



### 策略說明

商品：台指期

屬性：逆勢波段/固定停利/區間停損/空方單向/全日盤/15分K

交易成本：來回5ticks

最大在倉口數：1口

說明：台指期全天盤波段逆勢型態策略，M頭形成，線形向下突破短區間進場空單，向上破區間則止損，當天獲利7%先停利出場。

**最大連續虧損(MDD)：-166,600**

**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

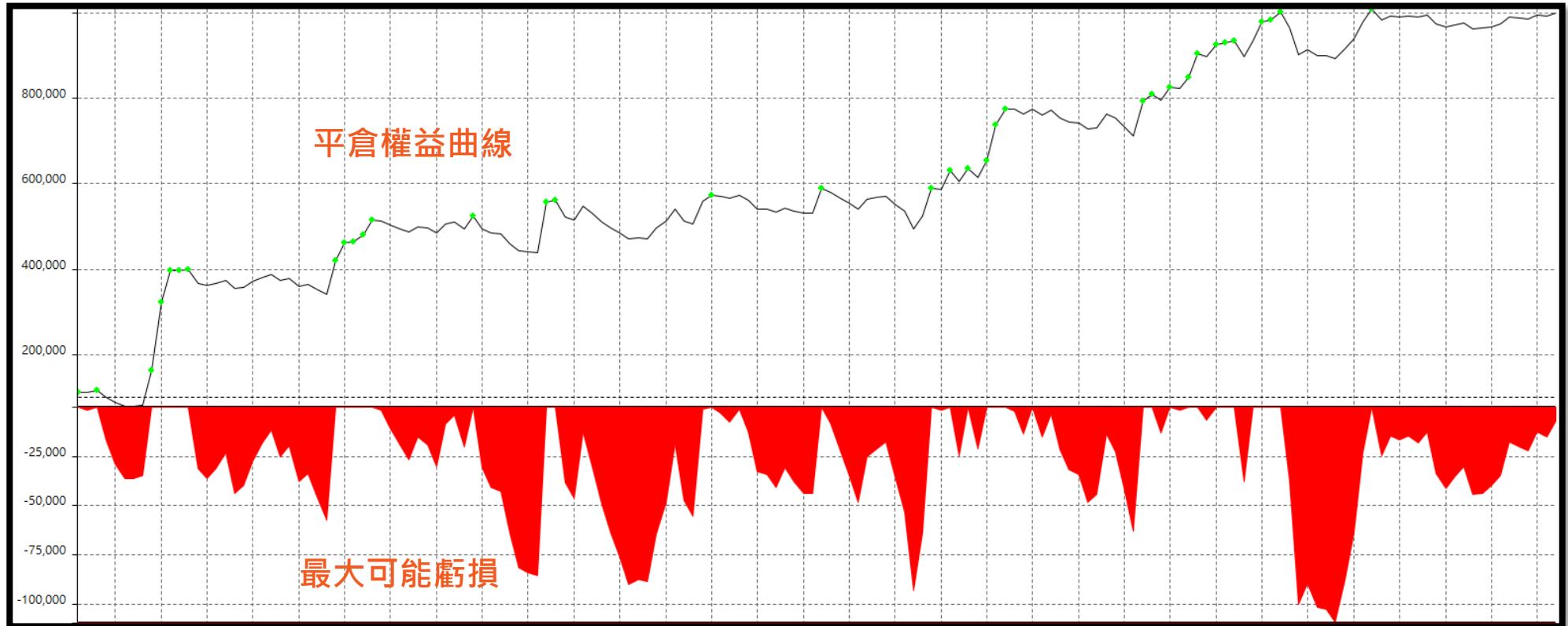
年份	一月	二月	三月	四月	五月	六月	七月	八月	九月	十月	十一月	十二月	全年損益
2020	3,800	-19,900	264,700	13,000	-4,400	8,000	-37,800	126,700	46,900	-1,600	-17,600	-10,800	371,000
2021	21,400	19,000	-42,600	-42,800	82,600	25,600	-75,000	69,000	17,600	-18,000	-11,000	50,000	95,800
2022	-9,600	17,800	29,100	163,000	-26,700	44,700	-2,500	107,800	78,200	-69,200	1,800	76,000	410,400
2023	1,800	-5,100	-19,900	27,200	5,400								9,400

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](http://www.kgifutures.com.tw)

本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。

交易人從事期貨交易前，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  
木星績效圖



2020/1/1

2023/05/31

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](http://www.kgifutures.com.tw)

本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。

交易人從事期貨交易前，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。