

期末報告

108062213 顏浩昀

期中成果

進場策略

1. Time: 9:15~13:15 (避免收盤前再進行交易)
2. RSI>overbought & ADX下破25，空單
3. RSI<oversold & ADX下破25，多單
4. RSI下破overbought & ADX突破25，空單
5. RSI突破oversold & ADX突破25，多單
6. RSI>45，ADX>30，RSI沒背離，多單
7. RSI<55，ADX>30，RSI沒背離，空單
8. ADX>25，RSI背離 -> 價錢反向做多/做空
9. 連3支K棒向上，ADX>25，多單
10. 連3支K棒向下，ADX>25，空單

期中成果

出場策略

1. Time: >13:30
2. 停損停利：0.7%/3.5%
3. 已經持有單，但前述進場條件與持單相反時

期末策略修正

策略修正方向

- 根據老師期中建議，為每條策略最佳化參數。
包含：adx period、adx threshold、rsi period、rsi overbuy/oversold boundary、linear slope period、連續上漲/下跌的K棒數、停止交易的時間、停損停利百分比
- 根據每次作業，我發覺根據指標交易發生虧損時，常常會連續虧損，因此當前次交易虧損時將停止交易一段時間
- 取消反手的交易策略

期末策略修正

進場策略

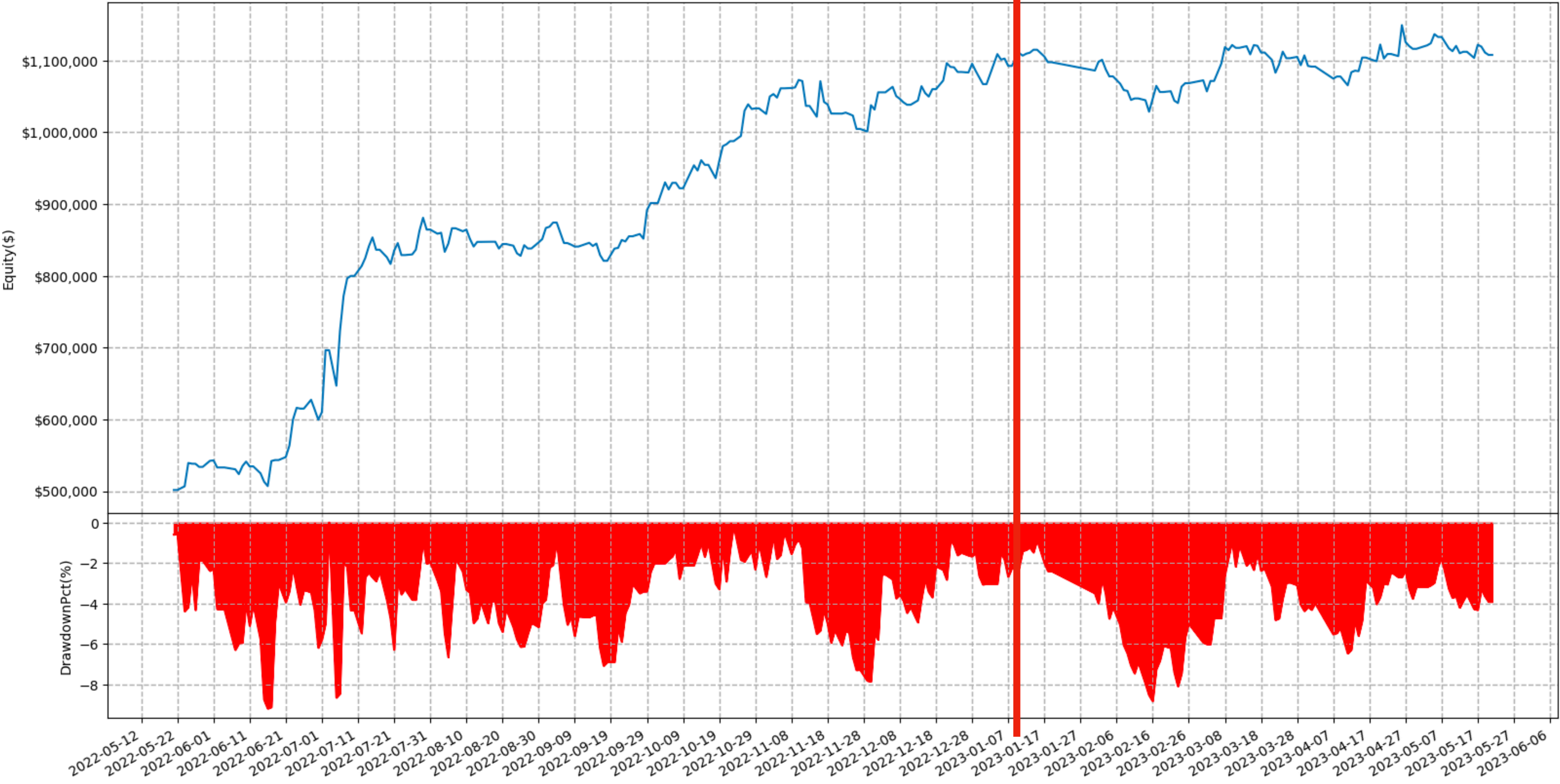
1. Time: 9:15~13:15 (避免收盤前再進行交易)
2. 距前次虧損交易達15 min以上
3. RSI13下破70(overbuy) & ADX28>15，空單
4. RSI13突破20(oversell) & ADX28>15，多單
5. RSI5>40，ADX20>15，RSI5與價格沒背離，多單
6. RSI5<45，ADX20>15，RSI5與價格沒背離，空單
7. RSI5>=45，ADX20>15，RSI5與價格背離，多單
8. RSI5<=40，ADX20>15，RSI5與價格背離，空單

期末策略修正

出場策略

1. Time: >13:30
2. 停損停利：0.5%/2.5%
3. RSI13>70(overbuy) & ADX28<15 & 持多單
4. RSI13<20(oversell) & ADX28<15 & 持空單
5. RSI5>40，ADX20>15，RSI5與價格沒背離，持空單
6. RSI5<45，ADX20>15，RSI5與價格沒背離，持多單
7. 連4支K棒下跌，持多單
8. 連3支K棒上漲，持空單

績效



Start	2022-05-20 00:00:00
End	2023-05-20 00:00:00
Duration	365 days 00:00:00
Exposure Time [%]	15.987727
Equity Final [\$]	1107932.842
Equity Peak [\$]	1153089.6268
Return [%]	121.586568
Buy & Hold Return [%]	0.518458
Return (Ann.) [%]	96.757287
Volatility (Ann.) [%]	59.223969
Sharpe Ratio	1.633752
Sortino Ratio	7.300976
Calmar Ratio	10.528024
Max. Drawdown [%]	-9.190451
Avg. Drawdown [%]	-1.261434
Max. Drawdown Duration	61 days 20:25:00
Avg. Drawdown Duration	2 days 05:12:00
# Trades	663
Win Rate [%]	43.740573
Best Trade [%]	2.95554
Worst Trade [%]	-0.51748
Avg. Trade [%]	0.031803
Max. Trade Duration	0 days 04:10:00
Avg. Trade Duration	0 days 01:02:00
Profit Factor	1.350639
Expectancy [%]	0.032361
SQN	2.414743
_strategy	myStrategy
_equity_curve	...
_trades	Size Entry...
dtype:	object