

台指 F1 隔日沖策略

日盛期貨 顧問事業部



JihSun Holdings
JihSun Futures
日盛期貨

期顧價值為操盤領航員，協助客戶建立操作信心

日盛期貨股份有限公司 台北市南京東路二段111號4樓 電話：(02)2504-2088分機888 傳真:(02)2507-8288

金管會核准之期貨商許可證照字號：100年金管期總字第005號

本公司經金管會核准，惟不表示交易建議絕無風險。以往之建議投資績效不保證最低交易收益；
本公司除盡善良交易建議之注意義務外，不負責交易之盈虧，亦不保證最低之收益。

台指 F1 隔日沖策略

➤ 策略精神:

盤後統計當日價格，波動率，期現貨籌碼等市場多空資訊，以判斷明日盤勢是否有明確之多空力向。

➤ 交易標的:

台指及台指選擇權。

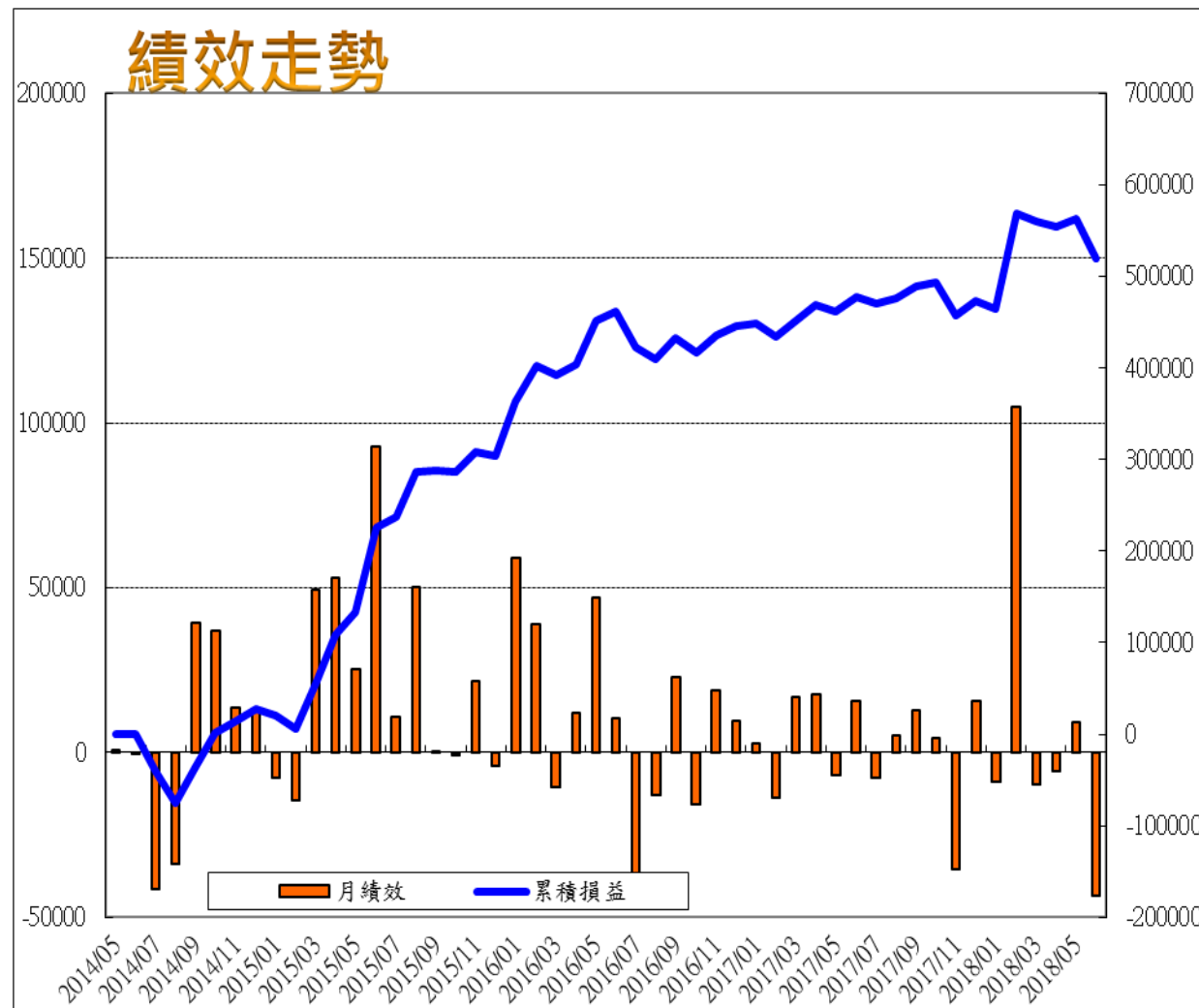
考量風險及流動性，建議以價平選擇權買方進出為佳(價平選擇權8~10口約當一口大台)，台指盤後交易請以限價為主，以免產生較大之滑價。

➤ 建議資金:

新台幣50萬。

➤ 進出場:

當日台指盤後(15:00)開盤決定多空進場，次日台指(13:45)收盤前出場。



來回交易成本1000，回測時間2014/05/16~2018/07/10，2017/05/01之前以歐台指回測。

關鍵數據

	所有交易
交易次數	264
勝率	52%
獲利次數	139
虧損次數	125
單筆平倉最大獲利	\$103,400
單筆平倉最大虧損	-\$44,400
交易平均損益	\$1,934
賺賠比	1.28
獲利交易平均損益	\$12,159
虧損交易平均損益	-\$9,435
最大平倉損益回檔	-\$75,400

訊號示意圖



2018 --02/05~02/06 大波段行情，完全提取，不論投資策略或避險都可以應用

