使用說明

到cboe網站下載vix歷史紀錄

<https://www.cboe.com/tradable_products/vix/vix_historical_data/>

**一張含有 文字, 螢幕擷取畫面, 字型, 網頁 的圖片

自動產生的描述**

到yahoo financé 下載 SPX歷史資料

一張含有 文字, 螢幕擷取畫面, 數字, 軟體 的圖片

自動產生的描述

清除vix和spx數據要兩個數字都要有

單獨一邊的要刪掉 參考cleanedSPXvix.csv

計算技術指標 參考macd計算.xlsx

一張含有 文字, 黑與白, 白色, 字型 的圖片

自動產生的描述

將重要的技術指標挑出 參考VIX0705.csv

一張含有 文字, 數字, 螢幕擷取畫面, 字型 的圖片

自動產生的描述

將VIX0705.csv當成輸入給六個模型訓練

模型部分參照

一張含有 文字, 螢幕擷取畫面, 字型, 數字 的圖片

自動產生的描述

arima不用回測 預測結果在上圖的檔案中

transformer lstm 做回測並儲存結果

參照下圖

一張含有 文字, 螢幕擷取畫面, 字型, 行 的圖片

自動產生的描述

評估指標統計

參照



交易試算

B行 從SPX歷史資料獲得Close值

C行 從VIX歷史資料獲得Close值

D行 放入各模型預測值

一張含有 文字, 螢幕擷取畫面, 字型, 數字 的圖片

自動產生的描述

統計結果參照

一張含有 文字, 螢幕擷取畫面, 字型 的圖片

自動產生的描述

其他模型以此類推 xlsx有各行計算公式



取2010至2024的資料做統計

參照



一張含有 文字, 螢幕擷取畫面, 數字, 字型 的圖片

自動產生的描述

累積報酬畫圖

參照



畫圖部分參照

<https://app.diagrams.net/>

一張含有 文字, 螢幕擷取畫面, 字型, 數字 的圖片

自動產生的描述

開啟現有圖表並選取io檔

一張含有 文字, 螢幕擷取畫面, 字型, 設計 的圖片

自動產生的描述

畫完另存成png檔

一張含有 文字, 螢幕擷取畫面, 軟體, 多媒體軟體 的圖片

自動產生的描述

K線圖繪畫參照



輸入參照



Long put Long call訊號自行p圖