

# BDQA200 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時，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：**BDQA200交易系統**

建議委託管理金額：**200萬元新台幣(單位)**

**優：**

BDQA交易系統多組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92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

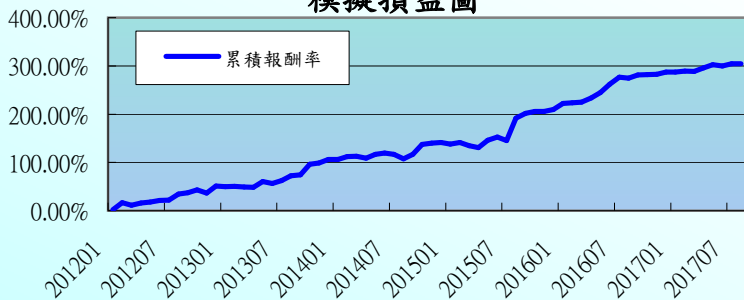
測試期間： 2012/01 ~ 2017/08

累積淨獲利	304.48%
最大連續虧損比率	-18.99%
平均年化報酬	53.73%
近一年之年化波動度	11.16%
近三年之年化波動度	33.27%
近五年之年化波動度	30.09%
三年平均年化波動度	28.49%
風險等級	V2
建議客戶風險承受等級	V3

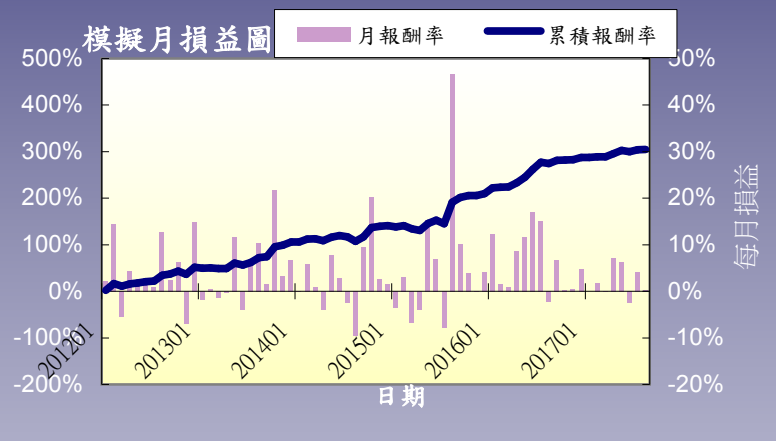
※風險等級：三年平均年化波動度，V1(0%~20%)、V2(20%~40%)、V3(40%以上)。

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	2.27	14.47	-5.35	4.32	2.36	2.91	0.84	12.71	2.50	6.25	-5.84	14.95	51.39
2013	-1.67	0.49	-1.23	-0.29	11.69	-3.83	5.48	10.49	1.58	21.82	3.25	6.73	54.51
2014	0.07	5.94	0.89	-3.95	7.72	2.88	-2.46	-9.45	9.45	20.25	2.68	1.43	35.45
2015	-3.33	2.99	-5.56	-3.95	15.31	6.83	-7.68	46.57	10.14	4.00	-0.16	4.23	68.39
2016	12.36	1.56	0.91	8.74	11.54	17.04	14.99	-2.09	6.68	0.37	0.54	4.84	77.48
2017	-0.02	1.81	-0.15	7.25	6.28	-2.41	4.23	0.27					17.26

本公司依105年金管期總字第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。