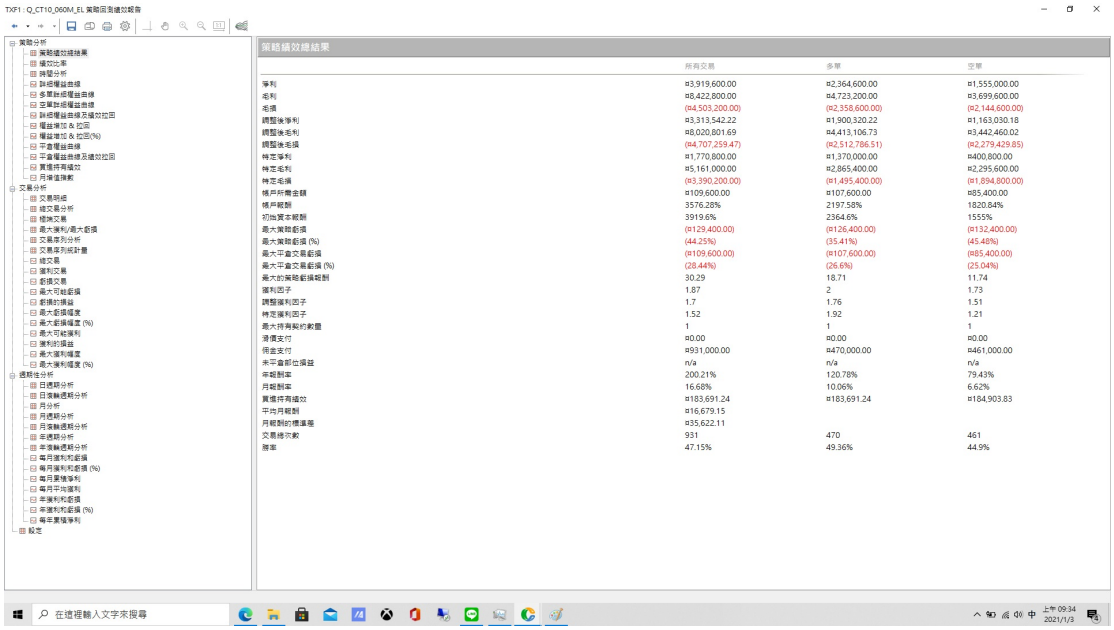
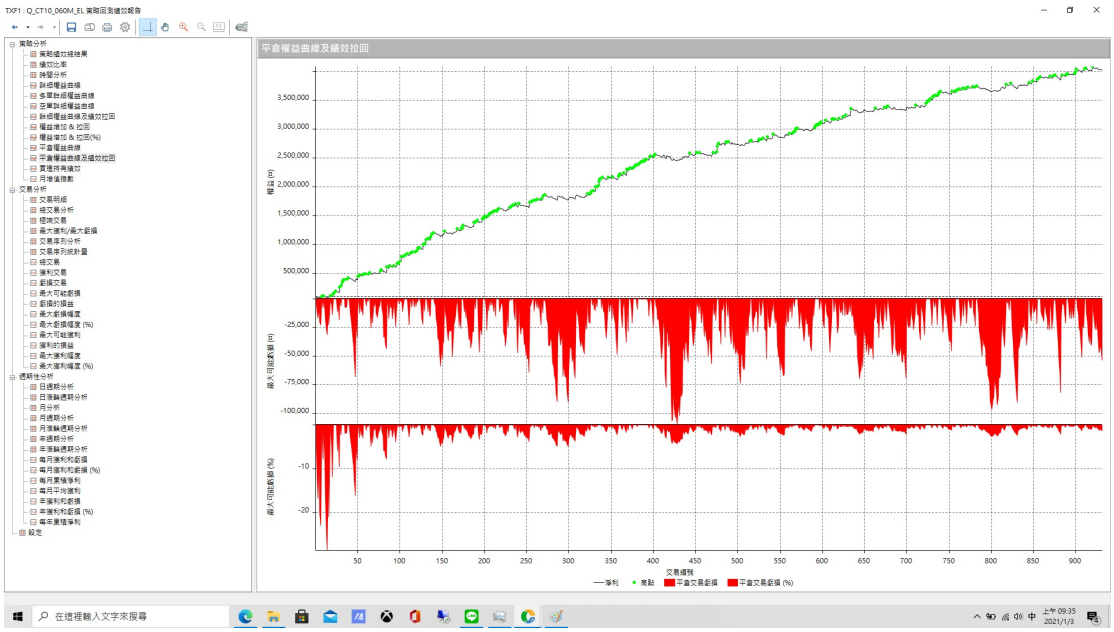
[策略罐頭]臺指期波段全新投組電子書課程

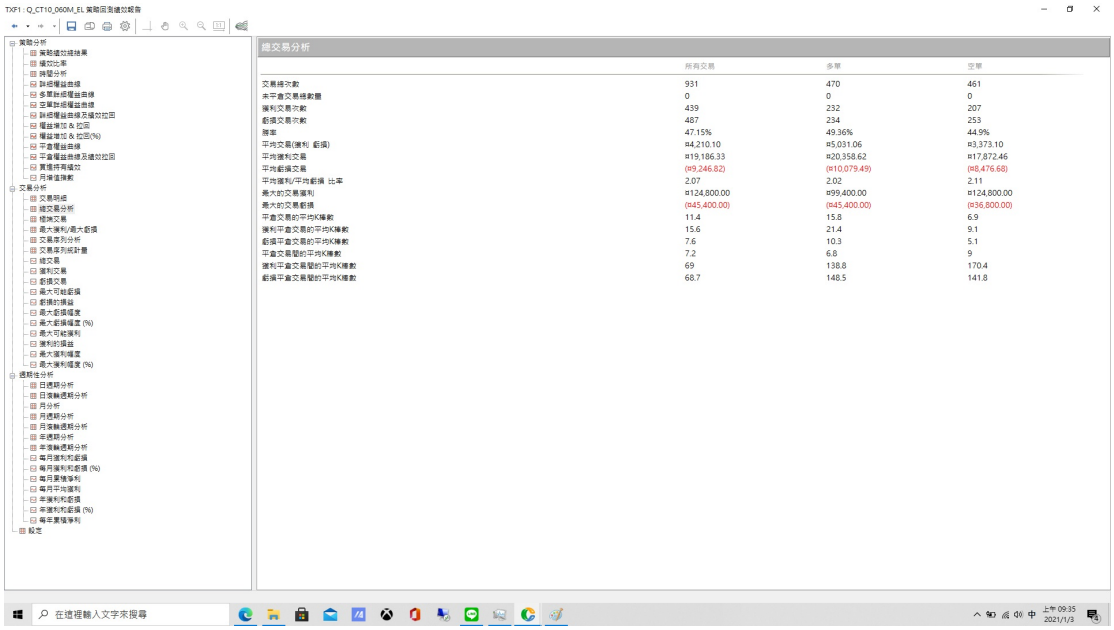
策略名稱：Q_CT10_060M_EL
圖表週期：60 分 K
策略主題：EL
最大加碼：1 口
參考副圖：無
順逆趨勢：順勢
日盤夜盤：全時段
報表區間：2001/01/01-2020/12/31
最佳優化：2010/01/01-2019/12/31
樣本以外：2020/01/01-2020/12/31



	所有交易	多單	空單
淨利	¥3,919,600.00	¥2,364,600.00	¥1,555,000.00
毛利	¥8,422,800.00	¥4,723,200.00	¥3,699,600.00
毛損	(¥4,503,200.00)	(¥2,358,600.00)	(¥2,144,600.00)
調整後淨利	¥3,313,542.22	¥1,900,320.22	¥1,163,030.18
調整後毛利	¥8,020,801.69	¥4,413,106.73	¥3,442,460.02
調整後毛損	(¥4,707,259.47)	(¥2,512,786.51)	(¥2,279,429.85)
特定淨利	¥1,770,800.00	¥1,370,000.00	¥400,800.00
特定毛利	¥5,161,000.00	¥2,865,400.00	¥2,295,600.00
特定毛損	(¥3,390,200.00)	(¥1,495,400.00)	(¥1,894,800.00)
帳戶所需金額	¥109,600.00	¥107,600.00	¥85,400.00
帳戶報酬	3576.28%	2197.58%	1820.84%
初始資本報酬	3919.6%	2364.6%	1555%
最大策略虧損	(¥129,400.00)	(¥126,400.00)	(¥132,400.00)
最大策略虧損 (%)	(44.25%)	(35.41%)	(45.48%)
最大平倉交易虧損	(¥109,600.00)	(¥107,600.00)	(¥85,400.00)
最大平倉交易虧損 (%)	(28.44%)	(26.6%)	(25.04%)
最大的策略虧損報酬	30.29	18.71	11.74
獲利因子	1.87	2	1.73
調整獲利因子	1.7	1.76	1.51
特定獲利因子	1.52	1.92	1.21
最大持有契約數量	1	1	1
清倉支付	¥0.00	¥0.00	¥0.00
保証金付	¥931,000.00	¥470,000.00	¥461,000.00
未平倉部位損益	n/a	n/a	n/a
年報酬率	200.21%	120.78%	79.43%
月報酬率	16.68%	10.06%	6.62%
實值持有績效	¥183,691.24	¥183,691.24	¥184,903.83
平均月報酬	¥16,679.15		
月報酬的標準差	¥35,622.11		
交易總次數	931	470	461
勝率	47.15%	49.36%	44.9%



[策略罐頭]臺指期波段全新投組電子書課程



TXF1 : Q_CT10_060M_EL 策略回測績效報告

策略分析
- 策略績效總結果
- 績效比率
- 時間分析
- 詳細權益曲線
- 年單詳細權益曲線
- 逐筆詳細權益曲線
- 詳細權益曲線及績效拉回
- 權益增加 & 拉回
- 權益增加 & 拉回(%)
- 平倉權益曲線
- 平倉權益曲線及績效拉回
- 實獲所需績效
- 月獲值勝數

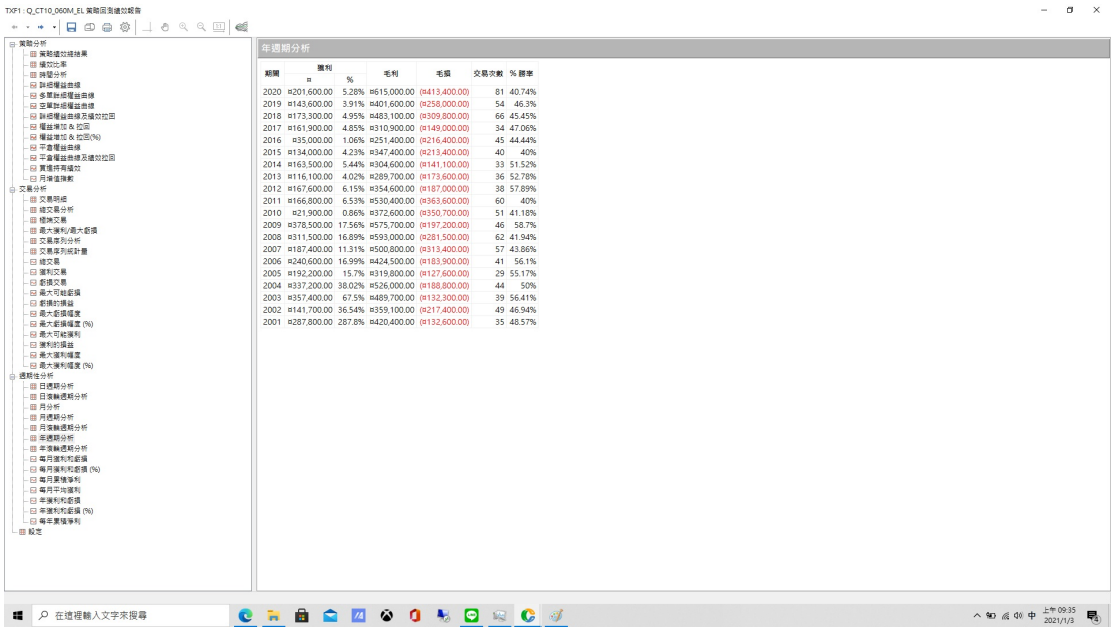
交易分析
- 交易明細
- 總交易分析
- 標準交易
- 最大獲利/最大虧損
- 交易序列分析
- 交易序列統計量
- 總交易
- 獲利交易
- 虧損交易
- 最大可能虧損
- 虧損淨損益
- 最大虧損幅度
- 最大虧損幅度 (%)
- 最大可能獲利
- 獲利淨損益
- 最大獲利幅度
- 最大獲利幅度 (%)

週期性分析
- 日週期分析
- 日滾動週期分析
- 月分析
- 月週期分析
- 月滾動週期分析
- 年週期分析
- 年滾動週期分析
- 每月獲利和虧損
- 每月獲利和虧損 (%)
- 每月實獲淨利
- 每月平均獲利
- 年獲利和虧損
- 年獲利和虧損 (%)
- 每年實獲淨利

設定

總交易分析

	所有交易	多單	空單
交易總次數	931	470	461
未平倉交易總數量	0	0	0
獲利交易次數	439	232	207
虧損交易次數	487	234	253
勝率	47.15%	49.36%	44.9%
平均交易(獲利 虧損)	₪4,210.10	₪5,031.06	₪3,373.10
平均獲利交易	₪19,186.33	₪20,358.62	₪17,872.46
平均虧損交易	(₪9,246.82)	(₪10,079.49)	(₪8,476.68)
平均獲利/平均虧損 比率	2.07	2.02	2.11
最大的交易獲利	₪124,800.00	₪99,400.00	₪124,800.00
最大的交易虧損	(₪45,400.00)	(₪45,400.00)	(₪36,800.00)
平倉交易的平均K棒數	11.4	15.8	6.9
獲利平倉交易的平均K棒數	15.6	21.4	9.1
虧損平倉交易的平均K棒數	7.6	10.3	5.1
平倉交易間的平均K棒數	7.2	6.8	9
獲利平倉交易間的平均K棒數	69	138.8	170.4
虧損平倉交易間的平均K棒數	68.7	148.5	141.8



TXF1 : Q_CT10_060M_EL 策略回測績效報告

策略分析
- 策略績效總結果
- 績效比率
- 時間分析
- 詳細權益曲線
- 年單詳細權益曲線
- 逐筆詳細權益曲線
- 詳細權益曲線及績效拉回
- 權益增加 & 拉回
- 權益增加 & 拉回(%)
- 平倉權益曲線
- 平倉權益曲線及績效拉回
- 實獲所需績效
- 月獲值勝數

交易分析
- 交易明細
- 總交易分析
- 標準交易
- 最大獲利/最大虧損
- 交易序列分析
- 交易序列統計量
- 總交易
- 獲利交易
- 虧損交易
- 最大可能虧損
- 虧損淨損益
- 最大虧損幅度
- 最大虧損幅度 (%)
- 最大可能獲利
- 獲利淨損益
- 最大獲利幅度
- 最大獲利幅度 (%)

週期性分析
- 日週期分析
- 日滾動週期分析
- 月分析
- 月週期分析
- 月滾動週期分析
- 年週期分析
- 年滾動週期分析
- 每月獲利和虧損
- 每月獲利和虧損 (%)
- 每月實獲淨利
- 每月平均獲利
- 年獲利和虧損
- 年獲利和虧損 (%)
- 每年實獲淨利

設定

年週期分析

期間	獲利 ₪	獲利 %	毛利	毛損	交易次數	% 勝率
2020	₪201,600.00	5.28%	₪615,000.00	(₪413,400.00)	81	40.74%
2019	₪143,600.00	3.91%	₪401,600.00	(₪258,000.00)	54	46.3%
2018	₪173,300.00	4.95%	₪483,100.00	(₪309,800.00)	66	45.45%
2017	₪161,900.00	4.85%	₪310,900.00	(₪149,000.00)	34	47.06%
2016	₪35,000.00	1.06%	₪251,400.00	(₪216,400.00)	45	44.44%
2015	₪134,000.00	4.23%	₪347,400.00	(₪213,400.00)	40	40%
2014	₪163,500.00	5.44%	₪304,600.00	(₪141,100.00)	33	51.52%
2013	₪116,100.00	4.02%	₪289,700.00	(₪173,600.00)	36	52.78%
2012	₪167,600.00	6.15%	₪354,600.00	(₪187,000.00)	38	57.89%
2011	₪166,800.00	6.53%	₪530,400.00	(₪363,600.00)	60	40%
2010	₪21,900.00	0.86%	₪372,600.00	(₪350,700.00)	51	41.18%
2009	₪378,500.00	17.56%	₪575,700.00	(₪197,200.00)	46	58.7%
2008	₪311,500.00	16.89%	₪593,000.00	(₪281,500.00)	62	41.94%
2007	₪187,400.00	11.31%	₪500,800.00	(₪313,400.00)	57	43.86%
2006	₪240,600.00	16.99%	₪424,500.00	(₪183,900.00)	41	56.1%
2005	₪192,200.00	15.7%	₪319,800.00	(₪127,600.00)	29	55.17%
2004	₪337,200.00	38.02%	₪526,000.00	(₪188,800.00)	44	50%
2003	₪357,400.00	67.5%	₪489,700.00	(₪132,300.00)	39	56.41%
2002	₪141,700.00	36.54%	₪359,100.00	(₪217,400.00)	49	46.94%
2001	₪287,800.00	287.8%	₪420,400.00	(₪132,600.00)	35	48.57%