

永豐金優選300

期權交易策略

採用量化交易模組，運用期貨商品與選擇權不同履約價特性，依大盤慣性與變量，推測價格走勢方向，藉由程式交易的一致性與穩定性，避免投資人因貪婪、恐懼心理因素，出現虧損攤平、凹單等情形損失，獲取交易合理與穩定報酬，模組內容包含籌碼、趨勢、乖離及當沖等不同特性策略程式。

建議委託金額 300萬新台幣

模擬歷史績效表

測試期間： 2020/01 ~ 2024/11

累積淨獲利 40.52%

最大連續虧損比率 2.69%

平均年化報酬 8.24%

近一年之年化波動度 3.63%

近三年之年化波動度 3.65%

三年平均年化波動度 3.70%

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)。

※客戶承受風險等級：V1(穩健型)、V2及V3(積極型)

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，委任人仍必須了解期貨與選擇權之交易風險。

模擬績效-累計損益%



歷史回測模擬績效損益圖



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%
2020	0.46	-0.05	2.89	1.69	-0.34	0.92	1.04	0.99	0.31	0.95	1.90	0.22	10.98
2021	1.95	1.18	1.19	0.41	-0.16	1.25	-0.45	0.99	3.28	-0.54	1.60	1.55	12.24
2022	-0.36	0.81	-0.45	-1.26	0.57	0.34	1.36	0.15	-0.05	-0.87	2.99	0.63	3.87
2023	1.87	0.13	0.24	-0.40	2.23	0.04	0.92	-1.12	0.27	-0.77	0.90	-0.25	4.06
2024	0.29	0.40	1.59	1.15	3.09	1.30	1.38	-0.12	0.91	-0.93	0.31		9.37

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。

永豐期貨股份有限公司 統編：84309615 | 台北市重慶南路一段二號八樓 | TEL: (02)2382-9386 | 111年金管總字第007號