

單一參考線之轉折與簡易箱型理論操作 (暫定版)

修訂日期 2012-5-10

作者 劉盈志

現義守材料系

本資料所有內容僅供個人學術研討使用，亦不得作為任何金融商品推介、或證券、外匯投資買賣之依據，且不負責損失。歡迎整份轉載，但非經原作者同意，嚴禁轉製、轉載之內文。

建議有請收集樣本，再判定是否適用

一、緒論

1-1 研究背景與動機

原本是要考慮用道氏理論或類似方法和單一參考線結合，且不在考慮類似 K 線型態下，但整體卻很複雜且成效不彰，不過還是有比較值得參考慮網或操作方式。

1-2 研究架構

1. 下成波在選用均線值 2、3 下，在未來形成下成→上成和下成→上失→下失→上成佔有較多機率。
2. 原本只是而進一步考慮上成→下成和上成→下失→上失→下成，假設這兩種情況其中有些其上成波的多頭並未給後續下成波之空頭所破壞，所以可把下成波當成多頭的盤整波或修正波，未來形成在未來形成下成→上成和下成→上失→下失→上成。
3. 但用以上情況來進行人工判別會比較麻煩，且減少一些機會，因此改用以下方法來判別，且較有整體分析且較為方便人工判斷(不會 Excel 的悲哀)。
4. 最運用類似箱型方式設定固定賣出機制
5. 並未考慮應用在相反情況，再以確認為上成波情況下，個人覺得 K 線系統應用會效用比較大。

二、操作步驟

步驟一 選用參數

均線值選用 2、3 或類似 2、3 均線值參數所組成公式，以下用 2 日均值帶入。

步驟二 設定

1. 均線由下變上 稱為上反轉日 設為上 A 日
2. 均線由上變下 稱為下反轉日 設為下 D 日
3. 出現今日之均值等於前日均值時，

※前日均值為上升時，考慮今日收盤小於開盤視為下反轉日。

※前日均值為下建時，考慮今日收盤大於開盤視為上反轉日。

步驟三 波段設定

上成波&下成波

上升成功=上成波=上成=下 D 日收盤價 > (※)上 A 日收盤價

下降成功=下成波=下成=上 A 日收盤價 < (※)下 D 日收盤價

上失波&下失波

上升失敗=上失波=下 D 日收盤價 ≤ 上 A 日收盤價

下降失敗=下失波=上 A 日收盤價 ≥ 下 D 日收盤價

步驟四

以確認為下成波(1S 為標記)分為下列 3 種情況

情況(1)

下成波(1S)前接

上成(1A)→下成波(1S)

上失(1A)→下成波(1S)

下成波(1S)之上反轉日收盤大於或等於上成(1A)或上失(1A)之上反轉-1 日之 2 日均值。如下圖 1



圖 1 情況(1)

情況(2)

上成(2A)→下失→上成(1A)→下成波(1S)

上失(2A)→下失→上成(1A)→下成波(1S)

上成(2A)→下成→上成(1A)→下成波(1S)

上失(2A)→下成→上成(1A)→下成波(1S)

上成(2A)→下成→上失(1A)→下成波(1S)

上失(2A)→下成→上失(1A)→下成波(1S)

上成(2A)→下失→上失(1A)→下成波(1S)

上失(2A)→下失→上失(1A)→下成波(1S)

下成波(1S)之上反轉日收盤大於或等於上成(2A)或上失(2A)之上反轉-1 日之 2 日均值。如圖 2



圖 2 情況 2

情況(3)

無以上 2 種情況。

買賣機制

買入機制：滿足情況(1)、(2)，採上反轉日收盤買進。

停利點：，採買進日均掛下成波(1S)之下反轉-1 日之 2 日均值為賣點。

停損點：出現收盤小於下成波(1S)之上反轉-1 日最低值(含下影線)時賣出。

三、研究建議

1. 其實原本有分為四種情況，也就是考慮上成(3A)或下失(3A)，但因出現機會不大且，不過只考慮上成(3A)滿足條件下，可進一步去分析成效。
2. 買賣機制可因人而異。
3. 可增設其他的濾網或條件來增加獲利，例如考慮下成波(1S)的上反轉日之 K 收盤大於開盤，大蓋可提升約 5%或利機會。

四、研究結論

原本是希望在沒有分析類似單 K 或 K 線型態下，增設波段和波段之間關析之濾網，以增加其獲利，雖然想很多相關分析方法，但驗證幾個卻效用不大，且最近想到另一種可能增加 K 線型態系統方法，可能有一段時間要再收集樣本，並去驗證。

約 55%會停利點機制賣出， 45%停損點機制賣出，在不考其他成本費下，整體是會有獲利，但考慮台灣手續費、證交稅、證所稅、健保…等，應該就沒啥賺頭，不過可當成一個不錯條件網。

誠心有錯或要補充建議、問題、歡迎請寄信到 cfthnbvg5@yahoo.com

本資料所有內容僅供個人學術研討使用，亦不得作為任何金融商品推介、或證券、外匯投資買賣之依據，且不負責損失。歡迎整份轉載，但非經原作者同意，嚴禁轉製、轉載之內文。