

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，以適當風險報酬為主軸，運用期權商品特性控制風險，並利用買方策略擴大獲利報酬。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。

優：依據當前市場波動，透過系統化模組規劃風險，配置適當之交易策略。

劣：市場買納量有限，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。

建議委託管理金額：3,000萬元新台幣

模擬歷史績效表

測試期間： 2017/01 ~ 2023/09

累積淨獲利 143.25%

最大連續虧損比率 (9.67%)

平均年化報酬 21.22%

近一年之年化波動度 10.44%

近三年之年化波動度 11.50%

近五年之年化波動度 10.93%

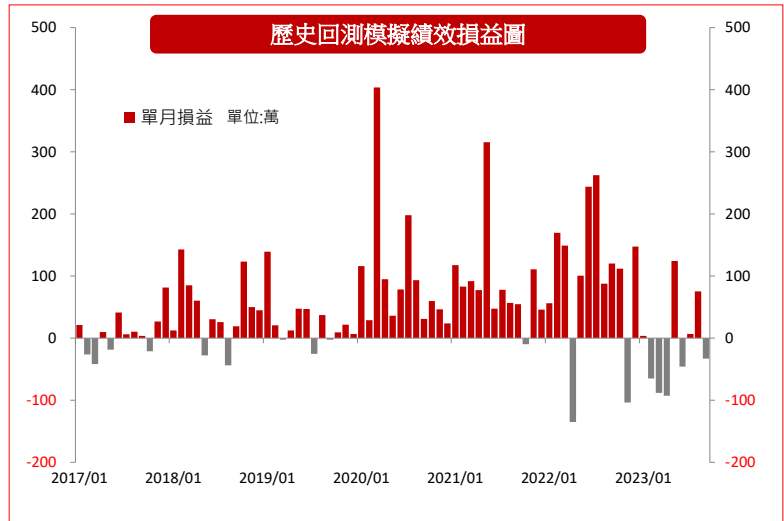
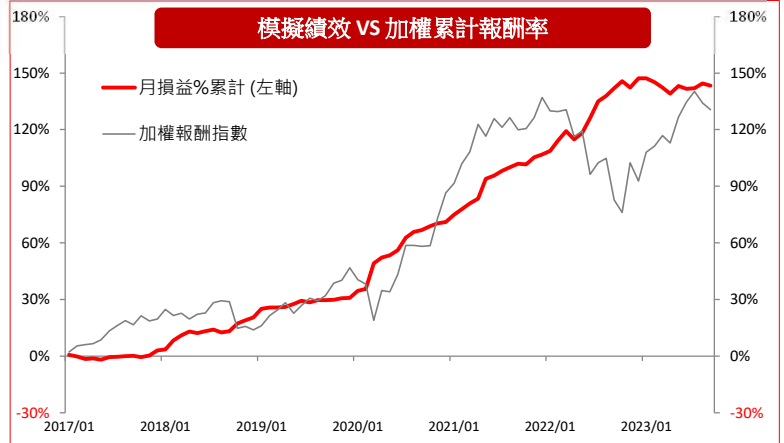
三年平均年化波動度 10.54%

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，委任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%
2017	0.70	-0.88	-1.40	0.32	-0.62	1.37	0.20	0.34	0.12	-0.70	0.89	2.71	3.05
2018	0.40	4.75	2.83	2.01	-0.93	1.02	0.86	-1.46	0.64	4.11	1.66	1.49	17.39
2019	4.63	0.68	-0.08	0.42	1.59	1.57	-0.85	1.23	-0.09	0.31	0.72	0.21	10.35
2020	3.86	0.96	13.47	3.15	1.20	2.62	6.60	3.11	1.04	1.99	1.54	0.79	40.32
2021	3.92	2.77	3.06	2.58	10.52	1.59	2.60	1.90	1.83	-0.33	3.70	1.53	35.67
2022	1.88	5.65	4.97	-4.51	3.35	8.12	8.75	2.92	4.01	3.73	-3.46	4.92	40.34
2023	0.12	-2.16	-2.94	-3.10	4.14	-1.53	0.23	2.50	-1.10				-3.86

本公司依111年金管期總字第007號許可證號進行期貨全權委託業務，惟不表示本交易或投資絕無風險。期權交易財務槓桿高，委任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。