# PhoenixAlgos 自動交易設定與自主運算全指南

## 雲端原生自主觸發器、全系列虛擬 ETF 策略配置與外部警示整合手冊

**版本**：v3.0 • **發布日期**：2026 年 10 月 5 日

**官方平台**：[PhoenixAlgos.com](https://phoenixalgos.com) • **架構**：雲端原生自主運算引擎 (100% 非託管)

---

## 1. 核心架構概覽：從「外部警示」全面升級為「雲端原生自主運算」

在過去的量化交易實踐中，投資人通常需要面對繁瑣的繁重負擔：每天必須開啟 TradingView 軟體、掛載多個指標腳本、保持電腦與瀏覽器長時間運行、擔心系統休眠中斷，甚至因網路延遲或通知遺漏而錯失關鍵進出場良機。

**PhoenixAlgos 現已正式全面升級為【雲端原生自主運算引擎（Autonomous Execution Engine）】**：

- **零盯盤負擔**：所有量化模型、選股指標、回測邏輯與風控條件，均由 PhoenixAlgos 雲端伺服器 24/7 全天候自主監控與實時計算。
- **自主信號觸發**：系統實時偵測盤中突破點與出場條件，訊號成立時自動直連您的獨立合規券商（支援主流 API 券商）完成下單，無需開啟任何圖表或掛載本地軟體。
- **無縫相容外部警示**：若您已有習慣使用的自訂 TradingView 指標或外部 Webhook 訊號，**外部警示介面依然 100% 保留與支援**！您可以隨時將兩者協同結合。

---

## 2. 核心模式一：PhoenixAlgos 自主觸發器體系（Our Own Triggers）

PhoenixAlgos 的自主運算引擎內建機構級多維度實時觸發器，全面接管日常交易的繁重判斷：

### 1. 盤中突破買入觸發器（Breakout Trigger）

- **演算法邏輯**：實時計算動態突破阻力價位 $P_{\text{trigger}} = \max(\text{Today High}, \text{Prev High})$。
- **觸發機制**：當標的股價有效突破關鍵阻力（距離 $\le 0.0\%$）且伴隨量能確認時，自主引擎自動啟動買入建倉流程，捕捉主升浪初期的噴發動能。

### 2. 波動度錐與自適應追蹤止盈/止損（Volatility Cone & Trailing Stops）

- **動態保護帶**：捨棄傳統固定百分比停損，採用基於真實波動區間（ATR）與高斯波動度錐的動態保護帶。
- **利潤鎖定**：在行情順暢推進時自動上移保護停利點；若盤勢出現高位耗竭或突破反轉，即刻觸發自動平倉獲利了結。

### 3. 極端恐慌均值回歸觸發器（Mean-Reversion Oversold Trigger）

- **恐慌捕捉**：專為 `aETF` 模型設計，監控多週期自適應 RSI 嚴重超賣（RSI < 25）並伴隨成交量枯竭的極端乖離點。
- **高勝率反彈**：在市場非理性拋售時自主分批低吸，捕捉均值回歸的高盈虧比波段。

### 4. 宏觀市場體制過濾器（Market Regime Crash Filter）

- **牛市擴張**：大盤處於 200 日均線（SMA200）上方且波動率平穩時，自動允許適度擴張曝險至 1.35x（Dynamic Smart Margin）。
- **熊市硬去槓桿**：若大盤跌破趨勢支撐或波動率急劇飆升，引擎即刻自動觸發去槓桿機制，將總曝險壓低至 0.80x 以下甚至退回現金防禦，徹底避開系統性黑天鵝。

---

## 3. 核心模式二：全系列虛擬 ETF 策略配置（Proprietary Virtual ETFs）

傳統市售 ETF（如 QQQ、SPY）存在每年內扣基金管理費、成分股包含平庸公司、以及大盤下挫時無法主動換倉避險等結構性缺點。PhoenixAlgos 採用華爾街頂級機構的**【直接指數化（Direct Indexing）】**技術：

### 🌟 直接指數化與 Position Netting 核心優勢

1. **零管理費（0% Expense Ratio）**：資金 100% 直通底層龍頭持股，不付給基金公司任何內扣經理費。

2. **淨額沖銷（Position Netting）**：當多個 ETF 模型同時運行時，若策略 A 欲買入 NVDA 而策略 B 欲減持 NVDA，系統在送出訂單前進行內部淨額沖銷，交易次數減少逾 42%，大幅降低滑價與交易摩擦成本！

### 📊 6 大單一虛擬 ETF 策略矩陣

| 代號 | 策略名稱 | 核心量化哲學與定位 | 1Y 淨回報 (Margin) | 夏普比率 (Sharpe) | 最大回撤 (MDD) |
|---|---|---|---|---|---|
| **aaETF** | 旗艦期權動量冠軍 | 篩選全市場期權熱門標的，主升浪高爆發動能突破 | **+200.83%** | 2.99 🚀 | -19.95% |
| **aETF** | 機構級宏觀傾斜 | 多週期自適應 RSI 超賣均值回歸，單一模型夏普最高 | **+116.78%** | **3.12 ⭐** | -12.46% |
| **rETF** | RSI 極限動量跑者 | 寬幅 8.5x ATR 長線趨勢追蹤，單一模型總回報最高 | **+229.54%** | 2.43 | -31.18% |
| **hETF** | 雙軌混合動能型 | 結合動量突破與均值回歸雙引擎，攻守兼備 | **+133.06%** | 2.36 | -21.15% |
| **qETF** | 純量化高斯防禦 | 波動度倒數加權分配，回撤控制極佳之防禦基石 | **+45.77%** | 1.66 | -11.36% |
| **cETF** | 行業基準等權籃子 | 全行業板塊市值等權對齊，大盤增強被動基準 | **+34.43%** | 1.25 | 0.00% |

### 👑 經典多核心配置推薦（雙 ETF 協同運作）

- ** 👑 combo_half（50% aaETF + 50% aETF）**：**全平台夏普顛峰王者**。年化淨回報 **+151.05%**，最大回撤僅 **-14.24%**，夏普比率高達 **3.66 👑**（卡瑪比率 10.61）！期權動量與均值回歸完美互補。
- ** 🌟 combo_balanced（60% aaETF + 40% aETF）**：黃金平衡核心。兼備高收益率（+159.00%）與回撤壓制（-15.30%）。
- ** 🛡️ combo_preservation（30% a + 40% q + 30% c）**：超低波動退休保全。純現金回撤僅 **-6.64%**，穩健跑贏大盤 3 倍以上。

---

## 4. 外部警示整合：TradingView 及第三方 Webhook 依然完全支援

如果您已經有熟悉的 TradingView 自訂策略、PineScript 指標警示或外部量化訊號源，**PhoenixAlgos 的外部 Webhook 接口持續 100% 保持相容與支援**！

### 📡 Webhook 接收端點資訊

- **Webhook 接收 URL**：`https://phoenixalgos.com/api/webhook`
- **支援訊號格式**：標準 JSON 格式（如下所示）

```
{
  "ticker": "{{ticker}}",
  "action": "{{strategy.order.action}}",
  "price": {{close}},
  "qty": {{strategy.order.contracts}},
  "api_key": "YOUR_BROKER_API_KEY",
  "secret_key": "YOUR_BROKER_SECRET_KEY",
  "source": "tradingview"
}
```

### 💡 靈活的雙軌運行架構

• **情境 A（推薦）：100% 雲端原生自主運行**：完全交由 PhoenixAlgos 雲端計算與觸發，免開 TradingView、免付軟體月費。

• **情境 B：純外部 Webhook 驅動**：利用 TradingView 的圖表警示作為下單觸發點，直連您的獨立券商執行。

• **情境 C：雙軌混合協同**：核心資金配置於 PhoenixAlgos 虛擬 ETF 自主輪動（如 `combo_half`），衛星資金接收特定個股的 TradingView 突破警示。

---

## 5. 實戰 3 步設定快速上手流程

### Step 1：開立與連接您的獨立券商帳戶（支援主流合規券商）

1. 登入您所選擇的合規美股券商帳號（支援具備標準加密 API 接口之經紀商）。

2. 初次設定強烈建議先使用**模擬帳戶（Paper Trading / 虛擬模擬環境）**進行無風險演練。

3. 在券商後台取得專屬的授權 API 金鑰（API Key 與 Secret Key），妥善保存。

### Step 2：在 PhoenixAlgos ATW 終端完成授權與策略配置

1. 登入 [PhoenixAlgos.com](https://phoenixalgos.com)，進入 **Auto Trading 控制台。**

2. 輸入您的券商授權 API 金鑰，點擊 **「驗證連線」**（系統將安全讀取帳戶購買力與當前持股）。

3. **挑選策略組合**：

* **方法 A（AI 智慧選組）**：在對話框點擊 🤖 `smartPhoenix`，輸入您的偏好（例如：「追求最高夏普比率」），AI 將即時推薦最佳組合並支援 **「1-Click 一鍵套用」**！

* **方法 B（手動配置）**：直接在選單中選擇 `combo_half`、`combo_balanced` 或單一 `aaETF`。

4. 設定槓桿模式：可選擇 **Cash Only（純現金 1.0x）** 或 **Dynamic Smart Margin（動態融資 1.35x）**。

### Step 3：開啟自動交易自主運算

1. 檢視安全防線設定（單一標的曝險上限 ≤ 20%、停損保護）。

2. 將「自動交易總開關」切換至 **ON（開啟）**。

3. **自主運算即刻生效**！PhoenixAlgos 雲端引擎即刻開始 24/7 監控行情，實時捕捉進出場觸發點並全自動對接券商下單。

4. *(選填)* 若有 TradingView 指標警示，亦可同步建立 Webhook 指向 `https://phoenixalgos.com/api/webhook`。

---

## 6. 架構安全、風控守則與法律合規聲明

• 🔒 **100% 非託管（Non-Custodial）**：PhoenixAlgos 絕不接觸或持有您的資金與股票。所有下單皆由用戶本機/雲端經加密 API 直接送至您的獨立券商，資金與證券完全獨立存放於合規經紀商，受 FINRA / SIPC 制度保障。

• 🛡️ **預檢確認與風控硬頂（Pre-Flight Safety）**：系統嚴格遵守四大黃金法則，熊市硬去槓桿（≤0.80x），個股集中度上限 ≤20%，杜絕爆倉風險。

• 📜 **SEC / CFTC Rule 4.41 免責聲明**：PhoenixAlgos 是一套金融量化科技軟體，並非 SEC/FINRA/CFTC 註冊之投資顧問（RIA）或經紀商。本指南所列之數據皆為歷史模擬回測，過往績效不代表未來表現保證。金融交易具本金虧損風險，投資人應自行審慎評估。