外資未平倉量快慢線

薛嘉宜

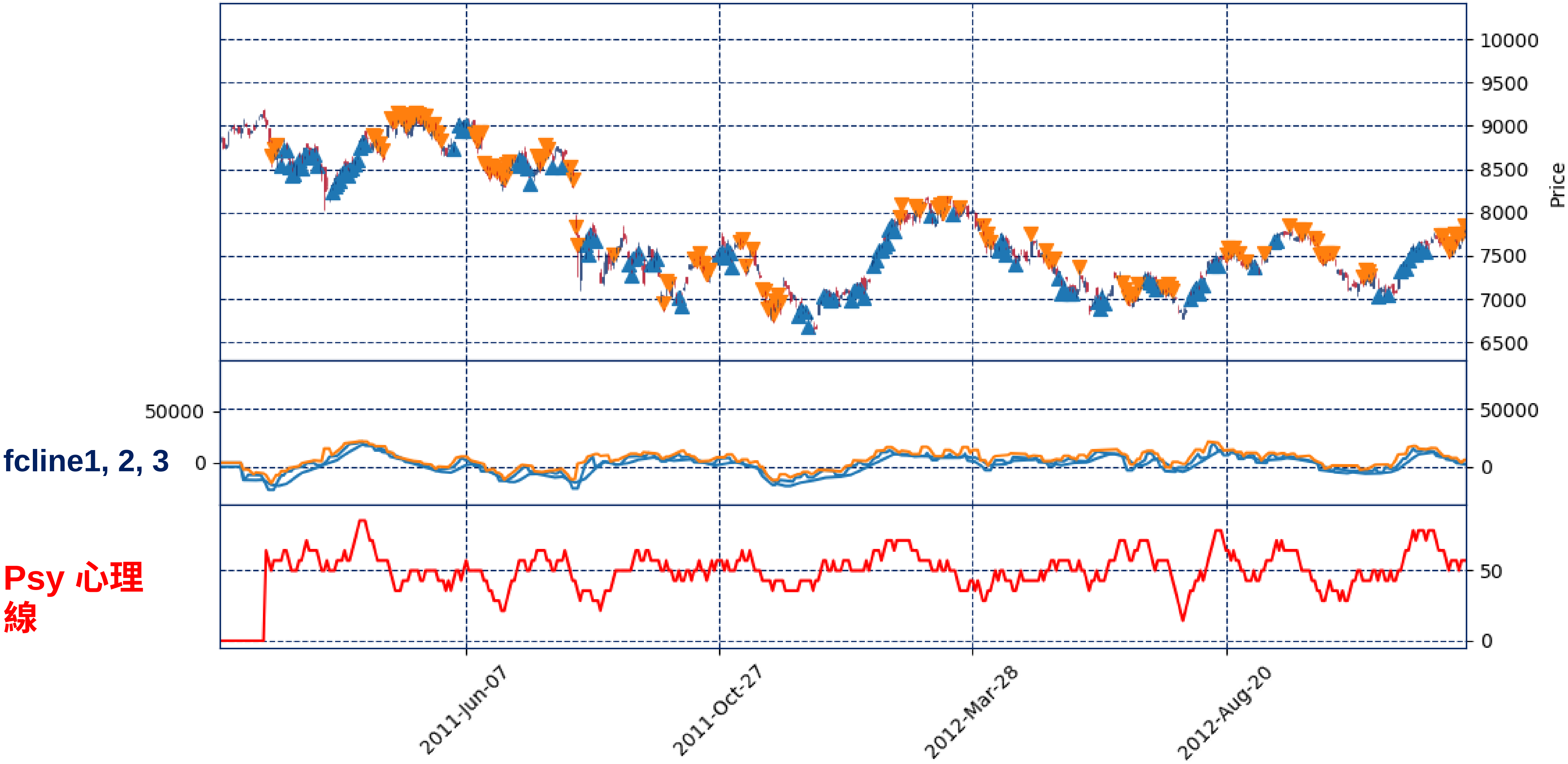
前

```
inputs: len(9),len2(3),len3(14),FC(c data2);
vars: psy(0),eom(0),fcline1(0),fcline2(0),fcline3(0);
fcline1=average(fc,len);
fcline2= lowest(fc,len2);
fcline3= highest(fc,len2);
if fcline2 > fcline1 then buy next bar at market;
if fcline3 < fcline1 then sellshort next bar at market;
//out
if marketposition=1 and fcline2 cross under fcline1 or entryprice-c>200 then sell ("bsp") next bar at market;
if marketposition=-1 and fcline3 cross over fcline1 then buytocover ("ssp") next bar at market;
//monthchange
if dayofmonth(d)>=14 and dayofmonth(d)<= 20 and dayofweek(d)=2 then setexitonclose;
```

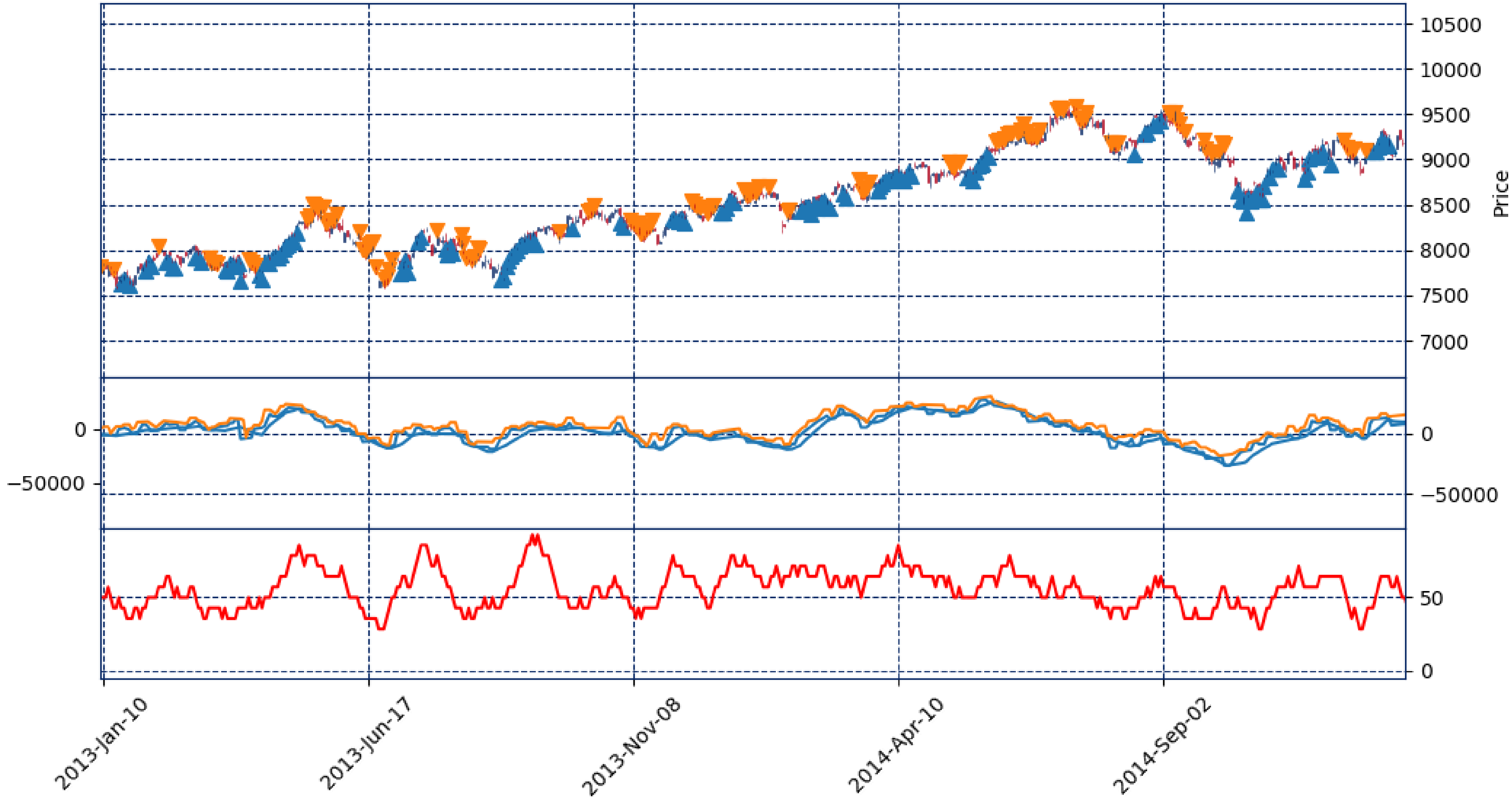
國內期貨策略發想

- 投資標的：台指期日線
- 滑價：每筆600元
- 想法：試試將外資未平倉量做成移動平均線(長天期&短天期)和最高、最低成交量(短天期)做順勢策略變化
- fcline1=average(fc,9)
- fcline2= lowest(fc,3)
- fcline3= highest(fc,3)
- >>試著將進場訊號用圖畫出
- （**藍色**向上箭頭表示**buy**、**橘色**向下箭頭表示**short**）

2011-2013

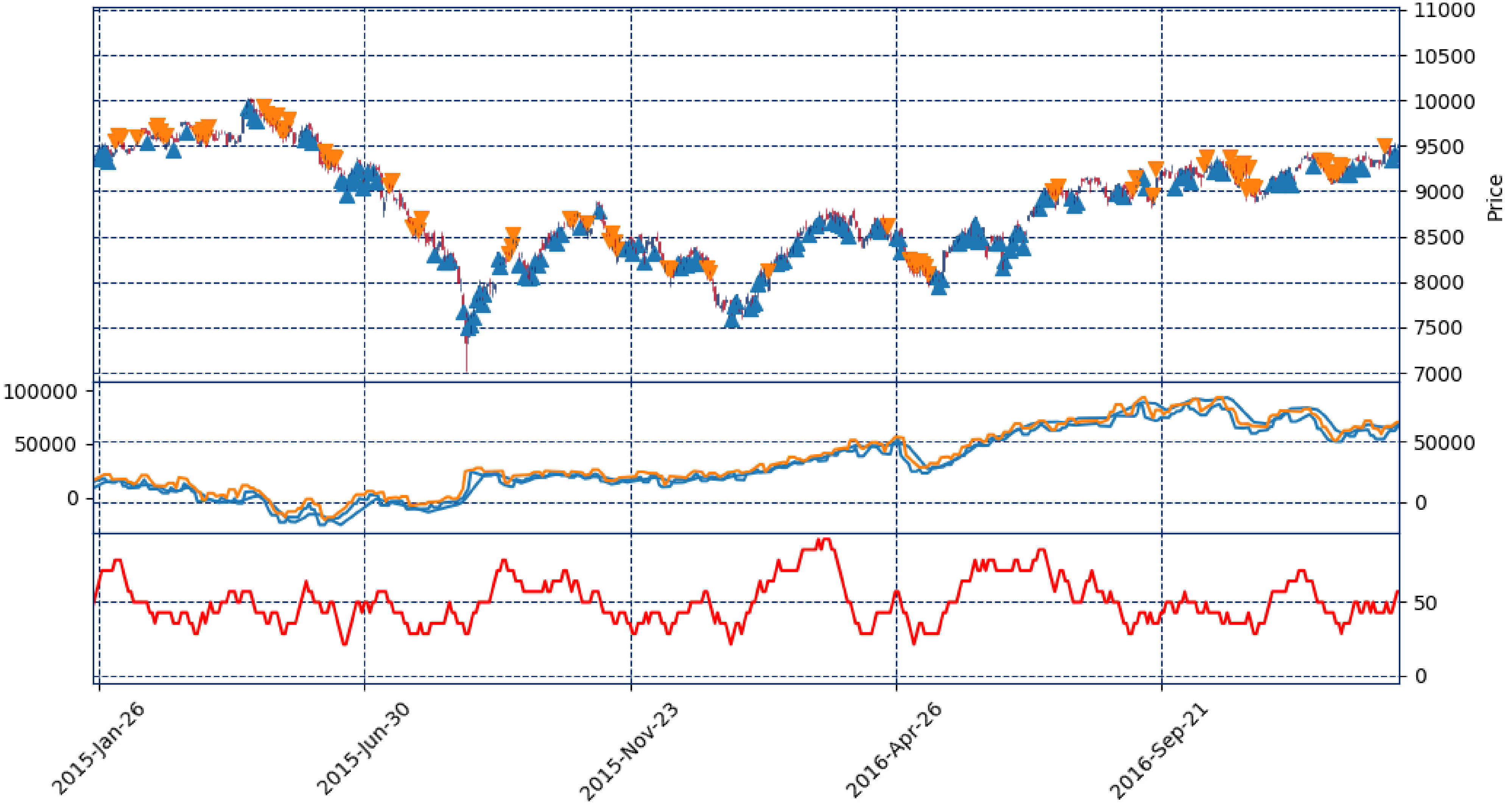

10000
9500
9000
8500
8000
7500
7000
6500
Price
50000
0
fcline1, 2, 3
Psy 心理線
50
2011-Jun-07
2011-Oct-27
2012-Mar-28
2012-Aug-20

2013-2015



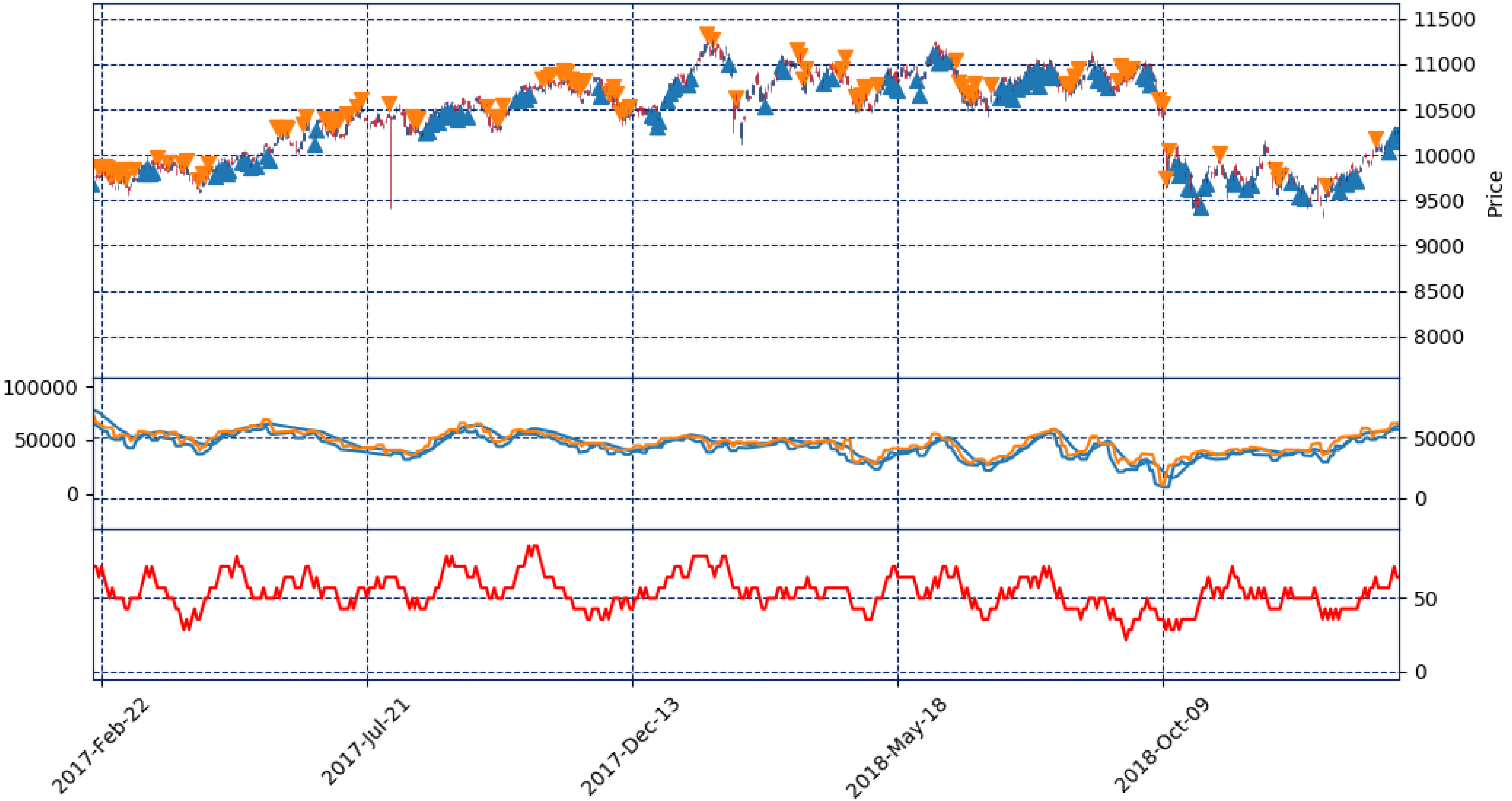
10500
10000
9500
9000
8500
8000
7500
7000
Price
0
−50000
0
−50000
50
0
2013-Jan-10
2013-Jun-17
2013-Nov-08
2014-Apr-10
2014-Sep-02

2015-2017



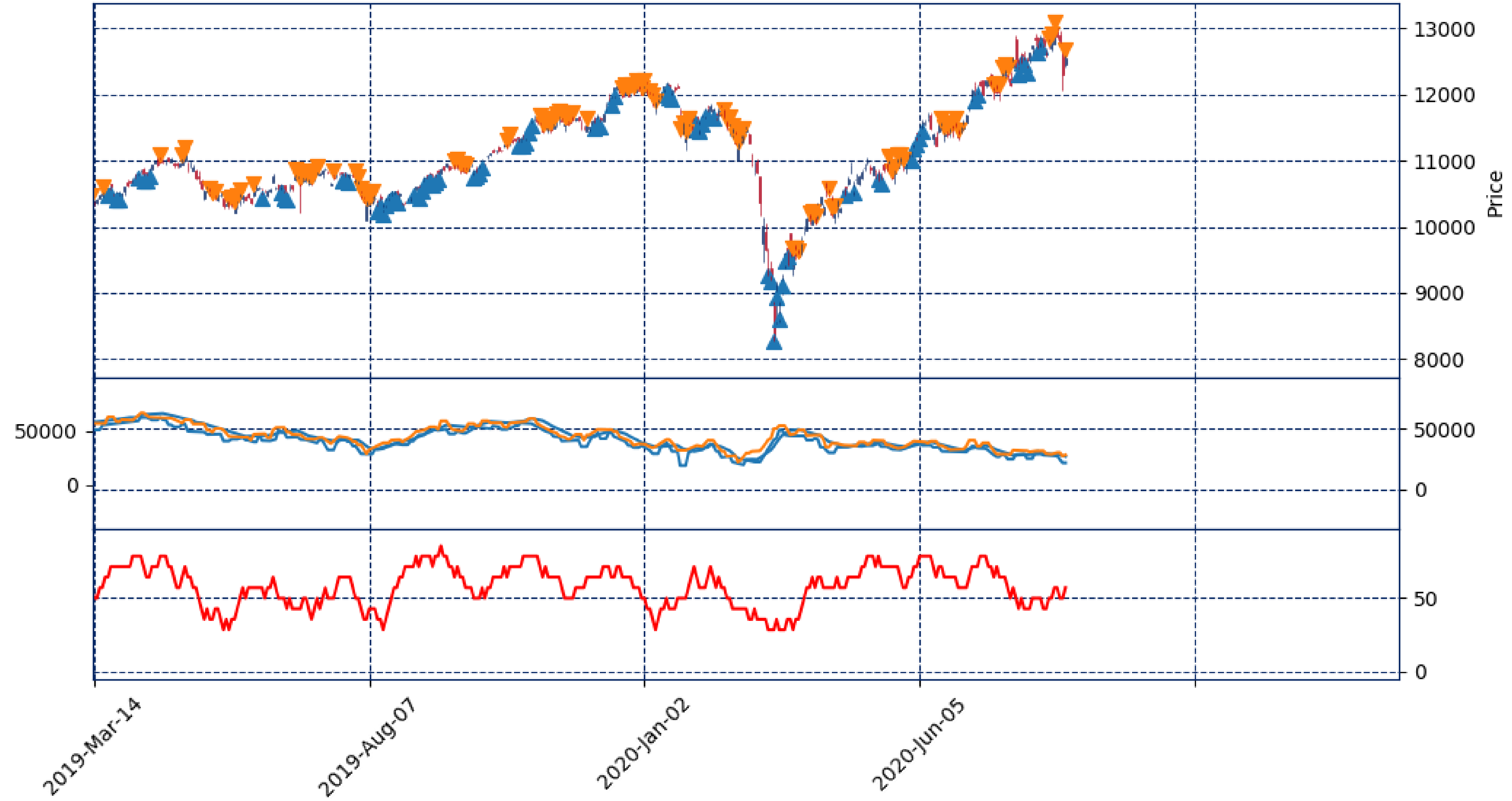
11000
10500
10000
9500
9000
8500
8000
7500
7000
Price
100000
50000
0
50000
0
50
0
2015-Jan-26
2015-Jun-30
2015-Nov-23
2016-Apr-26
2016-Sep-21

2017-2019



11500
11000
10500
10000
9500
9000
8500
8000
Price
100000
50000
0
50000
0
50
0
2017-Feb-22
2017-Jul-21
2017-Dec-13
2018-May-18
2018-Oct-09

2019-2020



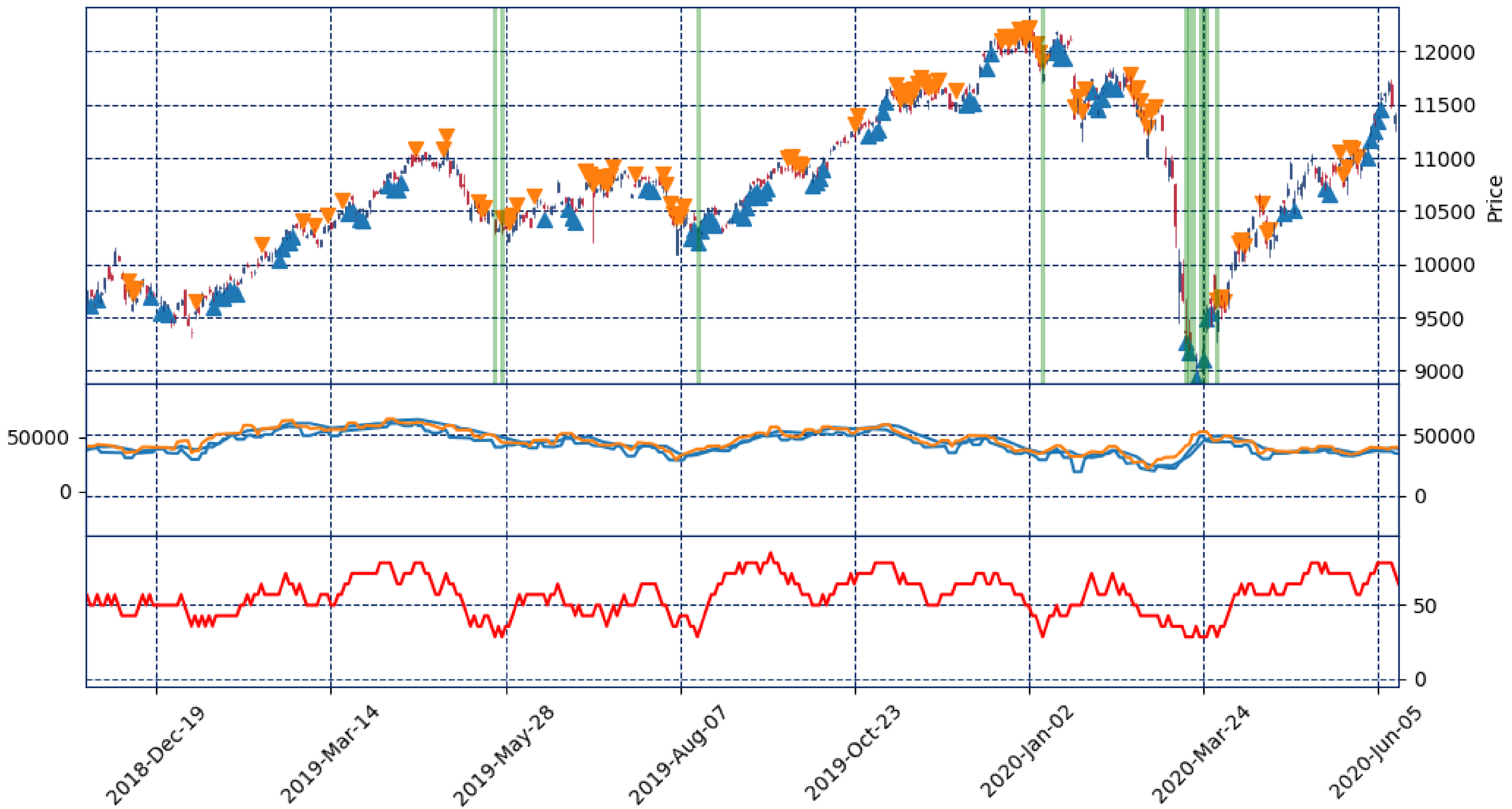
13000
12000
11000
10000
9000
8000
Price
50000
0
50000
0
50
0
2019-Mar-14
2019-Aug-07
2020-Jan-02
2020-Jun-05

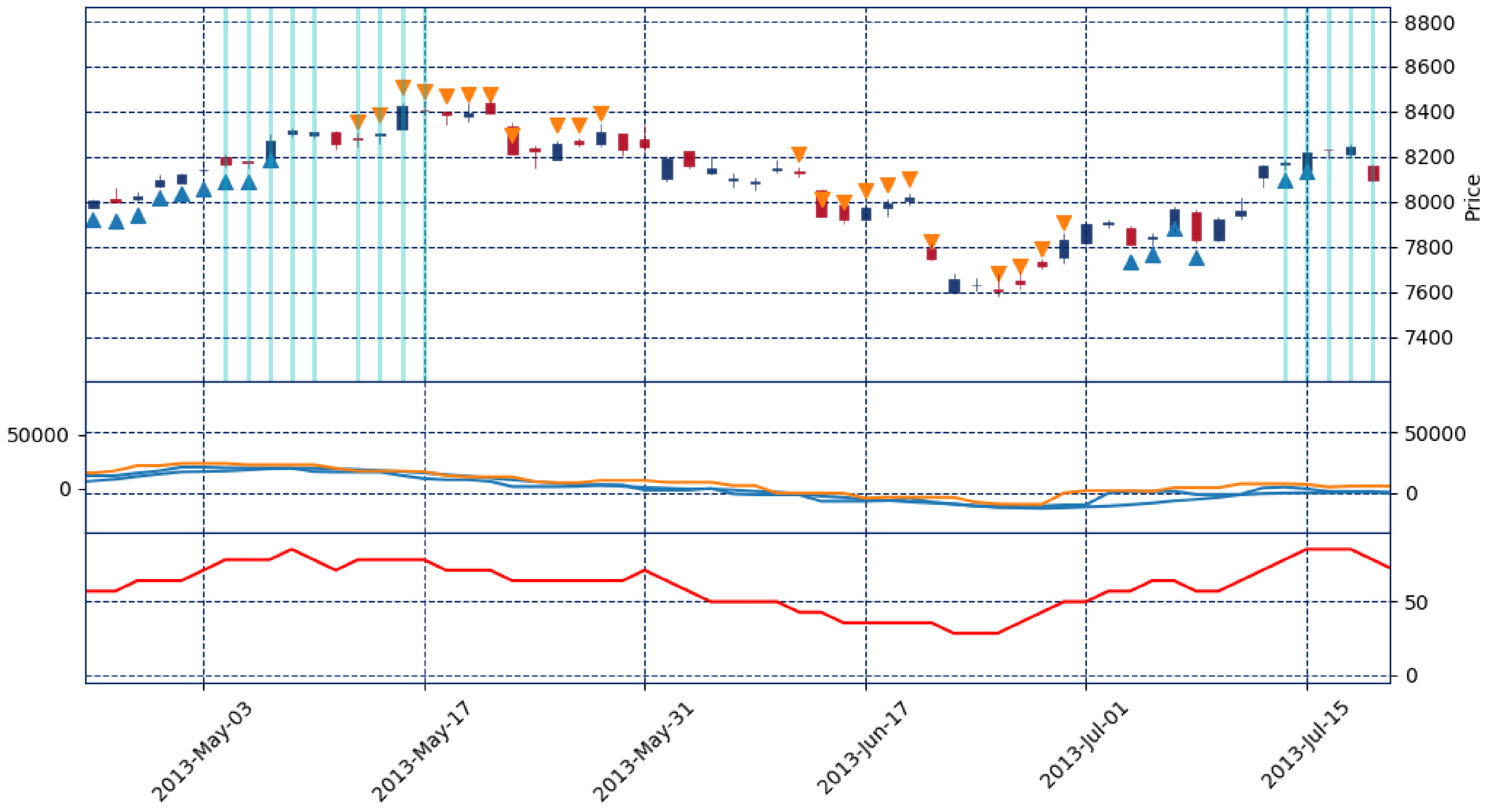
詳細權益曲線

2,250,000
2,000,000
1,750,000
1,500,000
1,250,000
1,000,000
750,000
500,000
250,000
權益 (¤)
2013/4/3
2015/4/20
2017/5/11
2019/5/29
日期
高權益 (¤)
低權益 (¤)

心理線?

- 利用一特定期間內，行情上漲天數的比例值，來揣摸投資人是趨向於買方或賣方的心理
- PSY=(上漲天數 / n) * 100
- >>使用14天為單位
- **14.29, 21.43, 28.57,** 35.71, 42.86, 50, 57.14, 64.29, 71.43**, 78.57, 85.71, 92.86**
- 設定值若<=28.57則為超賣區，行情即將上漲（**綠線**）
- 設定值若>=78.57則為超買區，行情即將下跌（**淺藍線**）


12000
11500
11000
10500
10000
9500
9000
Price
50000
0
50
0
2018-Dec-19
2019-Mar-14
2019-May-28
2019-Aug-07
2019-Oct-23
2020-Jan-02
2020-Mar-24
2020-Jun-05



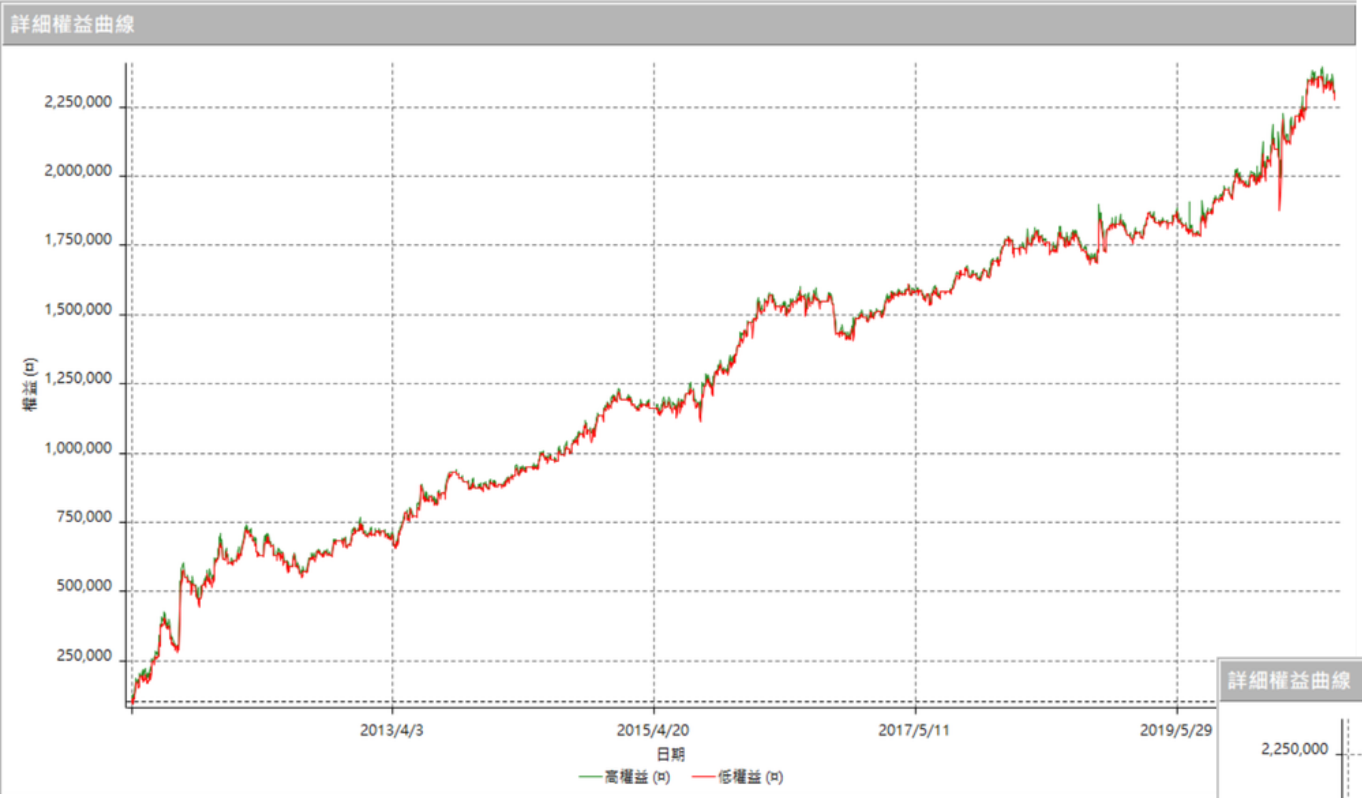
8800
8600
8400
8200
8000
7800
7600
7400
Price
50000
0
50000
0
50
0
2013-May-03
2013-May-17
2013-May-31
2013-Jun-17
2013-Jul-01
2013-Jul-15

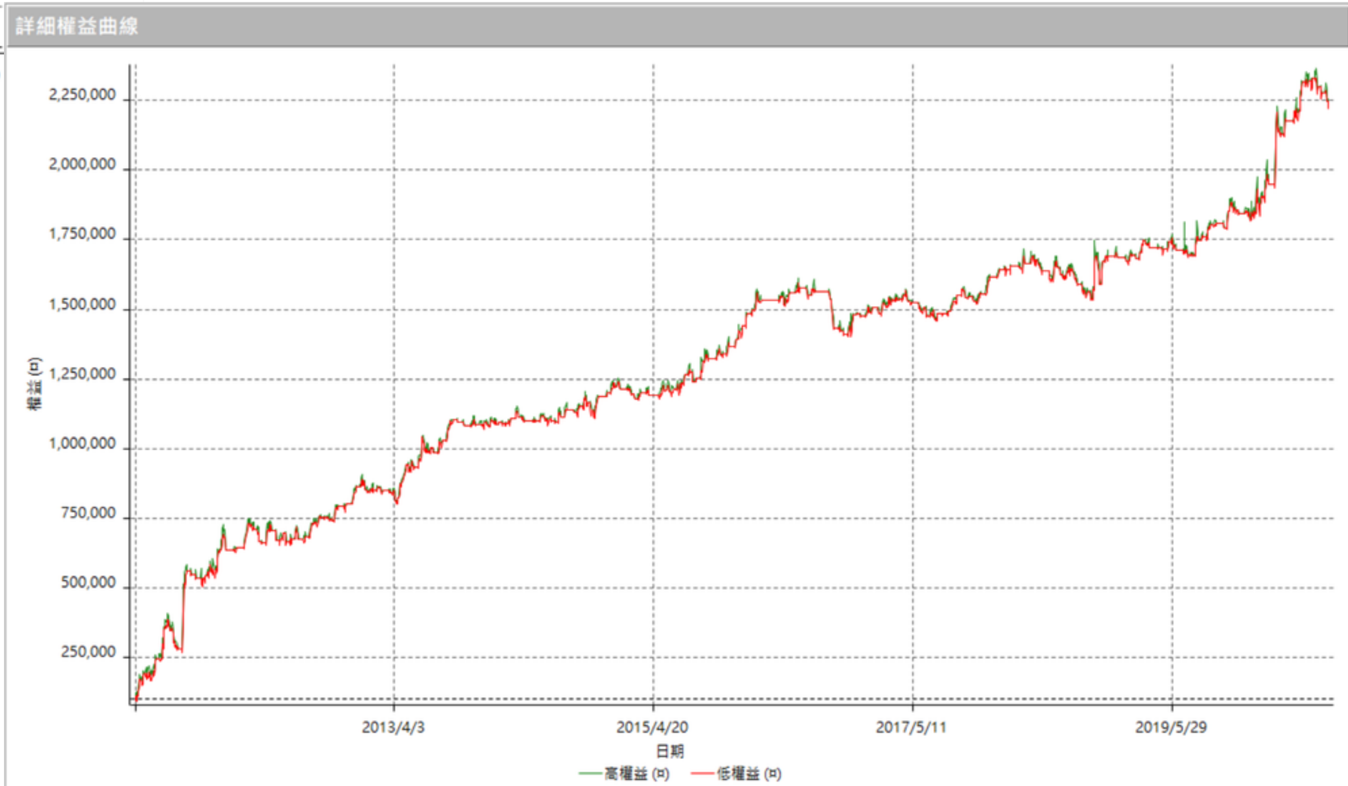
後

```
inputs: len(9),len2(3),len3(14),FC(c data2);
vars: psy(0),eom(0),fcline1(0),fcline2(0),fcline3(0);
fcline1=average(fc,len);
fcline2= lowest(fc,len2);
fcline3= highest(fc,len2);
psy= CountIf(close>close[1],len3)*100/len3;
condition1= psy[1]<psy;
if fcline2 > fcline1 and condition1 then buy next bar at market;
if fcline3 < fcline1 then sellshort next bar at market;
//out
if marketposition=1 and fcline2 cross under fcline1 or entryprice-c>200 then sell ("bsp") next bar at market;
if marketposition=-1 and fcline3 cross over fcline1 then buytocover ("ssp") next bar at market;
//monthchange
if dayofmonth(d)>=14 and dayofmonth(d)<= 20 and dayofweek(d)=2 then setexitonclose;
```

策略績效總結果

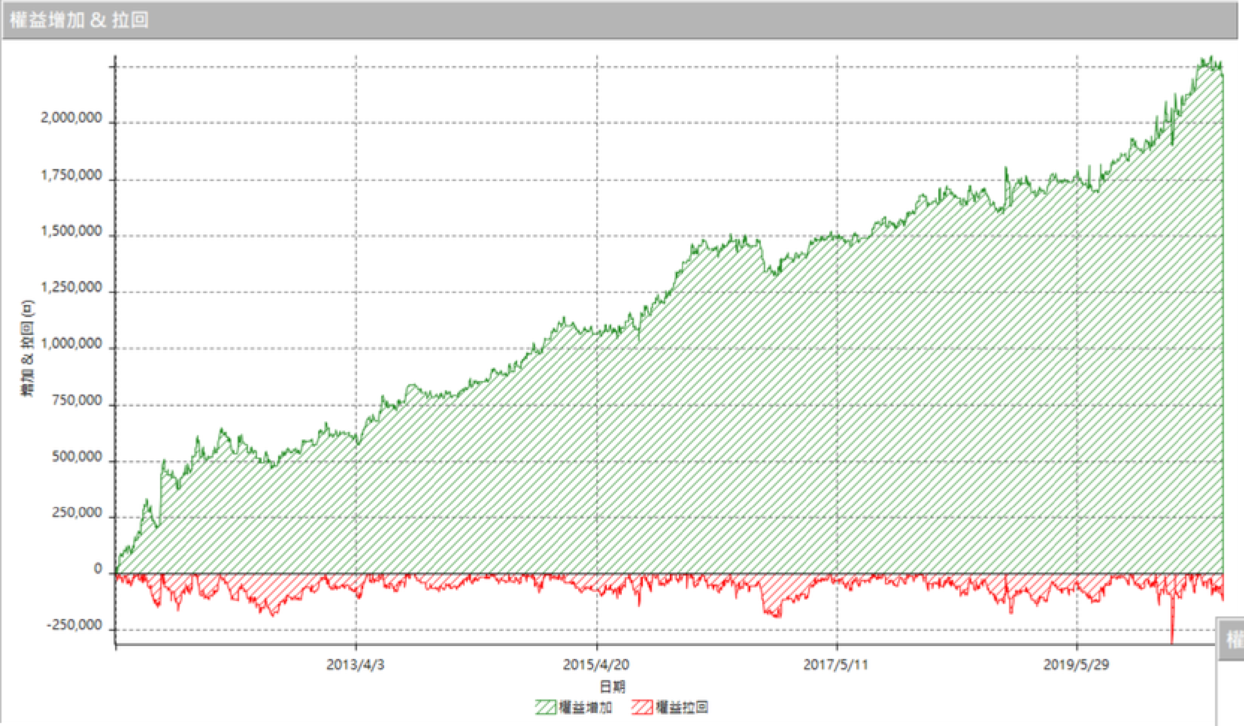
	所有交易	多單	空單	所有交易	多單	空單
淨利	¤2201600	¤1317000	¤884600	¤2145600	¤1261000	¤884600
毛利	¤5068400	¤2811400	¤2257000	¤4162000	¤1905000	¤2257000
毛損	(¤2866800)	(¤1494400)	(¤1372400)	(¤2016400)	(¤644000)	(¤1372400)
調整後淨利	¤1634445.43	¤895751.57	¤504795.9	¤1635535.71	¤920637.76	¤504795.9
調整後毛利	¤4721118.95	¤2550368.06	¤2027836.37	¤3836007	¤1670510.71	¤2027836.37
調整後毛損	(¤3086673.52)	(¤1654616.5)	(¤1523040.47)	(¤2200471.29)	(¤749872.95)	(¤1523040.47)
特定淨利	¤1399000	¤844000	¤555000	¤1326000	¤517600	¤808400
特定毛利	¤3297200	¤1739400	¤1557800	¤2548000	¤933800	¤1614200
特定毛損	(¤1898200)	(¤895400)	(¤1002800)	(¤1222000)	(¤416200)	(¤805800)
帳戶所需金額	¤170400	¤188800	¤105400	¤166200	¤197600	¤105400
帳戶報酬	1292.02%	697.56%	839.28%	1290.97%	638.16%	839.28%
初始資本報酬	2201.6%	1317%	884.6%	2145.6%	1261%	884.6%
最大策略虧損	(¤311800)	(¤282400)	(¤204400)	(¤209200)	(¤213000)	(¤204400)
最大策略虧損 (%)	(34.93%)	(52.8%)	(35.07%)	(34.87%)	(43.26%)	(35.07%)
最大平倉交易虧損	(¤170400)	(¤188800)	(¤105400)	(¤166200)	(¤197600)	(¤105400)
最大平倉交易虧損 (%)	(23.45%)	(47.23%)	(16.53%)	(22.36%)	(24.13%)	(16.53%)
最大的策略虧損報酬	7.06	4.66	4.33	10.26	5.92	4.33
獲利因子	1.77	1.88	1.64	2.06	2.96	1.64
調整獲利因子	1.53	1.54	1.33	1.74	2.23	1.33
特定獲利因子	1.74	1.94	1.55	2.09	2.24	2
最大持有契約數量	1	1	1	1	1	1
滑價支付	¤0	¤0	¤0	¤0	¤0	¤0
佣金支付	¤0	¤0	¤0	¤0	¤0	¤0
未平倉部位損益	(¤15400)	n/a	(¤15400)	(¤15400)	n/a	(¤15400)
年報酬率	233.83%	139.88%	93.95%	227.88%	133.93%	93.95%
月報酬率	19.49%	11.66%	7.83%	18.99%	11.16%	7.83%

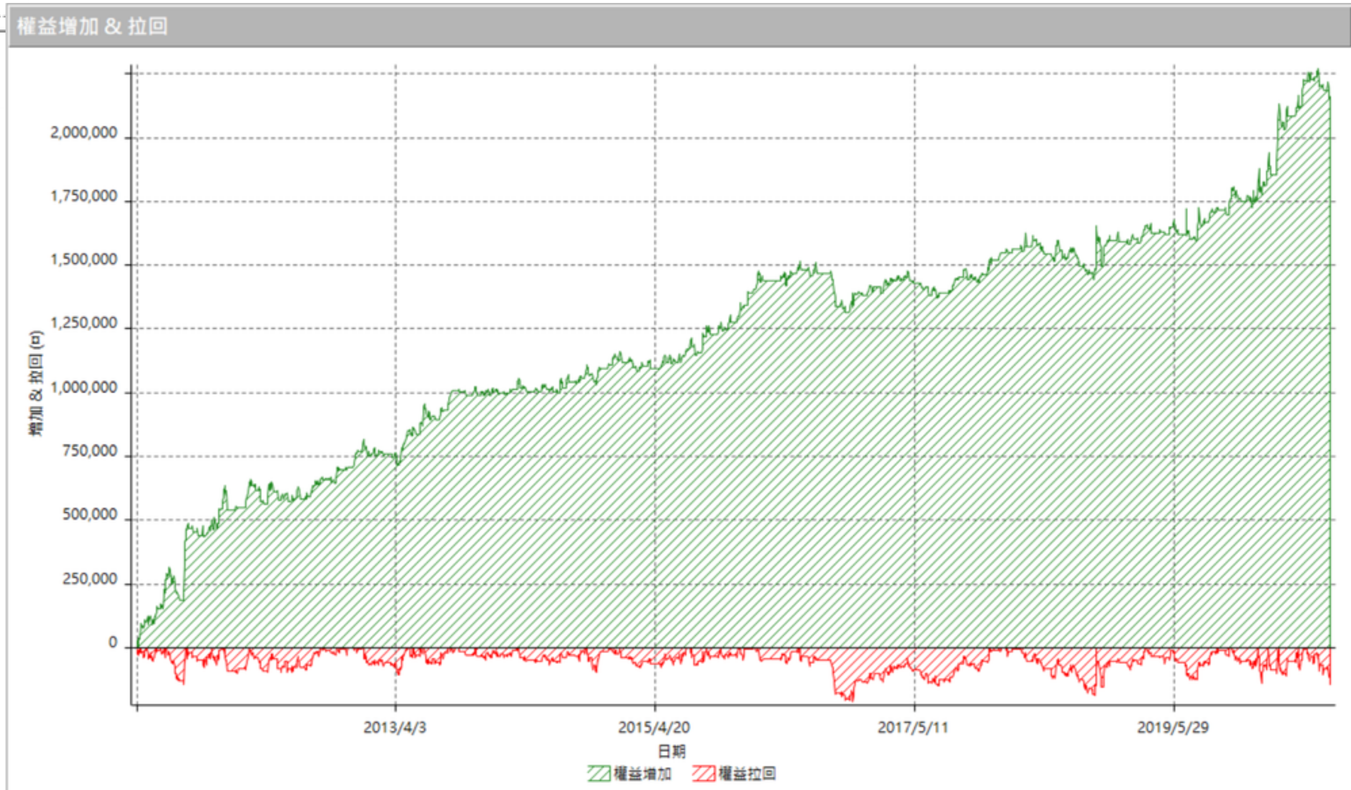

詳細權益曲線
2,250,000
2,000,000
1,750,000
1,500,000
1,250,000
1,000,000
750,000
500,000
250,000
2013/4/3
2015/4/20
2017/5/11
2019/5/29
日期
高權益
低權益

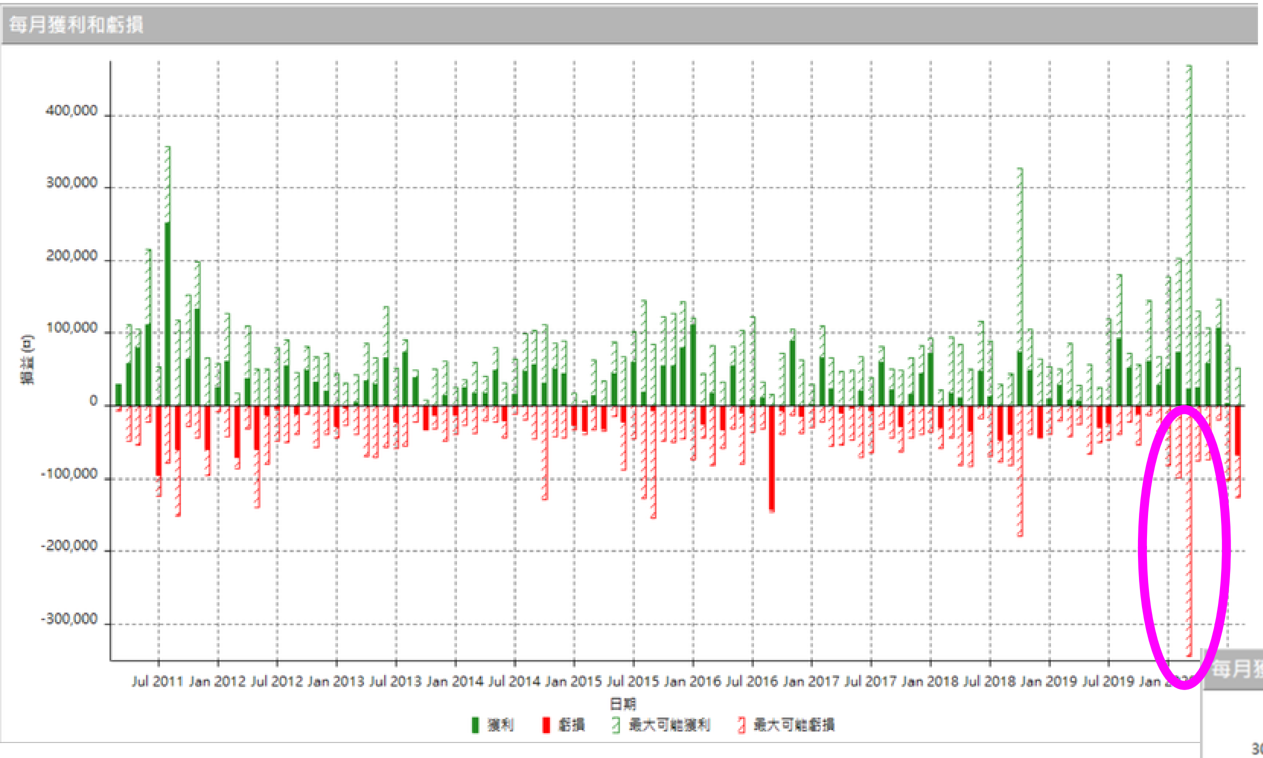

詳細權益曲線
2,250,000
2,000,000
1,750,000
1,500,000
1,250,000
1,000,000
750,000
500,000
250,000
2013/4/3
2015/4/20
2017/5/11
2019/5/29
日期
高權益
低權益

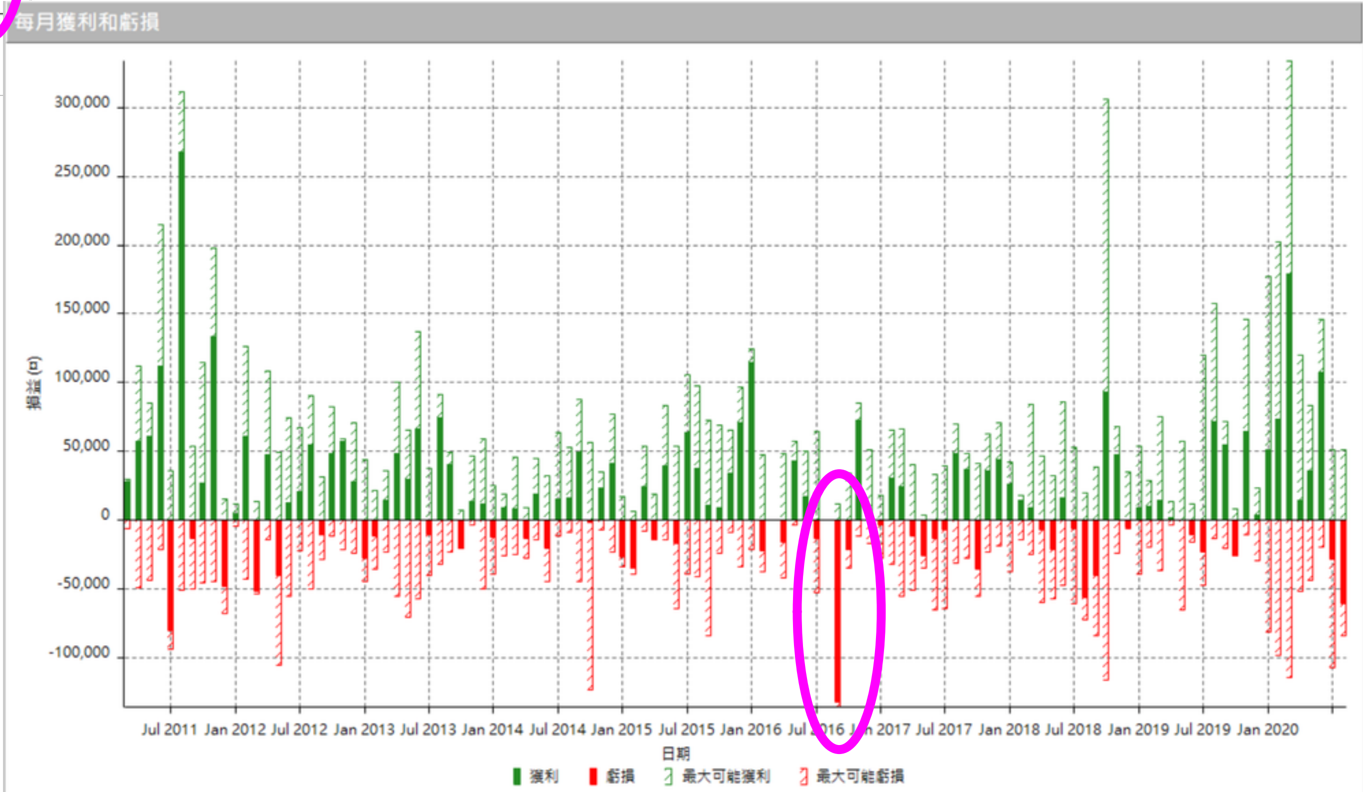
總交易分析

	所有交易	多單	空單	多單	空單
交易總次數	385	203	182	103	182
未平倉交易總數量	1	0	1	0	1
獲利交易次數	213	116	97	66	97
虧損交易次數	170	87	83	37	83
勝率	55.32%	57.14%	53.3%	64.08%	53.3%
平均交易(獲利 虧損)	¤5718.44	¤6487.68	¤4860.44	¤12242.72	¤4860.44
平均獲利交易	¤23795.31	¤24236.21	¤23268.04	¤28863.64	¤23268.04
平均虧損交易	(¤16863.53)	(¤17177.01)	(¤16534.94)	(¤17405.41)	(¤16534.94)
平均獲利/平均虧損 比率	1.41	1.41	1.41	1.66	1.41
最大的交易獲利	¤267400	¤267400	¤238000	¤258000	¤238000
最大的交易虧損	(¤160800)	(¤160800)	(¤73000)	(¤100000)	(¤73000)
平倉交易的平均K棒數	4	4	4	4.5	4
獲利平倉交易的平均K棒數	4.5	4.6	4.4	4.9	4.4
虧損平倉交易的平均K棒數	3.3	3.2	3.4	3.8	3.4
平倉交易間的平均K棒數	2	n/a	2	n/a	2
獲利平倉交易間的平均K棒數	6.5	15.7	19.8	30.8	19.8
虧損平倉交易間的平均K棒數	10.5	23.8	24.9	59.8	24.9

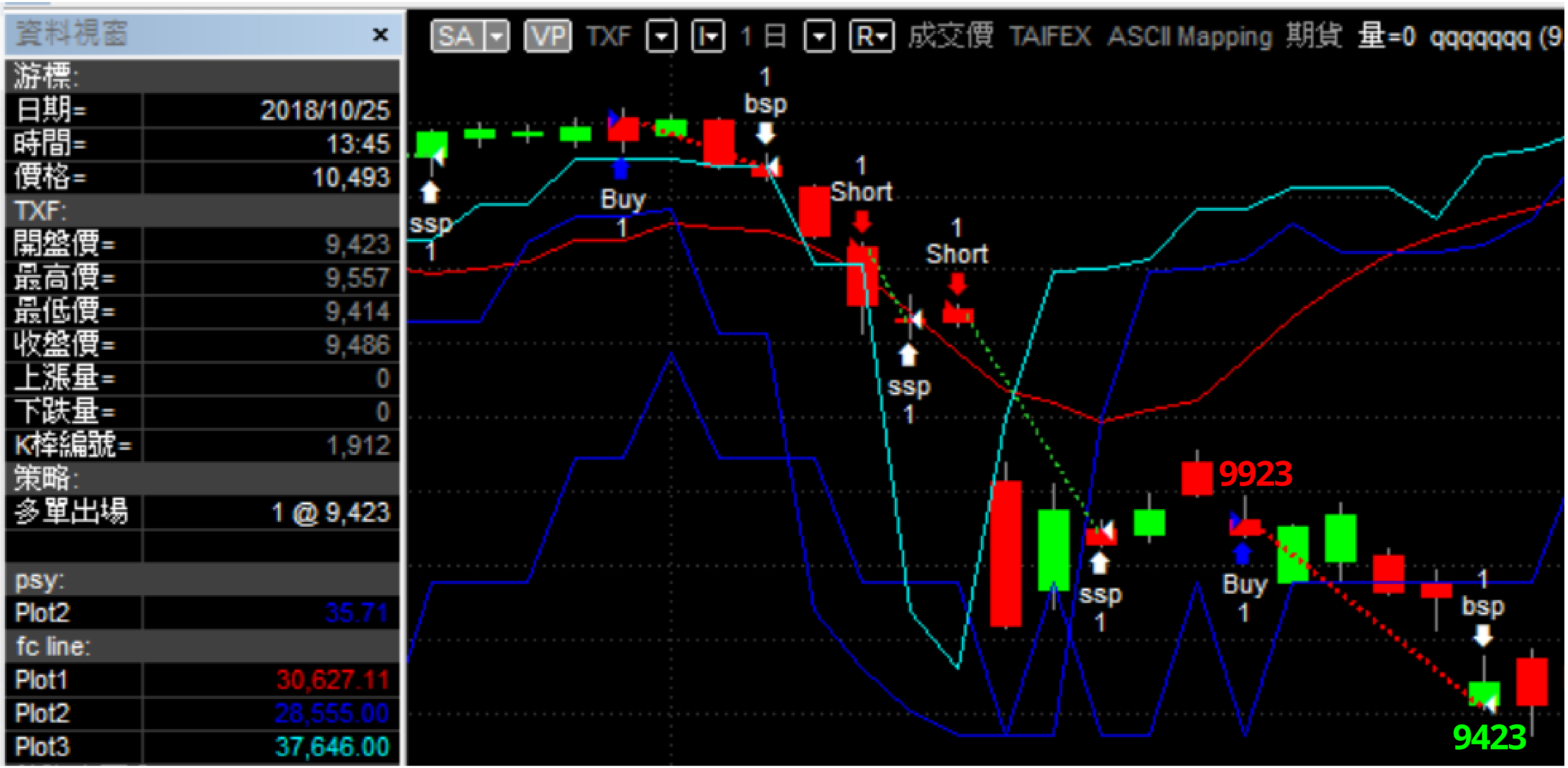

權益增加 & 拉回
2,000,000
1,750,000
1,500,000
1,250,000
1,000,000
750,000
500,000
250,000
0
-250,000
增加 & 拉回 (¤)
2013/4/3
2015/4/20
2017/5/11
2019/5/29
日期
權益增加
權益拉回


權益增加 & 拉回
2,000,000
1,750,000
1,500,000
1,250,000
1,000,000
750,000
500,000
250,000
0
增加 & 拉回 (¤)
2013/4/3
2015/4/20
2017/5/11
2019/5/29
日期
權益增加
權益拉回


每月獲利和虧損
400,000
300,000
200,000
100,000
0
-100,000
-200,000
-300,000
損益 (¤)
Jul 2011 Jan 2012 Jul 2012 Jan 2013 Jul 2013 Jan 2014 Jul 2014 Jan 2015 Jul 2015 Jan 2016 Jul 2016 Jan 2017 Jul 2017 Jan 2018 Jul 2018 Jan 2019 Jul 2019
日期
獲利
虧損
最大可能獲利
最大可能虧損


每月獲利和虧損
300,000
250,000
200,000
150,000
100,000
50,000
0
-50,000
-100,000
損益 (¤)
Jul 2011 Jan 2012 Jul 2012 Jan 2013 Jul 2013 Jan 2014 Jul 2014 Jan 2015 Jul 2015 Jan 2016 Jul 2017 Jan 2018 Jul 2018 Jan 2019 Jul 2019 Jan 2020
日期
獲利
虧損
最大可能獲利
最大可能虧損

最大虧損?



資料視窗
游標:
日期= 2018/10/25
時間= 13:45
價格= 10,493
TXF:
開盤價= 9,423
最高價= 9,557
最低價= 9,414
收盤價= 9,486
上漲量= 0
下跌量= 0
K棒編號= 1,912
策略:
多單出場 1 @ 9,423
psy:
Plot2 35.71
fc line:
Plot1 30,627.11
Plot2 28,555.00
Plot3 37,646.00
SA VP TXF 1 日 R 成交價 TAIFEX ASCII Mapping 期貨 量=0 qqqqqqq (9
ssp 1
Buy 1
1 bsp
1 Short
1 Short
ssp 1
ssp 1
Buy 1
1 bsp
9923
9423