

BDQA100 全權委託管理期貨

BDQA交易系統

偵測分析加權指數、台指期、選擇權歷史資料，以趨勢策略、價差策略，設計組合低相關當沖模組與波段模組。行情波動產生買賣訊號後，系統化交易。

交易經理人除監控交易系統是否確實執行，針對留倉部位，會建立選擇權部位減少系統風險。

產品模組代號：BDQA100交易系統

建議委託管理金額：100萬元新台幣(單位)

優：

BDQA交易系統當沖加上波段的組合模組，彼此相關性低。模擬績效最長時間未能創新高交易日為97天，約四個月。

劣：

未來若當沖與波段模組相關性提高，最大連續虧損容易擴大、未能創新高交易日容易擴大。

模擬歷史績效表

測試期間：	2012/01	~	2017/08
累積淨獲利	256.78%		
最大連續虧損比率	-16.66%		
平均年化報酬	45.31%		
近一年之年化波動度	11.59%		
近三年之年化波動度	30.26%		
近五年之年化波動度	27.48%		
三年平均年化波動度	27.06%		
風險等級	V2		
建議客戶風險承受等級	V3		

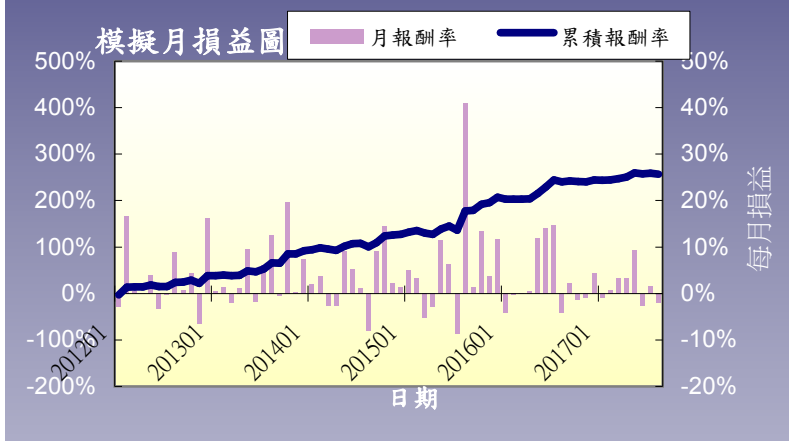
※風險等級：三年平均年化波動度，V1(0%-20%)、V2(20%-40%)、V3(40%以上)。

模擬歷史績效包含交易手續費及滑價成本。假設前提為市場能正常成交之狀況，例如行情出現快市或跳空時，會有部位無法成交之風險；亦可能會有滑價之差異，投資人仍必須了解期貨與選擇權之交易風險。

模擬損益圖



模擬月損益圖



模擬歷史績效

分析	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	全年
2012	-2.81	16.54	0.39	0.06	3.94	-3.31	-0.14	8.92	0.68	4.40	-5.56	16.17	38.28
2013	0.36	1.33	-1.87	1.10	9.52	-1.77	6.13	12.59	-0.34	19.64	0.19	7.28	54.16
2014	2.02	3.73	-2.65	-2.51	9.07	5.12	1.02	-8.11	9.07	14.44	2.16	1.30	34.66
2015	4.96	3.15	-5.16	-2.76	11.52	6.27	-8.60	40.95	1.32	13.35	3.65	11.71	80.36
2016	-4.09	-0.29	0.15	0.43	11.77	14.03	14.74	-4.15	2.21	-1.38	-0.84	4.30	36.88
2017	-0.84	0.64	3.29	3.18	9.28	-2.53	1.41	-1.99					12.44

本公司依105年金管總字第010號許可證號進行期貨全權委託業務，惟不表示本投資絕無風險。期權交易財務槓桿高，投資人請慎重考量自身財務能力，並特別留意控管風險。歷史評估之績效不保證未來之最低收益或保證獲利。本公司除善盡管理人之注意義務外，不負責任何盈虧，亦不保證最低之收益。