

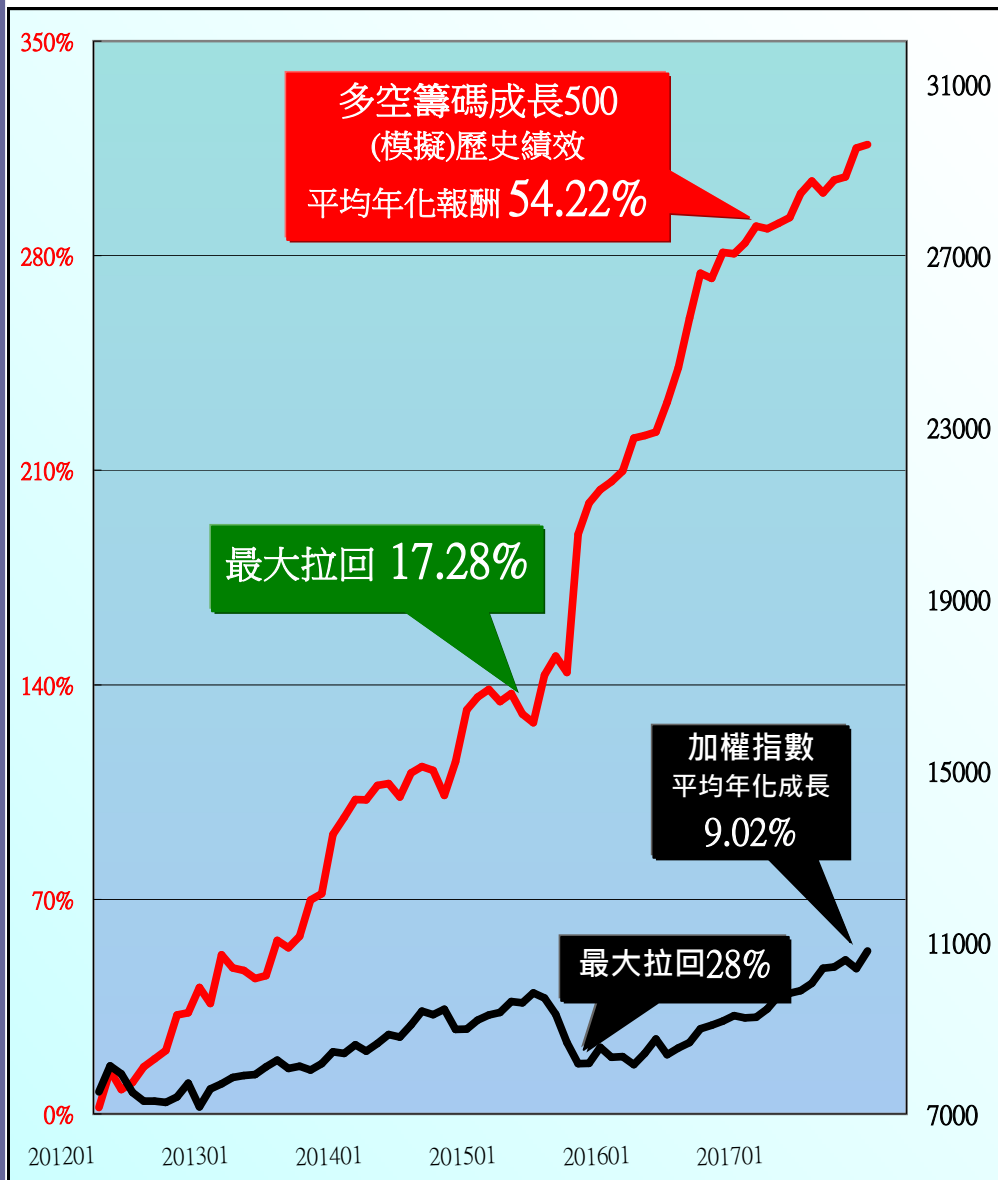
**多空籌碼成長交易系統** 偵測分析加權指數、台指期、選擇權歷史資料，以趨勢策略、價差策略，設計組合低相關當沖模組與波段模組。行情波動產生買賣訊號時，系統化交易。  
交易經理人除監控交易系統是否確實執行，針對留倉部位，會建立選擇權部位避免系統風險。

產品模組代號：**多空籌碼成長500交易系統**

建議委託管理金額：**500萬元新台幣(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	<b>316.29%</b>
最大連續虧損比率	<b>-17.28%</b>
平均年化報酬	<b>54.22%</b>
近一年之年化波動度	12.54%
近三年之年化波動度	30.89%
近五年之年化波動度	28.83%
三年平均年化波動度	27.39%
風險等級	<b>V2</b>
建議客戶風險承受等級	<b>V2-V3</b>

※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	2.06	12.07	-6.15	2.22	5.10	2.61	2.72	11.61	0.71	8.33	-3.21	15.86	51.94
2013	-4.33	-0.83	-2.58	0.94	11.47	-2.38	3.72	11.78	2.14	19.31	5.51	5.84	50.59
2014	-0.07	4.69	0.60	-4.33	7.81	2.09	-1.22	-3.15	10.98	16.88	4.19	2.48	35.93
2015	-3.98	2.66	-6.65	-2.90	15.58	6.13	-5.26	45.15	10.10	4.36	2.62	3.44	71.24
2016	10.82	0.83	1.07	9.74	11.29	16.19	14.68	-1.73	8.46	-0.40	3.44	5.54	79.93
2017	-0.86	1.80	1.91	7.82	4.04	-3.80	4.08	1.05	9.42	1.19			26.65

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。