



策略說明

商品：台指期

屬性：順逆勢波段/小停損/多空雙向/全日盤/40分K

交易成本：來回5ticks

最大在倉口數：1口

說明：以近期價格均線的位置及角度當濾網，搭配近日高低點波動度組合的原創指標，能有效的過濾盤整期，並在價格波動開始發生的時候進場，不漏掉波段行情。

出場以絕對比例停損，搭配條件型移動出場。

最大策略虧損(MDD)：233,800

建議資金：4倍最大連續虧損

2023年開始為擬真績效
表格績效統計至2023/05/31

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	全年損益
2020	61,900	-38,700	51,400	117,200	-28,200	7,900	117,100	2,400	-59,800	-64,600	190,000	212,100	568,700
2021	213,000	169,100	27,100	137,500	247,800	-58,600	-56,400	354,300	38,000	100,700	41,600	-40,800	1,173,300
2022	23,600	8,600	118,800	3,800	107,900	-4,400	-127,900	19,200	3,800	54,800	276,200	-24,200	460,200
2023	214,400	-10,600	-44,200	45,500	64,500								269,600

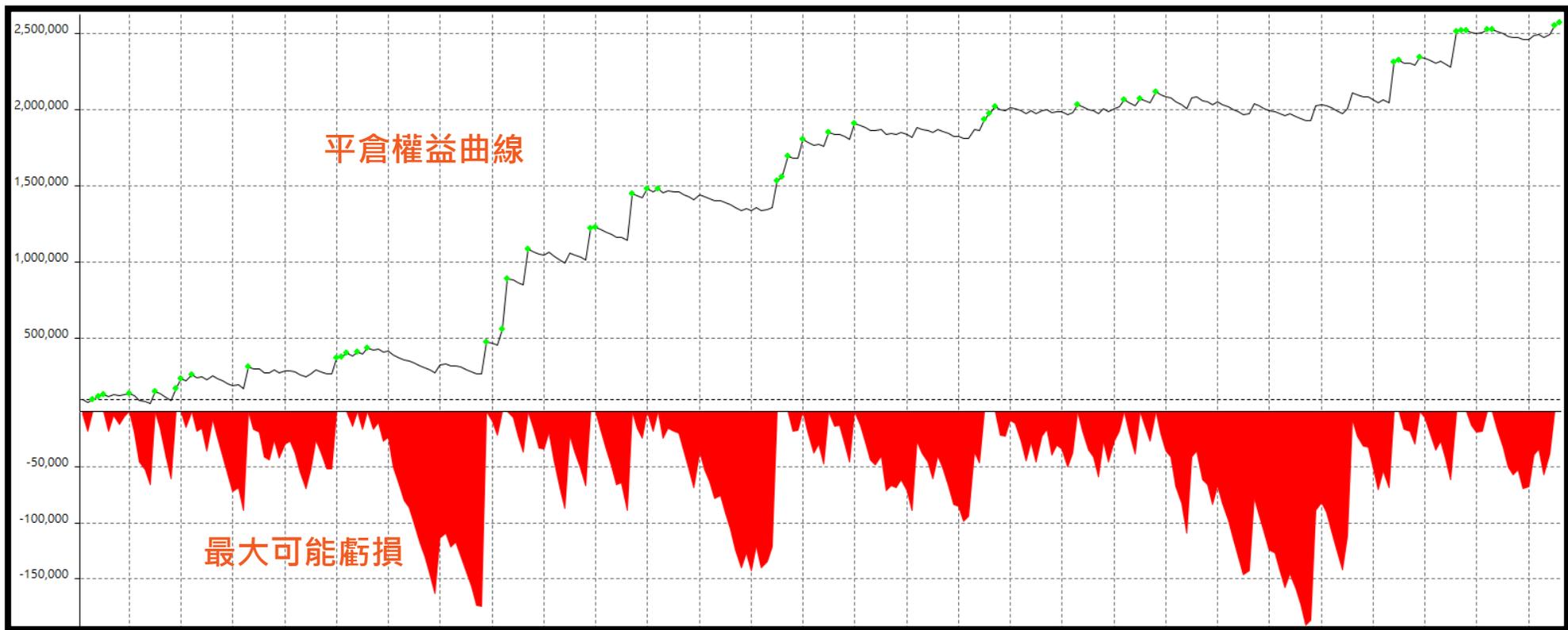
110年金管期總字第 005號 凱基期貨股份有限公司 研究發展部 地址：台北市中正區重慶南路一段2號13樓 電話：(02)2361-9889 網站：www.kgifutures.com.tw

此文宣供合格業務員使用；策略逐筆交易紀錄請向凱基期貨研發部索取，以上內容僅供參考，過去最大連損不代表未來最大連損，投資操作有其風險，輔助工具亦有其功能限制（使用電子下單交易委託買賣時，仍可能面臨斷線、斷電、網路壅塞等不確定因素，致使委託買賣無法傳送或接收或延遲，請投資人自行評估），以往之操作績效不保證未來之最低收益，不負責任何盈虧。

交易者從事期貨交易前，應確實評估自身之交易能力(如年齡、期貨了解程度、交易經驗及資產狀況等)，以掌握交易風險。



凱基精選策略 土星績效圖



2020/1/1

2023/05/31