

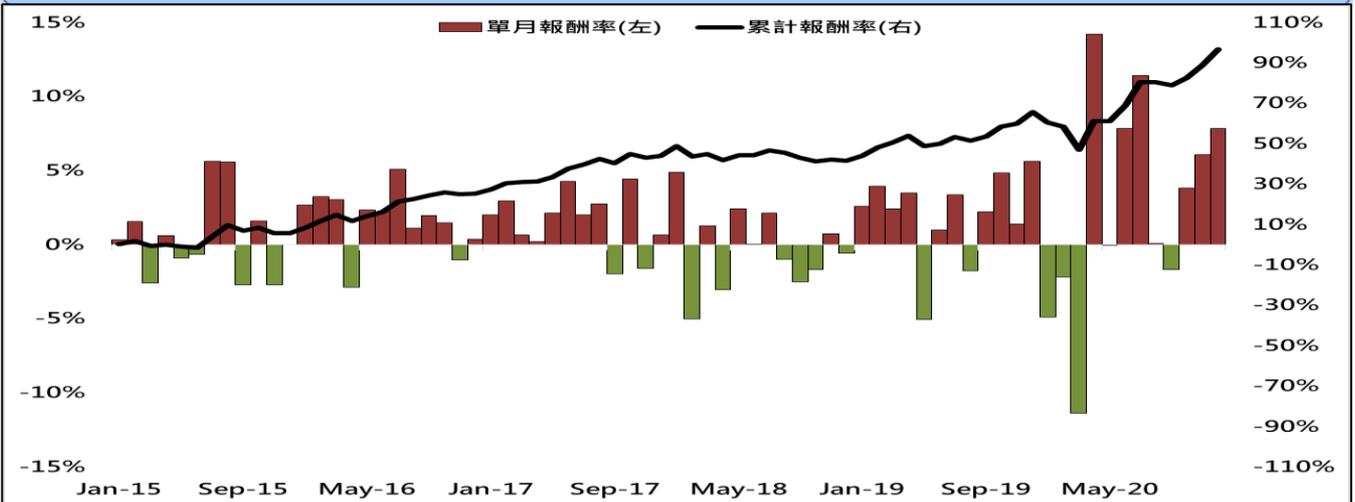
# 國期SPC策略訊號

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

策略回測與近月台指期貨累計報酬率(%)



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	全年報酬	交易次數
2015	0.35%	1.55%	-2.60%	0.61%	-0.91%	-0.66%	5.63%	5.60%	-2.71%	1.62%	-2.73%	0.00%	5.75%	12
2016	2.67%	3.26%	3.02%	-2.88%	2.33%	2.21%	5.09%	1.11%	1.96%	1.48%	-1.03%	0.38%	19.60%	12
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%	13
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%	13
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%	13
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%	13