

國期F1程式訊號

(訊號範例)

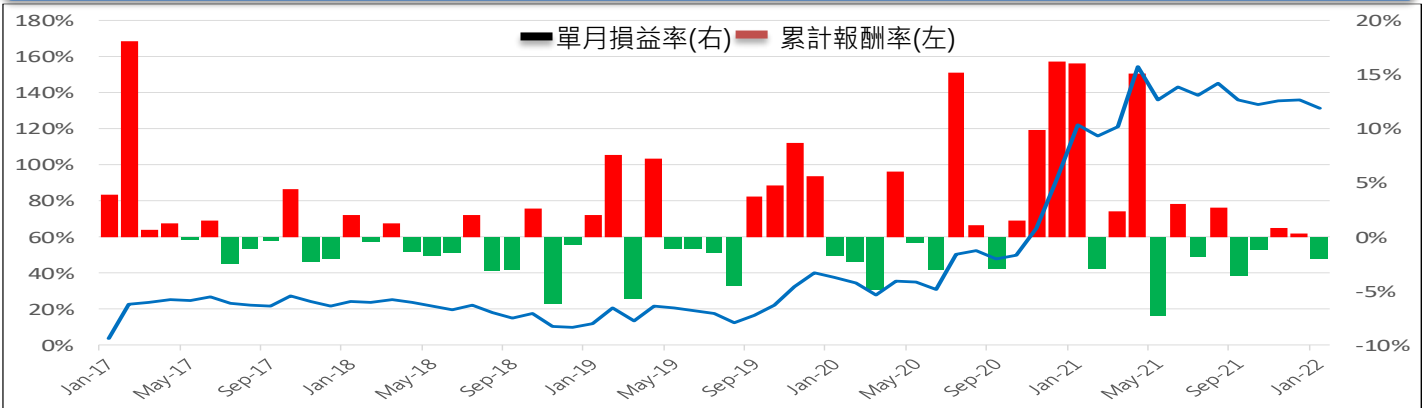
特色:

1. 追蹤選擇權籌碼，並兼顧指數趨勢與動能。
2. 波段交易的設計，濾除雜訊以追求長期正報酬。
3. 加碼與停損機制，透過資金管理有效提升策略績效。
4. 交易訊號以簡訊提醒，節省程式設定與維護時間成本。
5. 可與其他程式訊號搭配使用，以期達成帳戶損益平滑效果。

國泰期貨程式訊號會員您好
訊號時間-5/31 16:00
程式名稱-國期F1
訊號說明-多單進場
昨日部位-無

國泰期貨程式訊號會員您好
訊號時間-6/11 16:00
程式名稱-國期F1
訊號說明-多單出場
昨日部位-多單一口

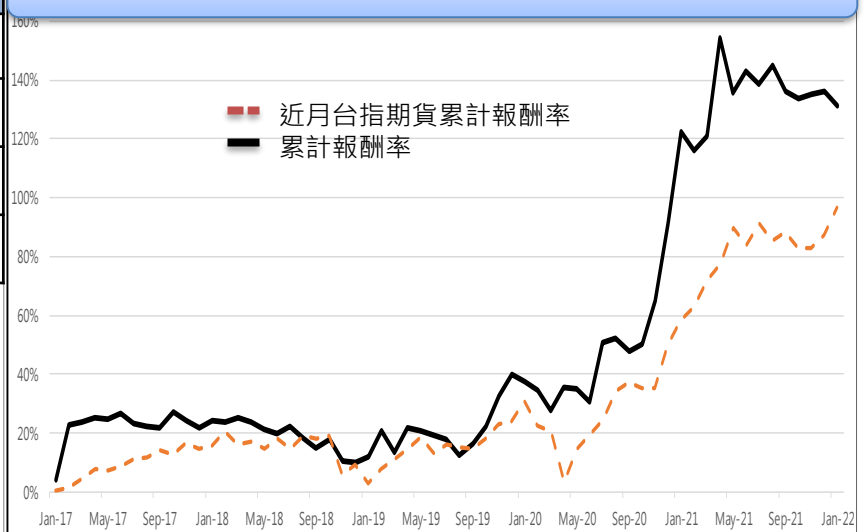
策略模擬交易回測損益率(%)



策略模擬交易回測績效表

回測期間	2017/01-22/1
累計淨獲利率	131.42%
最大連續虧損率	(7.1%)
平均年化報酬率	18.27%

策略模擬交易回測與近月台指期貨累計報酬率(%)



績效計算說明:

使用商品:台指日盤
資金設定:300萬元
加碼機制:最大留倉口數10口
進出場價:訊號成立隔日之開盤價
滑價設定5點、含手續費

回測模擬分析%	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月	獲利合計%	虧損合計%	年度績效%	交易次數
2017	3.93	18.12	0.69	1.25	-0.30	1.54	-2.54	-1.02	-0.37	4.43	-2.23	-2.02	29.95	-8.48	21.47	80
2018	2.00	-0.42	1.28	-1.36	-1.70	-1.48	1.98	-3.06	-2.99	2.65	-6.13	-0.72	7.91	-17.86	-9.95	58
2019	2.06	7.58	-5.74	7.25	-1.01	-1.07	-1.45	-4.46	3.70	4.74	8.65	5.58	39.55	-13.73	25.82	79
2020	-1.73	-2.33	-4.89	6.02	-0.51	-3.02	15.17	1.10	-2.97	1.53	9.91	16.23	49.96	-15.45	34.51	61
2021	16.05	-2.94	2.40	15.12	-7.32	3.09	-1.84	2.67	-3.63	-1.11	0.81	0.29	40.43	-16.83	23.60	82
2022	-1.97															8