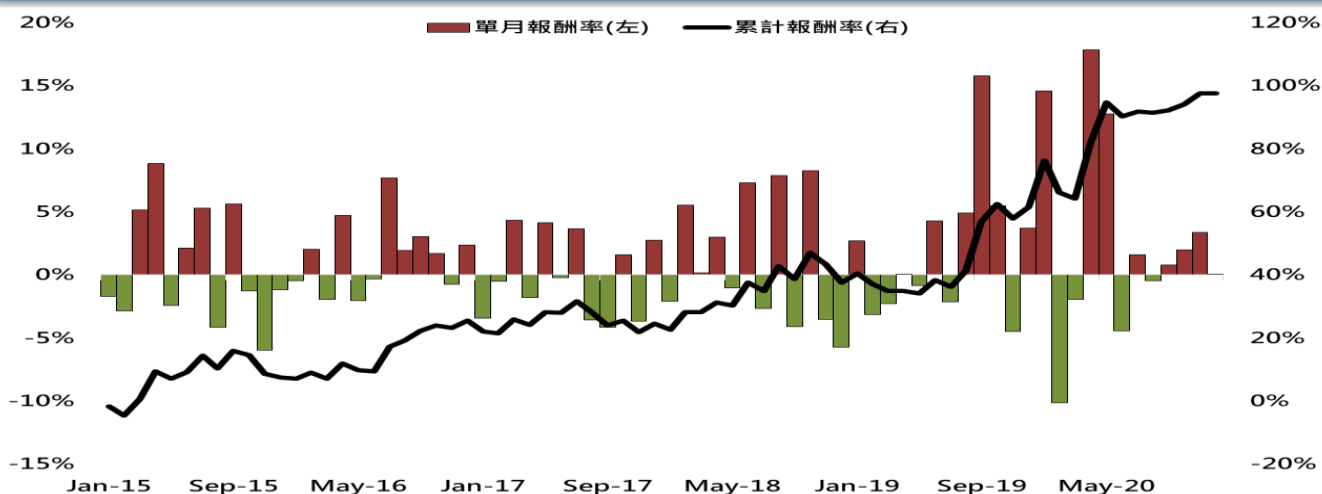


## 國期DS策略訊號

特色:

1. 標的: WTI輕原油
2. 每月皆以10萬美金為投資金額
3. 利用油價供需尋找進入市場機會
4. 考量美元對油價影響
5. 追求賺賠比高，資金累計穩定上升
6. 需注意原油波動大風險

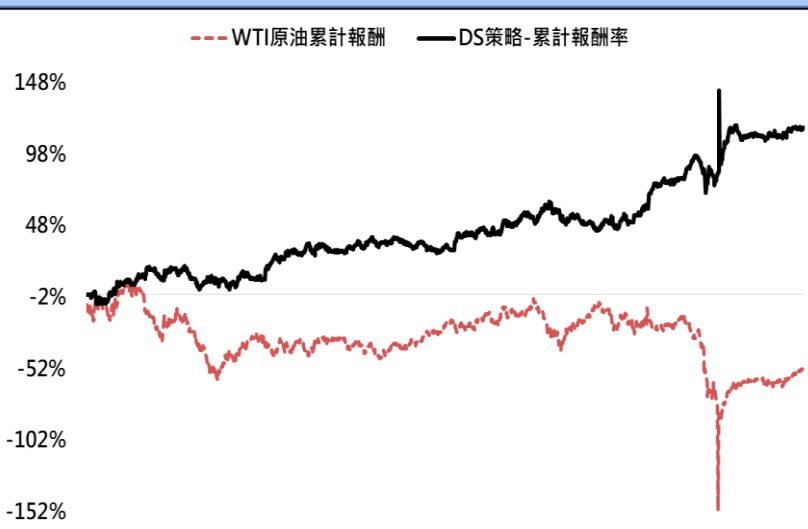
策略回測損益率(%)



訊號回測績效表(美元)

回測時間:	20150101-20201231
起始資金:	\$ 100,000
淨利:	\$ 97,080
累計淨獲利率:	97.08%
年化報酬率:	11.97%
交易成本:	來回80美金(8個Ticker)
最大策略虧損(%)	-24.54
賺賠比:	1.18
平均交易週期:	8.6
交易總次數:	178
勝率(%)	57.0

策略回測與近月WTI原油累計報酬率(%)



年份	一月	二月	三月	四月	五月	六月	七月	八月	九月	十月	十一月	十二月	全年報酬	交易次數
2015	-1.71%	-2.87%	5.15%	8.86%	-2.41%	2.14%	5.29%	-4.16%	5.64%	-1.25%	-5.96%	-1.17%	7.55%	29
2016	-0.46%	2.01%	-1.95%	4.70%	-2.03%	-0.33%	7.70%	1.94%	3.04%	1.72%	-0.73%	2.35%	17.96%	33
2017	-3.43%	-0.53%	4.33%	-1.79%	4.16%	-0.21%	3.65%	-3.56%	-4.15%	1.61%	-3.68%	2.74%	-0.86%	25
2018	-2.07%	5.54%	0.16%	3.01%	-1.05%	7.32%	-2.64%	7.89%	-4.10%	8.24%	-3.53%	-5.75%	13.02%	28
2019	2.70%	-3.16%	-2.28%	0.04%	-0.83%	4.28%	-2.15%	4.89%	15.79%	5.47%	-4.48%	3.70%	23.97%	32
2020	14.60%	-10.14%	-1.96%	17.83%	12.76%	-4.44%	1.62%	-0.47%	0.79%	1.98%	3.37%	0.05%	35.99%	31