收盤價跌破10日均線，下一根開盤價以市價出場

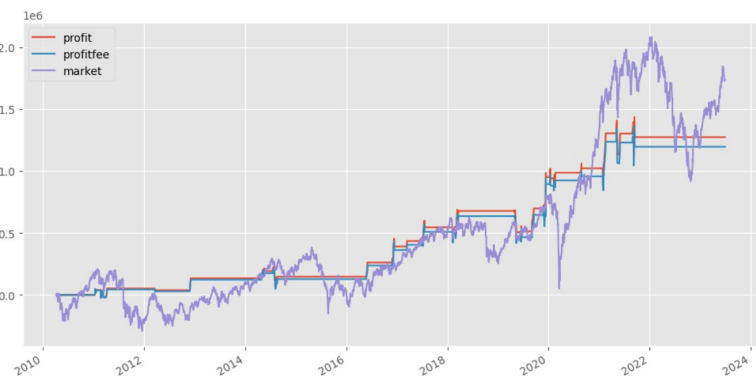
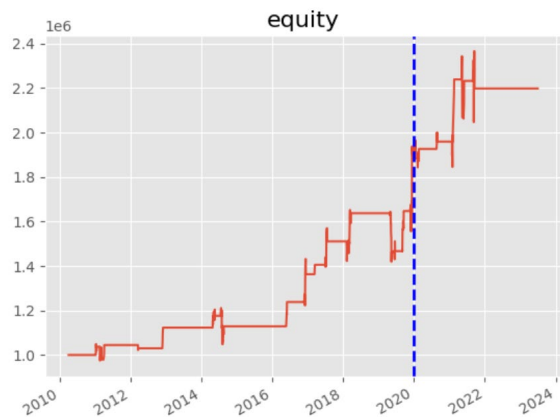
停利邏輯：當進場後最高價大於進場價格 $\times (1 + k)$

停損邏輯：當進場後最低價小於進場價格 $\times (1 - K)$ ，且開盤價跌破5日均線

加碼:開盤價同時大於進場價格和最近加碼價格，且開盤價突破10日均線，最多加碼3次

其他: 結算日不進場，結算日有部位時，下一根開盤價以市價平倉

回測績效



指標	數值(全樣本)
Profit	1197400.0
累積報酬	119.74%
年化報酬	6.24%
Max DrawDown	14.06%
Caimar Ratio	8.515
Trade Times	65
Win Rate	0.6923
Profit Factor	3.235

程式碼 (其他部分與暑期所提供程式碼大致相同)

```
df_day_1 = df_day.copy()
df_day_1["sar"] = abstract.SAR(df_day_1,0.005,0.2)
df_day_1["ema10"] = abstract.EMA(df_day_1, timeperiod=10)
df_day_1["ema60"] = abstract.EMA(df_day_1, timeperiod=60)
df_day_1["adx"] = abstract.ADX(df_day_1,14)
df_day_1["ema5"] = abstract.EMA(df_day_1, timeperiod=5)
df_day_1 = df_day_1.dropna()
```

```
## 進場邏輯
cond1 = df_arr[i,3] < df_arr[i,5] #收盤價小於sar
cond2 = df_arr[i,8] > 25 #adx > 25
cond3 = df_arr[i,3] > df_arr[i,7] #收盤價 突破60
entryLong = (cond1 & cond2 & cond3)
```

```
#結算日不進場
entryCondition = date_arr[i] not in settlementDate
```

```
## 出場邏輯
cond5 = df_arr[i,3] > df_arr[i,5]
cond6 = df_arr[i,8] > 25
cond7 = df_arr[i,3] < df_arr[i,6] #收盤價 10日
exitShort = (cond5 & cond6 & cond7)
```

```
### 結算日時放到結算
exitCondition = date_arr[i] in settlementDate
```

```
if BS == 'B':
```

```
stopLoss = (df_arr[i, 2] <= df_arr[t,0] * (1-0.05)) and (df_arr[i, 0] < df_arr[i, 9])
stopProfit = (df_arr[i,1] >= df_arr[t,0] * (1+0.03)) # 避免短時間瞬間崩盤
#做多狀態的加碼條件
add_condition = ((df_arr[i, 0] > buy_price) & (df_arr[i, 0] > df_arr[i, 6]) & (df_arr[i, 0] > add_price))
```