

永豐金選組合

**期權交易策略** 主要是為穩健型客群量身訂作的期權交易模組，以低風險適度報酬為主軸，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 49.11%

最大連續虧損比率 (3.42%)

平均年化報酬 7.28%

近一年之年化波動度 3.95%

近三年之年化波動度 3.90%

近五年之年化波動度 3.54%

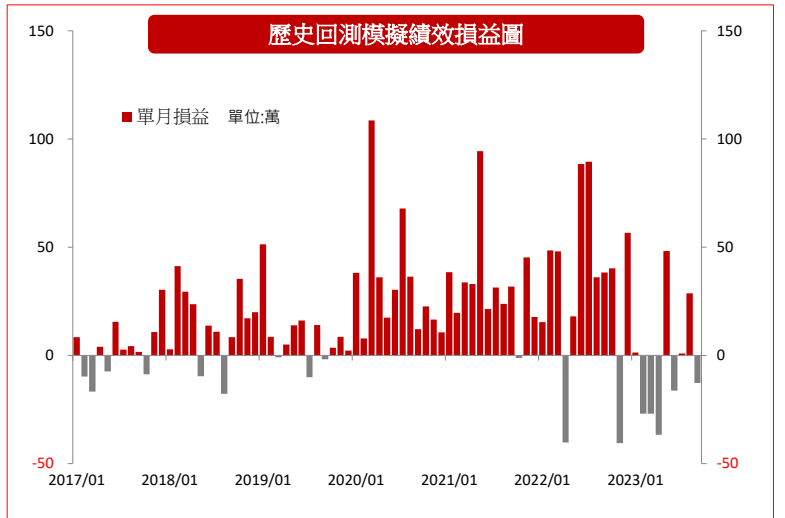
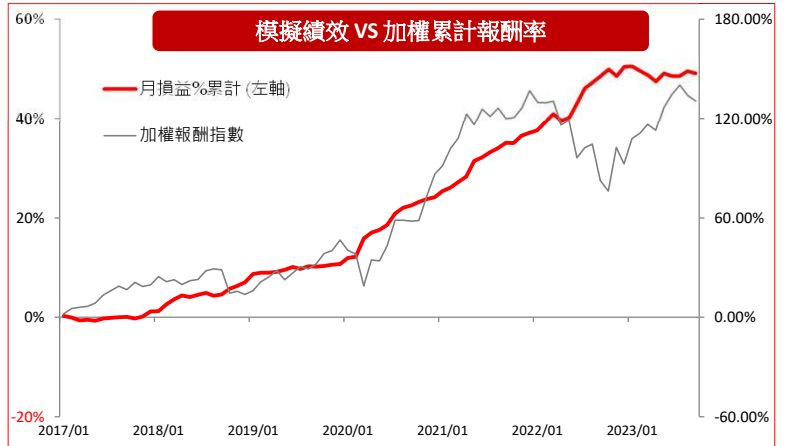
三年平均年化波動度 3.52%

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	0.28	-0.33	-0.56	0.13	-0.25	0.52	0.09	0.14	0.05	-0.29	0.36	1.01	1.16
2018	0.10	1.38	0.98	0.79	-0.32	0.46	0.36	-0.59	0.28	1.18	0.57	0.66	5.84
2019	1.71	0.29	-0.03	0.17	0.46	0.53	-0.34	0.47	-0.06	0.12	0.29	0.07	3.68
2020	1.27	0.26	3.62	1.20	0.58	1.01	2.26	1.21	0.40	0.76	0.55	0.36	13.49
2021	1.28	0.66	1.12	1.10	3.15	0.72	1.05	0.79	1.06	-0.04	1.51	0.59	12.99
2022	0.51	1.62	1.60	-1.34	0.60	2.95	2.98	1.20	1.28	1.34	-1.35	1.89	13.29
2023	0.04	-0.90	-0.90	-1.22	1.61	-0.54	0.03	0.96	-0.42				-1.35

本公司依111年金管總字第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。