

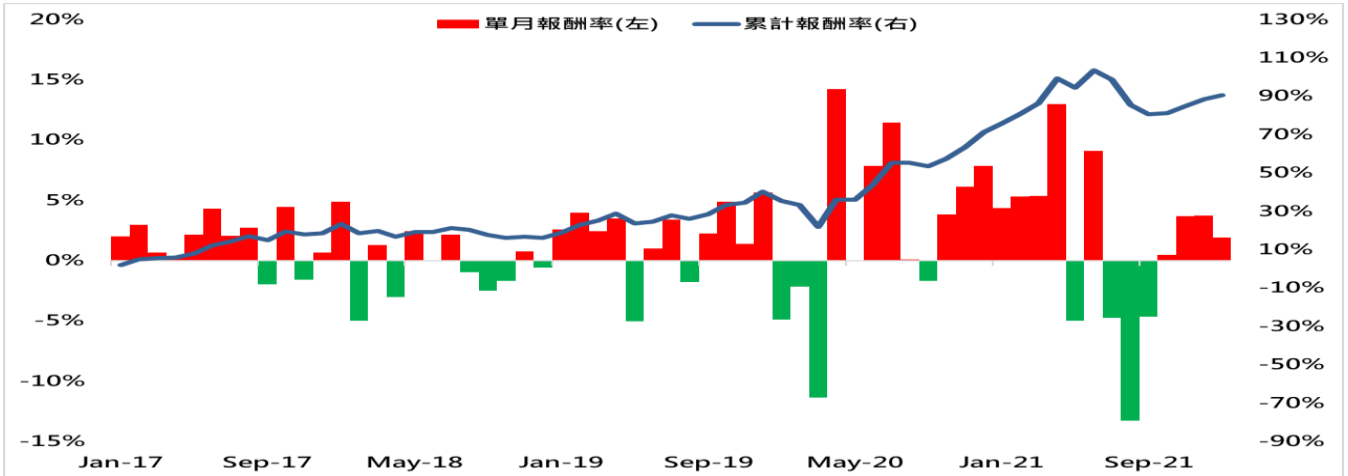
國期SPC策略訊號

特色:

1. 標的：大台指期貨
2. 每月皆以200萬為投資金額
3. 追蹤選擇權籌碼之市場情緒

4. 追求賺賠比高，逐步累積財富
5. 過濾交易次數，降低頻繁進出
6. 此策略為日收盤回測，實際盤中可能面臨較大虧損壓力

策略模擬交易回測損益率(%)



訊號回測績效表

回測時間：	20150101-20201231
起始資金：	\$ 2,000,000
淨利：	\$ 1,847,200
累計淨獲利率：	92.36%
年化報酬率：	11.52%
交易成本：	來回1,000元(5點)
最大策略虧損(%)	-20.16
賺賠比：	1.27
平均交易週期：	17.8
交易總次數：	76
勝率(%)：	64.8

策略模擬交易回測與近月台指期貨累計報酬率(%)



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	2.01%	2.97%	0.64%	0.21%	2.13%	4.27%	2.02%	2.73%	-1.99%	4.45%	-1.60%	0.66%	18.50%
2018	4.89%	-5.02%	1.25%	-3.04%	2.44%	0.05%	2.13%	-0.97%	-2.51%	-1.71%	0.74%	-0.58%	-2.34%
2019	2.58%	3.96%	2.42%	3.47%	-5.07%	0.98%	3.37%	-1.77%	2.21%	4.85%	1.38%	5.62%	24.00%
2020	-4.90%	-2.17%	-11.39%	14.19%	-0.04%	7.86%	11.42%	0.07%	-1.70%	3.82%	6.10%	7.83%	31.08%
2021	4.35%	5.31%	5.35%	12.99%	-5.00%	9.10%	-4.75%	-13.29%	-4.66%	0.46%	3.68%	3.70%	17.25%
2022	1.90%												1.90%
月均(%)	1.81%	1.01%	-0.35%	5.56%	-1.11%	4.45%	2.84%	-2.65%	-1.73%	2.37%	2.06%	3.45%	15.07%