

永豐金選組合

期權交易策略主要是為積極型客群量身訂作的期權交易模組，以高風險高報酬為主軸，運用期權商品特性，控制變量，以價差策略將風險鎖住並利用買進策略擴大獲利報酬。透過規律原則，將停損停利與資金控管發揮極致，可避免人性因**貪婪**、**恐懼**的心理因素而產生凹單，虧損時攤平的情形。

產品模組代號：SX0-1000

建議委託管理金額：1000萬元新台幣(單位)

優：

此交易策略是以固定期間交易價差模組，買進訊號產生時以買進買權及買進賣權交易策略，風險與報酬皆可事先控制。

劣：

對單一價履約價市場胃納量有限，策略進場時會因當時市場交易量而影響價格，產生滑價風險。

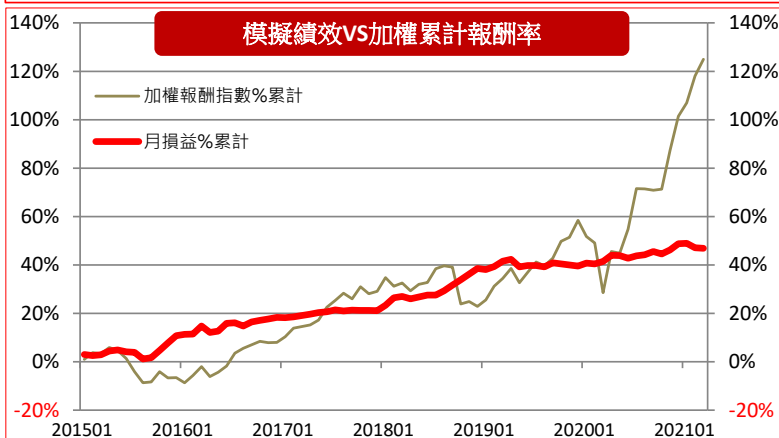
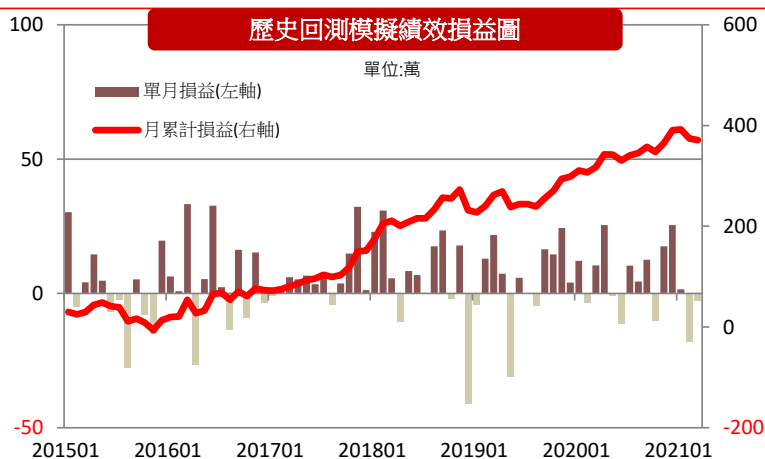
模擬歷史績效表

測試期間： 2015/01 ~ 2021/03

累積淨獲利	46.83%
最大連續虧損比率	(4.55%)
平均年化報酬	5.96%
近一年之年化波動度	4.92%
近三年之年化波動度	4.67%
近五年之年化波動度	4.47%
三年平均年化波動度	4.44%
風險等級	V1
建議客戶風險承受等級	V1

※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。



損益 %	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%
2015	3.02	(0.51)	0.42	1.45	0.47	(0.71)	(0.24)	(2.75)	0.52	(0.78)	(1.50)	1.97	1.35
2016	0.63	0.08	3.33	(2.65)	0.53	3.27	0.23	(1.35)	1.62	(0.90)	1.52	(0.35)	5.96
2017	(0.09)	0.26	0.60	0.52	0.67	0.35	0.76	(0.43)	0.37	1.49	3.23	0.12	7.84
2018	2.29	3.09	0.56	(1.04)	0.84	0.68	0.02	1.76	2.35	(0.20)	1.79	(4.11)	8.03
2019	(0.44)	1.29	2.17	0.73	(3.10)	0.58	(0.04)	(0.47)	1.64	1.45	2.43	0.40	6.66
2020	1.22	(0.37)	1.05	2.55	(0.09)	(1.15)	1.03	0.44	1.26	(1.01)	1.75	2.55	9.23
2021	0.15	(1.81)	(0.29)										(1.95)

本公司依109年金管期總字第008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。