

BDQA500 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：BDQA500交易系統

建議委託管理金額：500萬元新台幣(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91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	291.11%
最大連續虧損比率	-18.32%
平均年化報酬	51.37%
近一年之年化波動度	12.50%
近三年之年化波動度	31.64%
近五年之年化波動度	28.82%
三年平均年化波動度	27.47%
風險等級	V2
建議客戶風險承受等級	V3

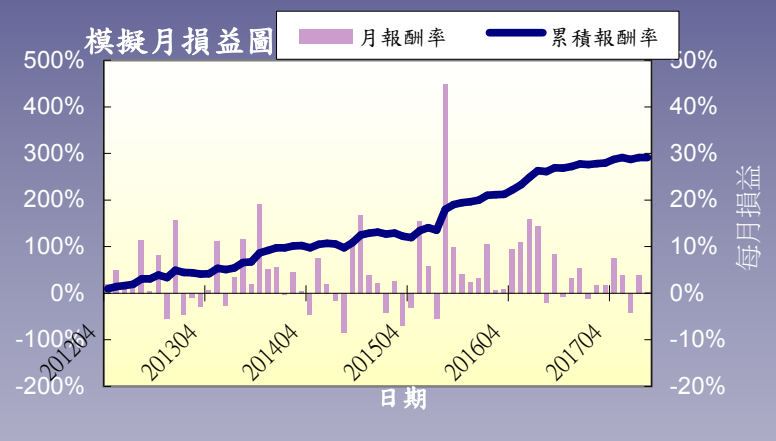
※風險等級：三年平均年化波動度，V1(0%~20%)、V2(20%~40%)、V3(40%以上)。

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	1.91	11.87	-5.38	2.02	4.88	2.40	2.50	11.39	0.51	8.11	-5.33	15.65	49.44
2013	-4.55	-0.96	-2.79	0.74	11.25	-2.57	3.49	11.57	1.94	19.09	5.30	5.62	48.13
2014	-0.25	4.52	0.39	-4.54	7.60	1.89	-1.44	-8.35	10.77	16.66	3.99	2.24	33.45
2015	-4.18	2.53	-5.87	-3.10	15.38	5.92	-5.48	44.94	9.90	4.15	2.41	3.21	68.80
2016	10.61	0.70	0.84	9.55	11.08	15.98	14.48	-1.96	8.27	-0.60	3.22	5.32	77.49
2017	-1.02	1.62	1.68	7.64	3.84	-4.03	3.87	0.20					13.79

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。