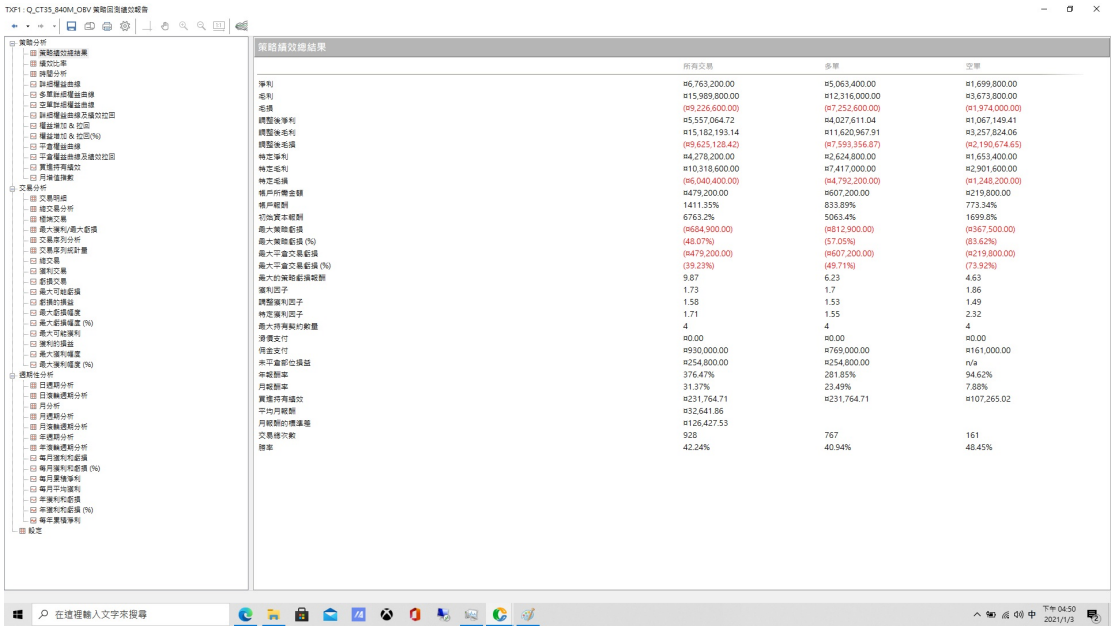
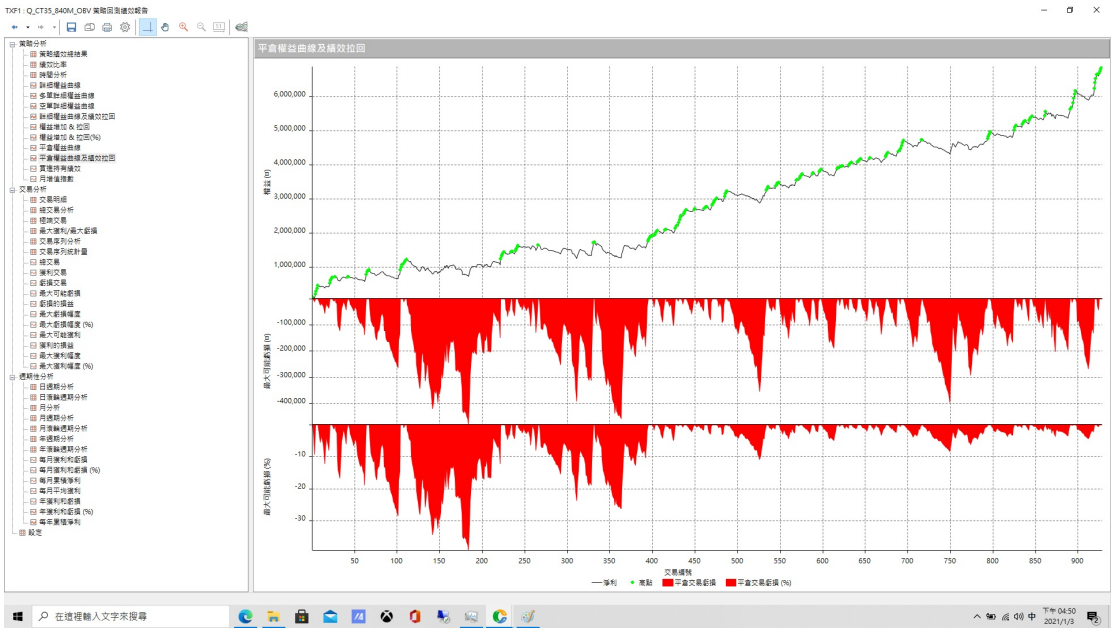
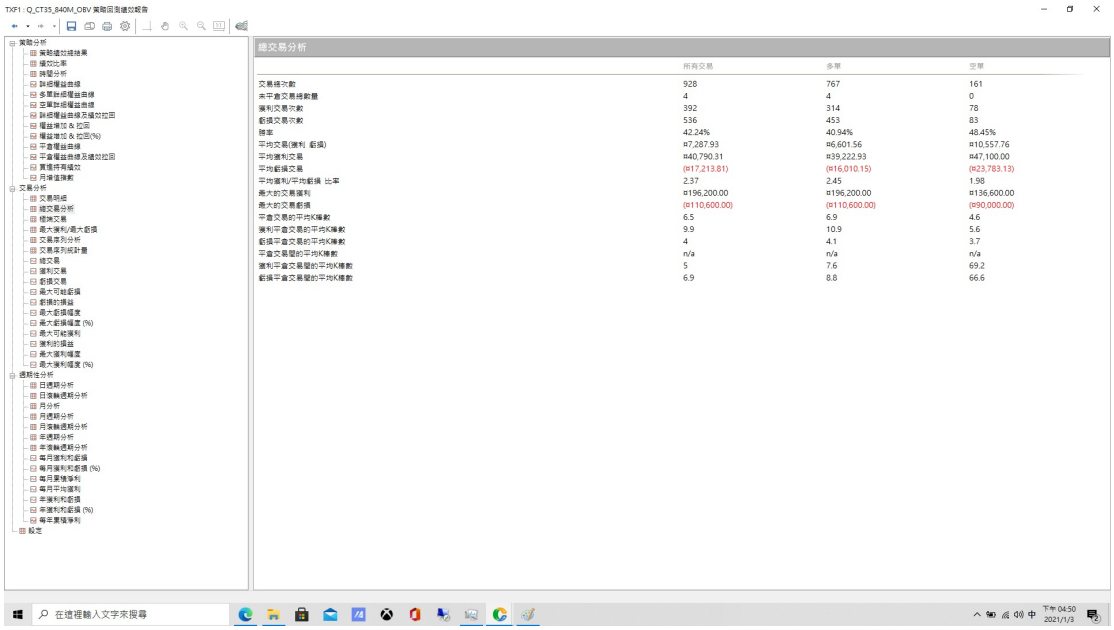
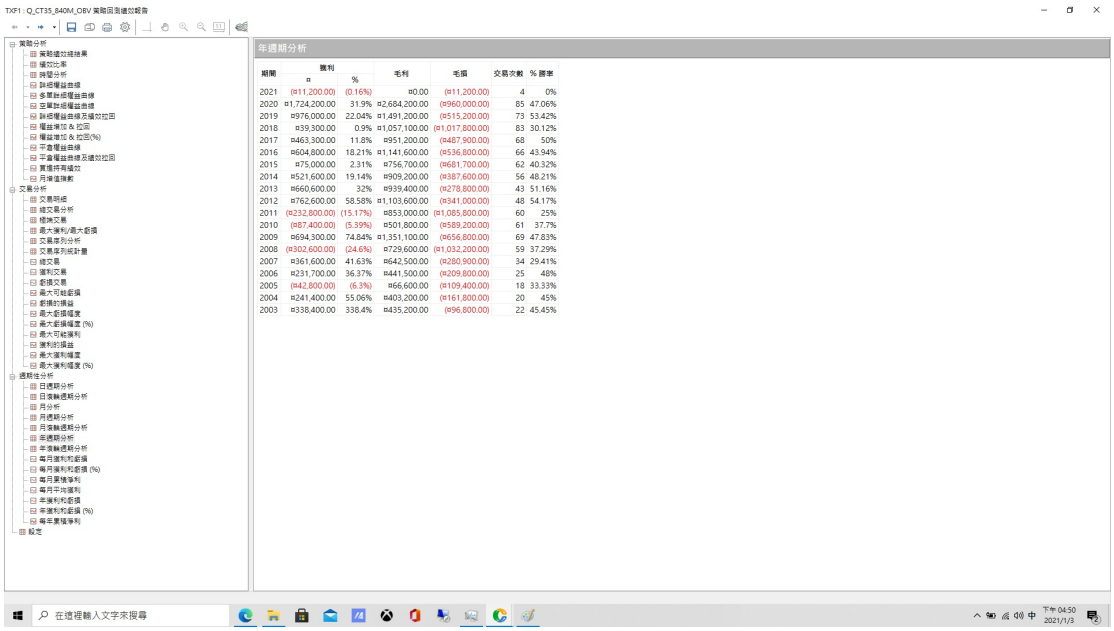
[策略罐頭]臺指期波段全新投組電子書課程

策略名稱：Q_CT35_840M_OBV
圖表週期：840 分 K
策略主題：OBV
最大加碼：4 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	¥6,763,200.00	¥5,063,400.00	¥1,699,800.00
毛利	¥15,989,800.00	¥12,316,000.00	¥3,673,800.00
毛損	(¥9,226,600.00)	(¥7,252,600.00)	(¥1,974,000.00)
調整後淨利	¥5,557,064.72	¥4,027,611.04	¥1,067,149.41
調整後毛利	¥15,182,193.14	¥11,620,967.91	¥3,257,824.06
調整後毛損	(¥9,625,128.42)	(¥7,593,356.87)	(¥2,190,674.65)
特定淨利	¥4,278,200.00	¥2,624,800.00	¥1,653,400.00
特定毛利	¥10,318,600.00	¥7,417,000.00	¥2,901,600.00
特定毛損	(¥6,040,400.00)	(¥4,792,200.00)	(¥1,248,200.00)
帳戶所需金額	¥479,200.00	¥607,200.00	¥219,800.00
帳戶報酬	1411.35%	833.89%	773.34%
初始資本報酬	6763.2%	5063.4%	1699.8%
最大策略虧損	(¥684,900.00)	(¥812,900.00)	(¥367,500.00)
最大策略虧損 (%)	(48.07%)	(57.05%)	(83.62%)
最大平倉交易虧損	(¥479,200.00)	(¥607,200.00)	(¥219,800.00)
最大平倉交易虧損 (%)	(39.23%)	(49.71%)	(73.92%)
最大的策略虧損報酬	9.87	6.23	4.63
獲利因子	1.73	1.7	1.86
調整獲利因子	1.58	1.53	1.49
特定獲利因子	1.71	1.55	2.32
最大持有契約數量	4	4	4
滑價支付	¥0.00	¥0.00	¥0.00
佣金支付	¥930,000.00	¥769,000.00	¥161,000.00
未平倉部位損益	¥254,800.00	¥254,800.00	n/a
年報酬率	376.47%	281.85%	94.62%
月報酬率	31.37%	23.49%	7.88%
實現持有績效	¥231,764.71	¥231,764.71	¥107,265.02
平均月報酬	¥32,641.86		
月報酬的標準差	¥126,427.53		
交易總次數	928	767	161
勝率	42.24%	40.94%	48.45%



[策略罐頭]臺指期波段全新投組電子書課程