



BTC永續合約策略:移動平均線

組員:鄧力瑋

策略資訊

商品:BTC永續合約

週期:15分K

手續費:單邊0.15%

樣本內時間:2020/01/01 - 2022/10/31

樣本外時間:2022/10/31 - 2023/08/15

策略邏輯與參數

SMA:簡單平均線

EMA:指數平均線

短參數:480(約5天)

長參數:3070(約32天)

多單邏輯: $EMA \geq SMA$ 時進場做多 $EMA < SMA$ 時出場

空單邏輯: $SMA > EMA$ 時進場做空 $SMA \leq EMA$ 時出場

策略資金配置

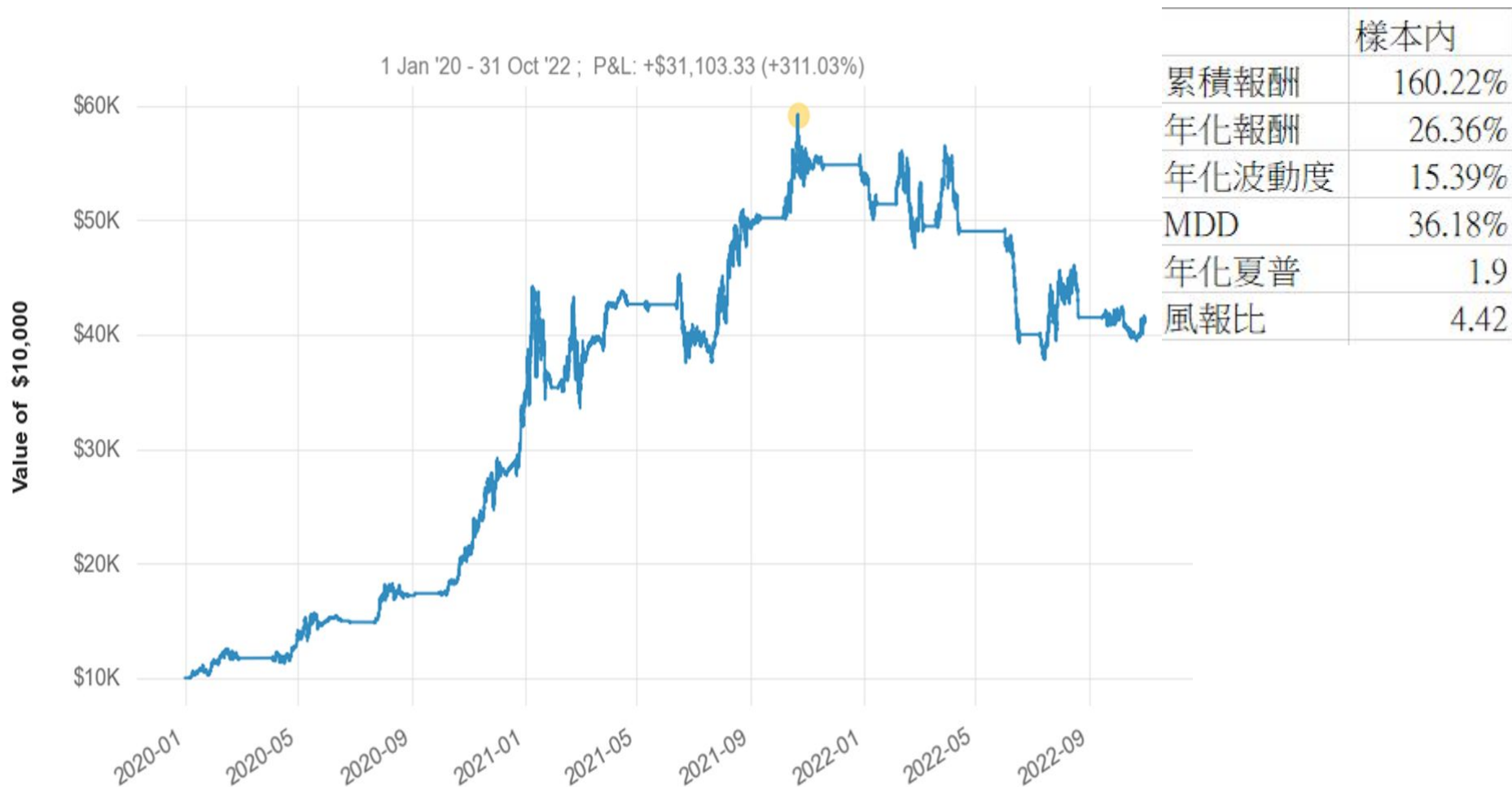
短線做多:40%

長線做多:40%

長線做空:20%

樣本內報酬

Portfolio Earnings



樣本外報酬

Portfolio Earnings



| | 樣本外 |
|-------|--------|
| 累積報酬 | 15.43% |
| 年化報酬 | 14.86% |
| 年化波動度 | 6.10% |
| MDD | 10.35% |
| 年化夏普 | 1.16 |
| 風報比 | 1.49 |

全樣本報酬

Portfolio Earnings



| | 全樣本 |
|-------|---------|
| 累積報酬 | 174.48% |
| 年化報酬 | 21.67% |
| 年化波動度 | 16.72% |
| MDD | 40.55% |
| 年化夏普 | 1.75 |
| 風報比 | 4.3 |

全樣本每月報酬

Strategy - Monthly Returns (%)

| | | | | | | | | | | | | |
|------|-------|-------|-------|--------|-------|--------|-------|-------|------|-------|--------|-------|
| 2020 | 13.23 | 3.56 | 0.00 | 15.33 | 11.12 | -0.54 | 15.96 | -0.67 | 1.37 | 21.24 | 30.17 | 18.82 |
| 2021 | 7.05 | -2.97 | 23.31 | 0.05 | -0.06 | -6.26 | 11.06 | 12.00 | 1.58 | 8.68 | 1.14 | -1.45 |
| 2022 | -4.85 | -0.41 | 6.92 | -10.00 | 0.00 | -20.18 | 10.70 | -5.83 | 1.05 | -2.67 | -10.10 | -1.55 |
| 2023 | 24.42 | -3.71 | 4.48 | 1.36 | -1.32 | 2.97 | -0.52 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| | JAN | FEB | MAR | APR | MAY | JUN | JUL | AUG | SEP | OCT | NOV | DEC |



感謝聆聽，敬請指教