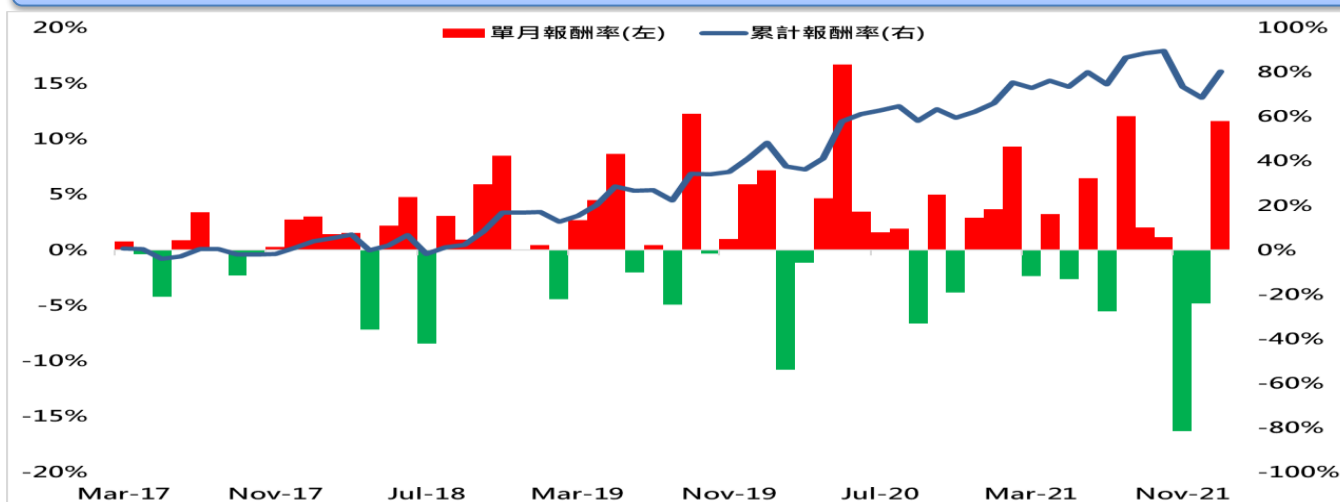


國期DS策略訊號

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.考量原油庫存對油價影響
- 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

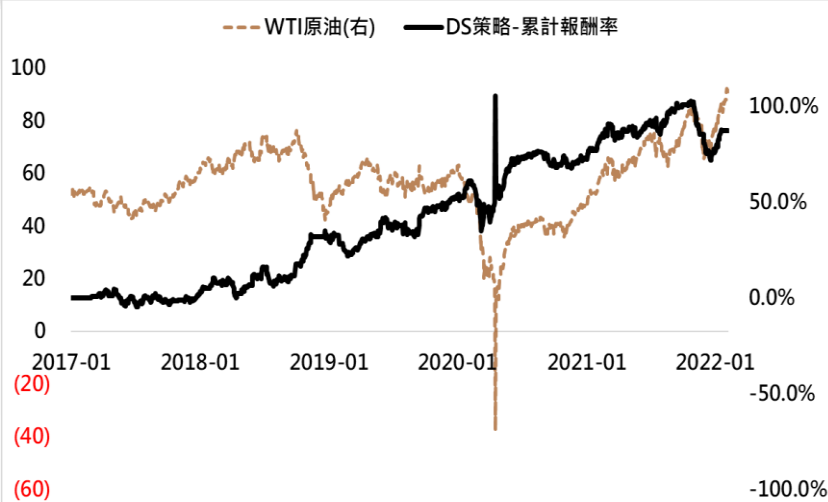
策略模擬交易回測損益率(%)



訊號回測績效表(美元)

回測時間：	20170101-20201231
起始資金：	\$ 100,000
淨利：	\$ 80,370
累計淨獲利率：	80.37%
年化報酬率：	12.52%
交易成本：	來回80美金(8個Ticker)
最大策略虧損(%)	-29.08
賺賠比：	1.19
平均交易週期：	12.8
交易總次數：	82
勝率(%)：	59.8

策略模擬交易回測與近月WTI原油累計報酬率(%)



年月	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	加總
2017	0.00%	0.00%	0.76%	-0.37%	-4.18%	0.87%	3.41%	-0.08%	-2.27%	-0.24%	0.30%	2.74%	0.94%
2018	3.03%	1.45%	1.55%	-7.16%	2.20%	4.77%	-8.42%	3.06%	0.96%	5.94%	8.51%	0.00%	15.89%
2019	0.44%	-4.40%	2.68%	4.52%	8.65%	-2.02%	0.47%	-4.89%	12.27%	-0.29%	1.02%	5.92%	24.37%
2020	7.16%	-10.76%	-1.12%	4.67%	16.74%	3.48%	1.62%	1.93%	-6.59%	5.01%	-3.83%	2.91%	21.22%
2021	3.68%	9.30%	-2.34%	3.24%	-2.62%	6.46%	-5.53%	12.05%	2.02%	1.14%	-16.29%	-4.81%	6.30%
2022	11.65%												11.65%
月均(%)	4.33%	-0.88%	0.31%	0.98%	4.16%	2.71%	-1.69%	2.41%	1.28%	2.31%	-2.06%	1.35%	13.40%