

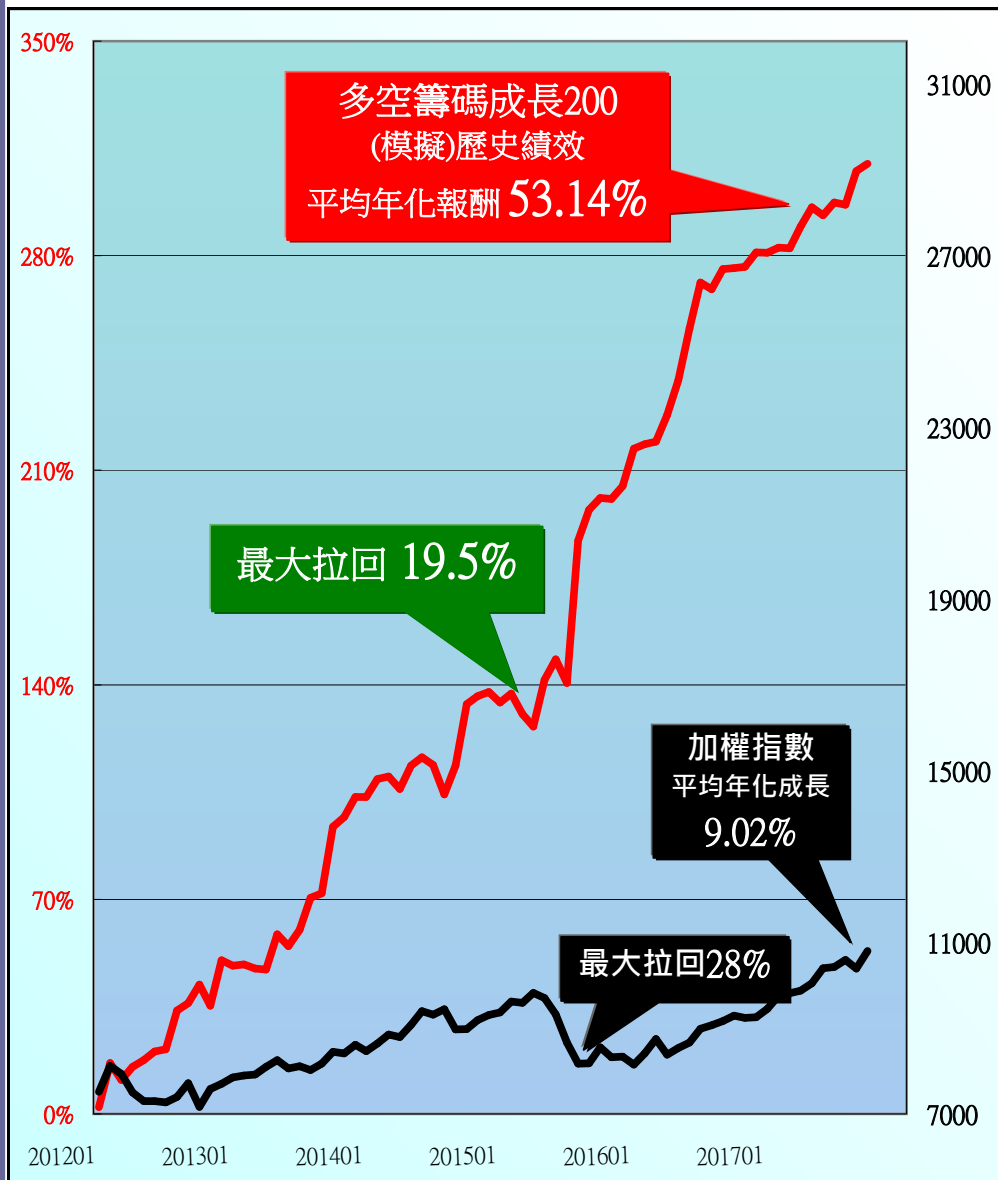
多空籌碼成長交易系統 偵測分析加權指數、台指期、選擇權歷史資料，以趨勢策略、價差策略，設計組合低相關當沖模組與波段模組。行情波動產生買賣訊號時，系統化交易。
交易經理人除監控交易系統是否確實執行，針對留倉部位，會建立選擇權部位避免系統風險。

產品模組代號：**多空籌碼成長200交易系統**

建議委託管理金額：**200萬元新台幣(單位)**

優：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：	2012/01-2017/10
累積淨獲利	309.97%
最大連續虧損比率	-19.51%
平均年化報酬	53.14%
近一年之年化波動度	13.50%
近三年之年化波動度	32.26%
近五年之年化波動度	30.25%
三年平均年化波動度	28.79%
風險等級	V2
建議客戶風險承受等級	V2-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	2.20	14.37	-5.47	4.22	2.25	2.81	0.73	12.60	2.40	6.14	-6.95	14.85	50.14
2013	-1.78	0.43	-1.34	-0.39	11.58	-3.93	5.37	10.39	1.48	21.71	3.15	6.62	53.28
2014	-0.02	5.86	0.79	-4.06	7.62	2.78	-2.57	-3.36	9.35	20.14	2.58	1.31	34.21
2015	-3.43	2.93	-6.67	-4.05	15.21	6.73	-7.79	46.47	10.04	3.90	-0.27	4.12	67.17
2016	12.26	1.50	0.80	8.65	11.44	16.94	14.89	-2.21	6.59	0.27	0.43	4.73	76.26
2017	-0.10	1.72	-0.27	7.16	6.18	-2.53	4.13	-0.68	10.92	2.37			28.91

◎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。模擬歷史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。