永豐期貨 SinoPac Futures

期貨經理事業

WIN 全權委託管理期貨

此模組是以K棒型態創某新高或新低的精神，適而進場的系統性程式交易模組，將邏輯寫入程式後匯入歷史資料來驗證，在即時行情中系統會出現訊號建立部位，尾盤自動平倉的當沖模組。交易經理人除了監控程式交易系統是否有確實執行，亦會考量風險適時調整部位，透過規律性系統化交易原則可避免人性因為貪婪、恐懼的心理因而產生追高差低的情形。

產品模組代號：WIN 投資模組
建議委託管理金額：100萬元新台幣(單位)

優點：
全部當日沖銷不留倉，降低系統性風險的發生
缺點：
大盤盤勢在當天來回上下洗盤較容易出現虧損

模擬歷史評估之績效不保證未來之最低收益或保證獲利。

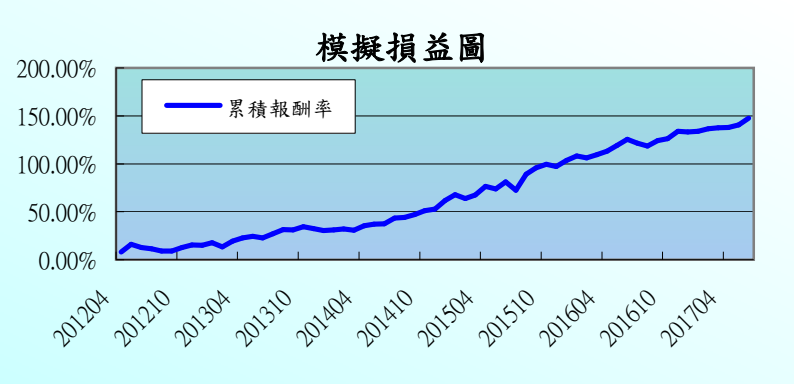
模擬歷史績效表

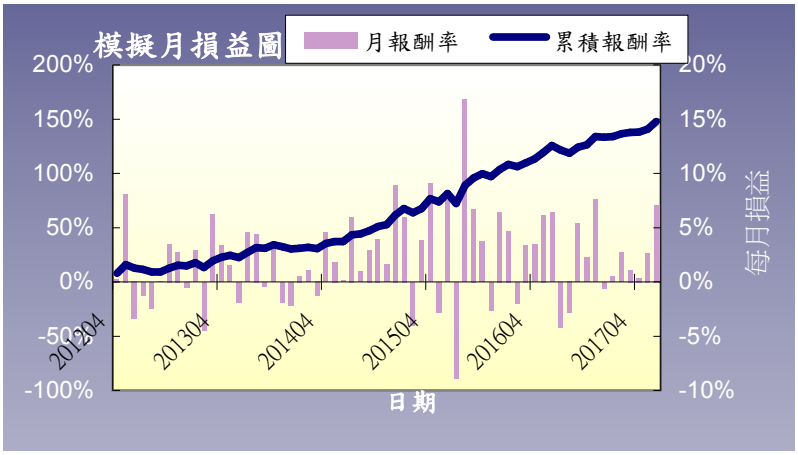
測試期間： 2012/01 ~ 2017/06

累積淨獲利	147.74%
最大連續虧損比率	-14.00%
平均年化報酬	26.86%
近一年之年化波動度	12.48%
近三年之年化波動度	16.53%
近五年之年化坡動度	14.47%
三年平均年化波動度	16.25%
風險等級	V1
建議客戶風險承受等級	V2

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

以上模擬歷史績效評估假設前提為市場能正常成交之狀況，例如行情出現漲跌停板時，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

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	0.84	8.46	-1.62	0.26	8.12	-3.38	-1.20	-2.42	0.04	3.52	2.74	-0.50	14.86
2013	2.88	-4.44	6.22	3.32	1.54	-1.84	4.56	4.42	-0.42	3.24	-1.86	-2.12	15.50
2014	0.56	1.04	-1.26	4.58	1.84	0.16	6.00	0.96	2.94	3.96	1.60	8.90	31.28
2015	5.98	-3.96	3.82	9.08	-2.78	7.50	-8.88	16.80	6.72	3.72	-2.56	6.46	41.90
2016	4.70	-1.96	3.40	3.46	6.16	6.40	-4.20	-2.82	5.40	2.28	7.58	-0.56	29.84
2017	0.50	2.72	1.08	0.36	2.66	7.04							14.36

月獲利5%以上　月損失5%以上　單位: %

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。

永豐期貨股份有限公司｜台北市重慶南路一段二號八樓｜TEL: (02)2382-9386｜105年金管期總字第010號