康和期貨
Concord Futures

五大行星
策略自由配

康和期貨 Concord Futures Corp.

Venus金星組合

季繳：優惠價$35,000元

Venus 策略說明

代碼 : CF_101 , CF_105 , CF_109

說明 : RSI檢測趨勢　凱特通道捕捉小波段行情　MACD捕捉波段轉折適用波段操作　策略有互補作用

屬性: 短線積極型 30分趨勢與小波段 60分波段轉折　最大口數3口/不加碼

單支最大策略虧損: CF_101 -264,600　CF_105 -249,600　CF_109 -239,000

投資組合最大虧損: -455,400　投組虧損僅供參考,實務以單支加總為準

投資組合績效累計(元) : $11,017,200

停損停利 : 採取多空分離, 依照行情以固定停損停利,移動停利等方式出場, 結算日自動轉倉

注意事項：建議同時三隻策略啟用，以控制最大策略風險

	策略代碼	屬性	多空	建議口數
Venus	CF_101	趨勢	雙向	1
金星	CF_105	波段轉折	雙向	1
	CF_109	小波段	雙向	1

商品 :台指策略組合單向最大口數 3 口
統計時間 : 2017/1/1至2023/5/31
交易成本：每口進出共 4 Tick約 NT$ 1600元
建議本金 :$2,470,000
組合最大連續虧損 : -455,400　僅供參考 以單支加總為準

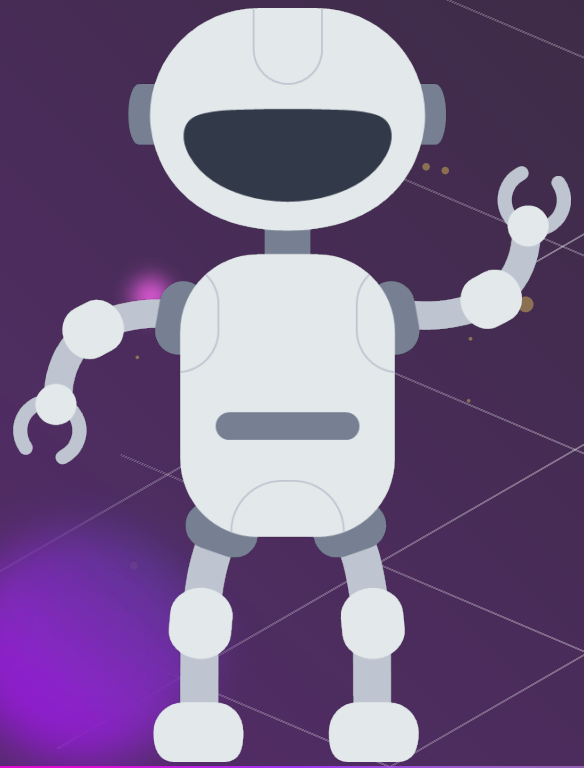
年份	一月	二月	三月	四月	五月	六月	七月	八月	九月	十月	十一月	十二月	全年
2017			-11800	-18200	25600	111200	27600	94400	49200	-17400	53800	195000	509400
2018	82400	507000	128200	18200	119600	127000	-184600	143600	-44000	388800	112600	102800	1501600
2019	161600	10400	113600	-7600	76000	-14800	64800	215400	138600	120600	55200	73800	1007600
2020	278800	195800	790400	194600	-195200	44400	73800	269800	214800	-96200	63200	53000	1887200
2021	304000	110200	274800	80000	941200	155600	113000	550000	-12400	105800	14000	153400	2789600
2022	135600	254600	58400	283800	184400	271200	186800	238600	392600	136000	331400	279000	2752400
2023	158800	212400	-138800	141400	229000								602800

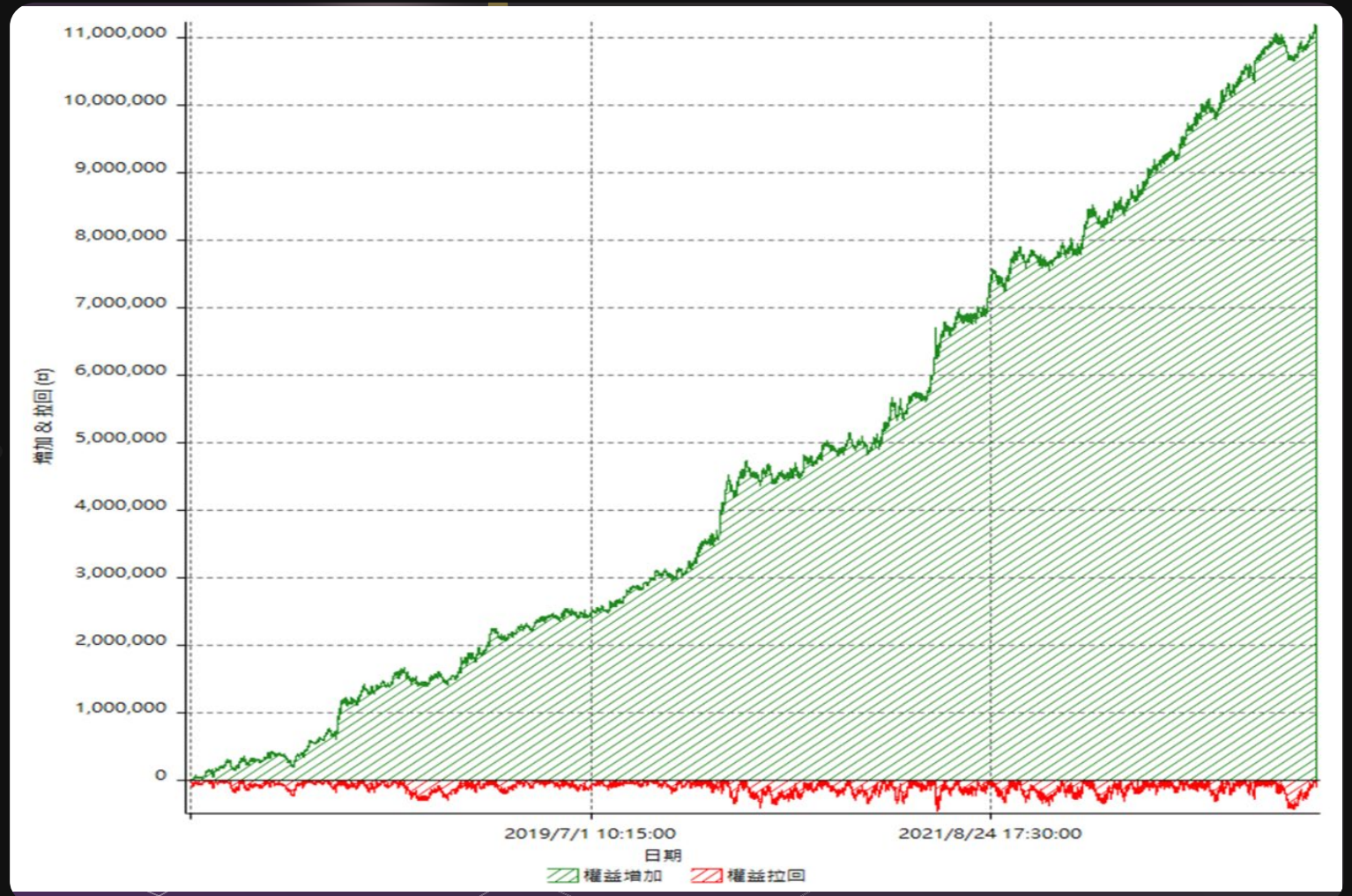
Venus

總交易分析			
	所有交易	多單	空單
交易總次數	5062	2484	2578
未平倉交易總數量	2	0	2
獲利交易次數	1977	1061	916
虧損交易次數	3050	1401	1649
勝率	39.06	42.71	35.53
平均交易(獲利 & 虧損)	2176	2681	1690
平均獲利交易	21084	19480	22941
平均虧損交易	(10054)	(10000)	(10101)
平均獲利/平均虧損 比率	2.10	1.95	2.27

投組 Annual 週期分析					
期間	淨利	獲利百分比	獲利因子	交易次數	勝率
2023	602,800	4.66	1.28	321	36.76
2022	2,752,400	27.00	1.40	927	38.83
2021	2,789,600	37.67	1.41	962	39.81
2020	1,887,200	34.20	1.31	873	39.06
2019	1,007,600	22.34	1.34	716	39.66
2018	1,501,600	49.90	1.37	783	39.85
2017	509,400	20.38	1.28	498	38.15

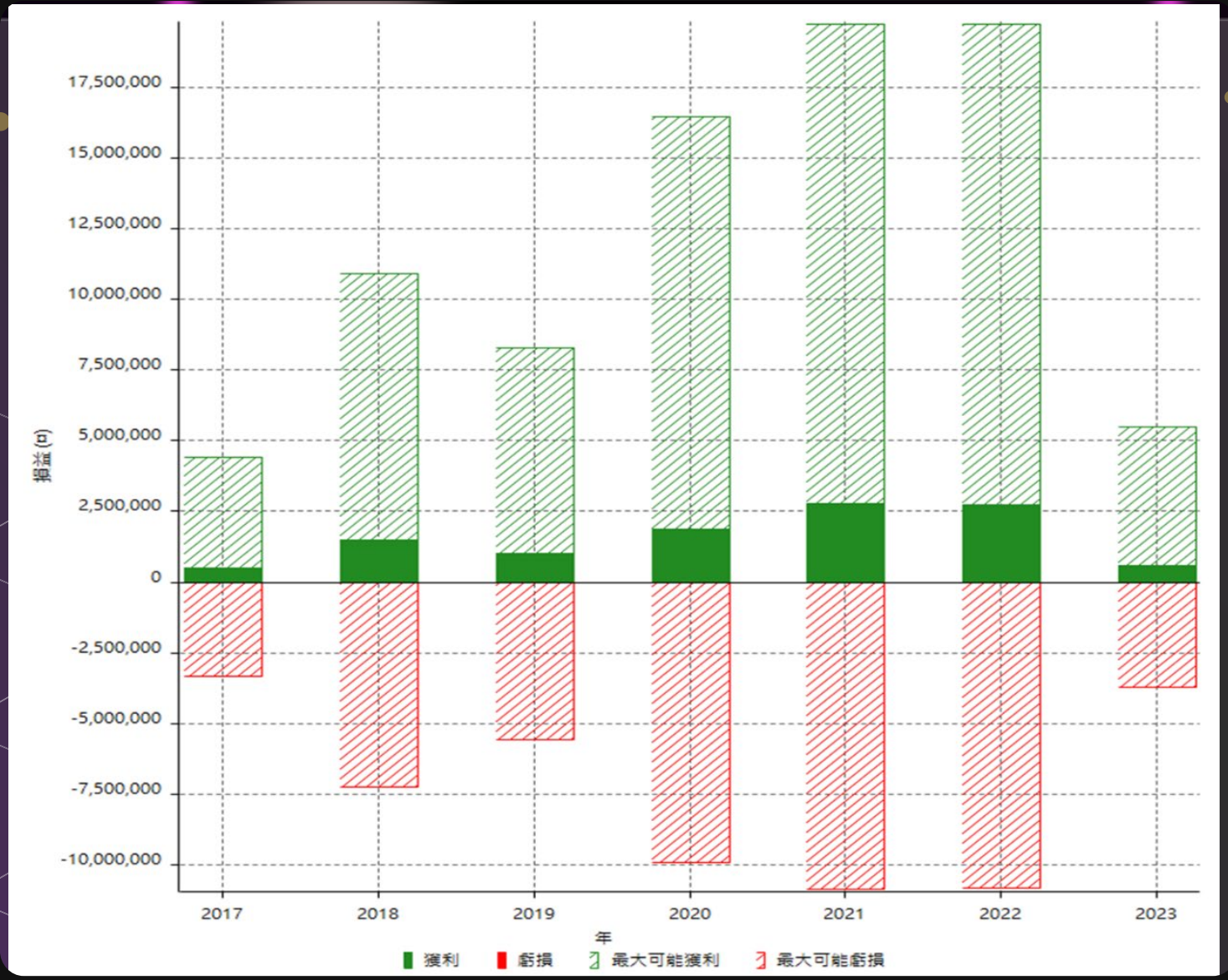
權益增加 & 拉回




11,000,000
10,000,000
9,000,000
8,000,000
7,000,000
6,000,000
5,000,000
4,000,000
3,000,000
2,000,000
1,000,000
0
增加 & 拉回 (n)
2019/7/1 10:15:00
2021/8/24 17:30:00
日期
權益增加
權益拉回

Venus

年獲利和虧損



Venus

CF_101 模擬真實績效

策略說明

商品：大台指(全日盤) 2017/1 /1 - 2023/5/31

說明：此策略運用隨機RSI, 及平均隨機RSI檢測趨勢, 計算出的指標值判斷趨勢

屬性：30分線 波段雙向 , 最大口數1 口 不加碼

停損停利：採取多空分離, 依照行情以固定停損停利,移動停利等方式出場, 結算日自動轉倉

建議使用1口以控制風險

交易成本：每口進出共4 Tick約NT$800元

優勢 :不易錯過行情報酬較大 缺點：週轉率較高

建議本金：$860,000 最大策略虧損：1口:264,600 1口淨利: 4,712,200

Venus

	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Total
2017			-11800	-18200	-3000	116200	8200	17000	12400	-49000	26400	53600	151800
2018	53000	231800	2000	-30800	67600	53200	-109200	111200	-67400	165200	120800	71000	668400
2019	7800	-21600	40600	-22400	54400	14200	66400	-3200	59400	74000	18000	56000	343600
2020	201800	205200	438200	77400	-90200	37400	19000	68200	106200	-63200	21200	-1000	1020200
2021	155200	254000	198200	65600	114200	36800	12600	285800	39600	12800	-11000	33800	1197600
2022	46200	-11600	76800	142400	136600	28400	-49400	150200	235600	115600	206000	41000	1117800
2023	1800	137000	-86200	50600	122800								226000

投組 Annual 週期分析

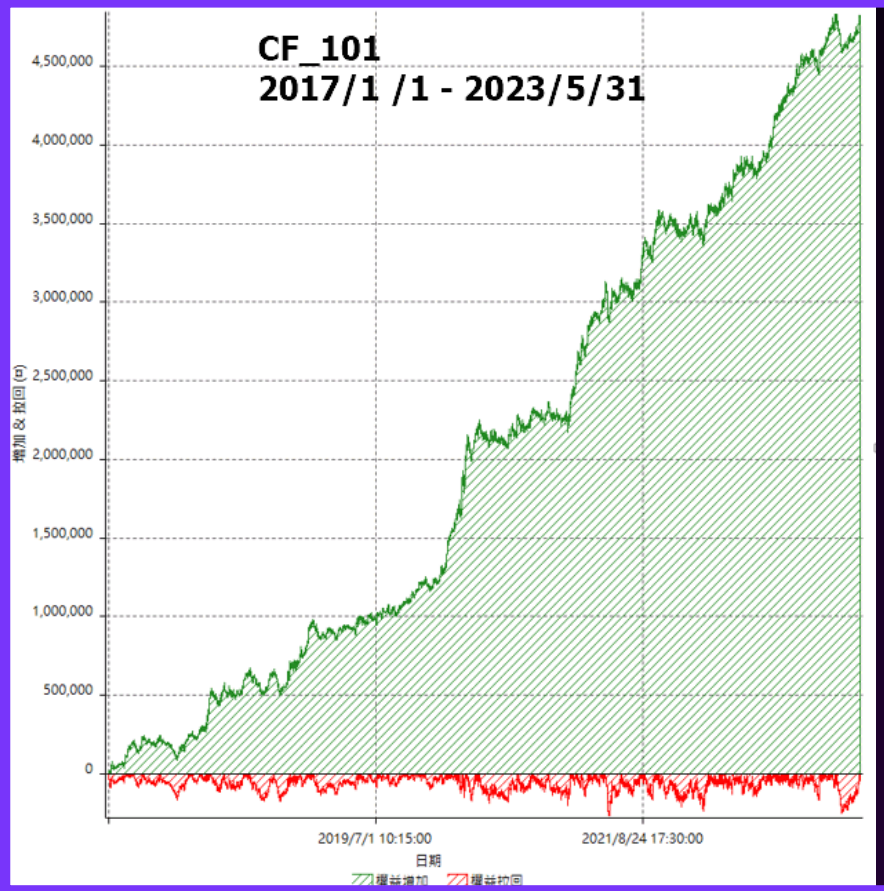
期間	淨利	獲利(%)	毛利	毛損	交易次數	勝率
2023	226,000	4.52	1194400	-968400	162	35.80
2022	1,117,800	28.80	4029400	-2911600	421	36.34
2021	1,197,600	44.62	4133800	-2936200	457	36.98
2020	1,020,200	61.32	3603200	-2583000	394	37.82
2019	343,600	26.03	1600600	-1257000	328	40.85
2018	668,400	102.55	2325800	-1657400	367	38.42
2017	151,800	30.36	1065000	-913200	271	34.69

總交易分析

	所有交易	多單	空單
交易總次數	2394	1129	1265
未平倉交易總數量	1	0	1
獲利交易次數	895	476	419
虧損交易次數	1484	643	841
勝率	37.39	42.16	33.12
平均交易(獲利 & 虧損)	1968.34	2533.22	1464.19
平均獲利交易	20034.64	18638.66	21620.53
平均虧損交易	-8907.55	-9349.92	-8569.32
平均獲利/平均虧損 比率	2.25	1.99	2.52

Venus

權益增加 & 拉回



使用指標範例

Venus

CF_105 模擬真實績效

策略說明

商品：大台指(全日盤) 2017/1 /1 - 2023/5/31

說明：台指波段，凱特通道策略加上CCI作進出場研判

屬性：30分線 波段雙向 最大口數1 口 不加碼

停損停利：採取多空分離, 用移動停利或轉折等方式出場, 結算日自動轉倉 建議使用1口以控制風險

交易成本：每口進出共4 Tick約NT$800元

優勢：順市交易賺大賠小 缺點：小區間時較易虧損

建議本金：$810,000 最大策略虧損：1口:249,600 1口淨利: 2,937,800

Venus

	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Total
2017						-54400	-22800	9400	15000	89000	1200	11800	49200
2018	69000	192200	13200	52400	-55400	121000	-46400	-71200	48200	175400	-57200	32200	473400
2019	-13800	58000	6400	43600	-22600	-77400	-1200	93800	51600	42200	12200	56400	249200
2020	-16800	-14800	171000	-4000	-97600	-54800	53400	156200	7000	11600	9600	17200	238000
2021	87000	-56000	-21200	-15000	482800	75200	-66000	269000	-4400	55400	96400	72000	975200
2022	7800	170600	33200	83000	48400	124800	101000	-34800	65600	48600	76000	-53400	670800
2023	92600	-31000	15400	82600	122400								282000

投組 Annual 週期分析

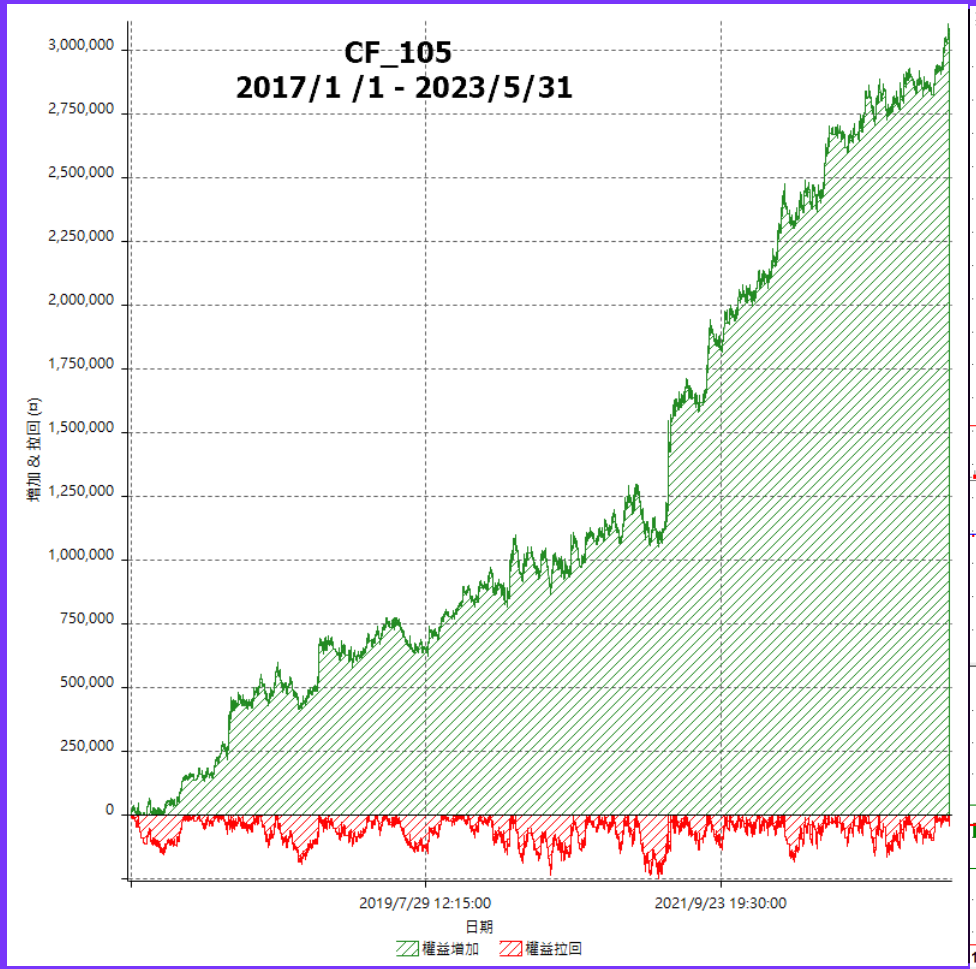
期間	淨利	獲利 (%)	毛利	毛損	交易次數	勝率
2023	282,000	8.94	582200	-300200	34	47.06
2022	670,800	26.99	1887200	-1216400	143	44.76
2021	975,200	64.59	2249200	-1274000	161	51.55
2020	238,000	18.71	1490600	-1252600	132	41.67
2019	249,200	24.37	621600	-372400	46	36.96
2018	473,400	86.20	1092800	-619400	80	48.75
2017	49,200	9.84	265200	-216000	24	41.67

總交易分析

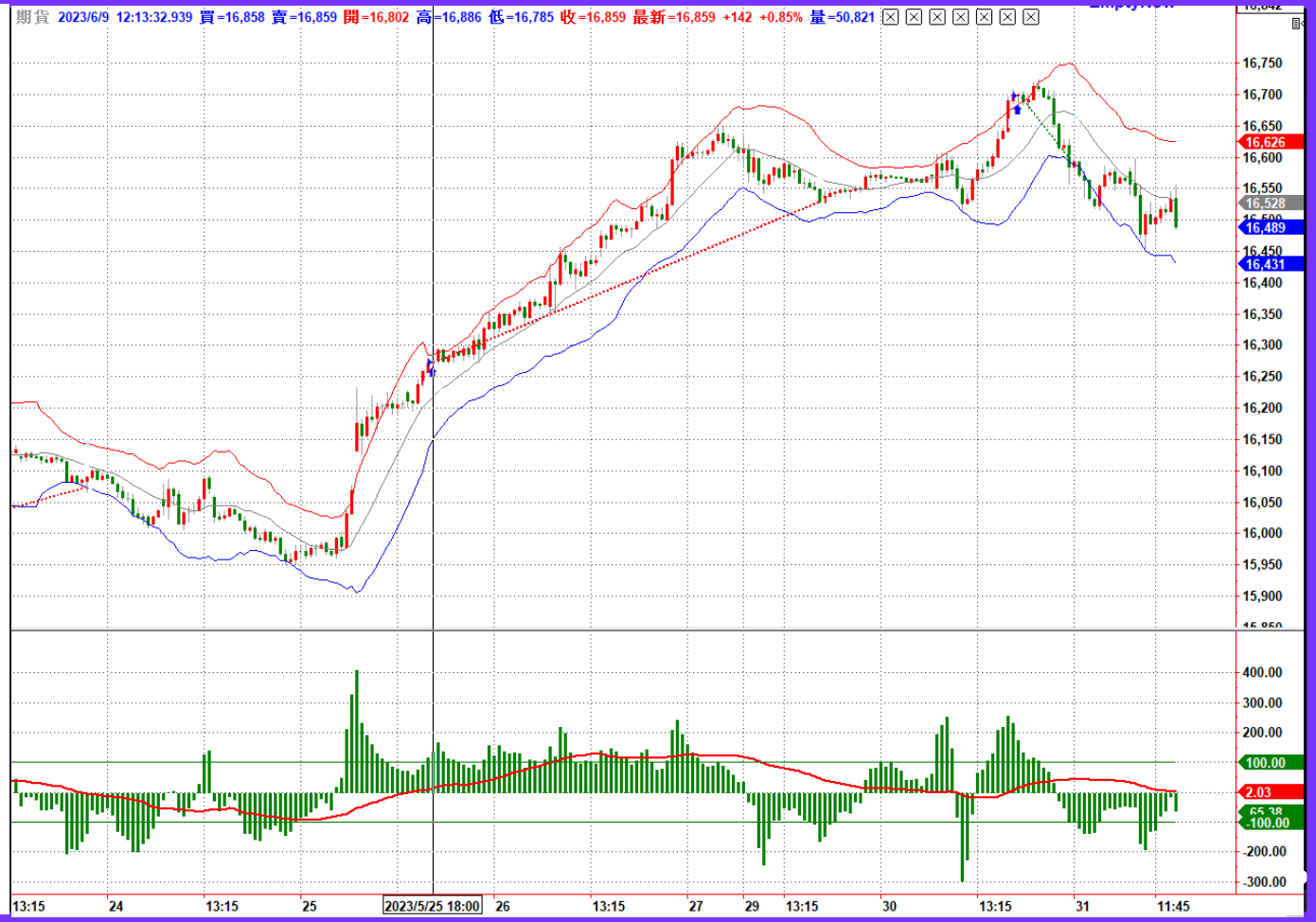
	所有交易	多單	空單
交易總次數	615	329	286
未平倉交易總數量	0	0	0
獲利交易次數	281	163	118
虧損交易次數	332	166	166
勝率	45.69	49.54	41.26
平均交易(獲利 & 虧損)	4776.91	6392.10	2918.88
平均獲利交易	29113.88	27819.63	30901.69
平均虧損交易	-15792.77	-14648.19	-16937.35
平均獲利/平均虧損 比率	1.84	1.90	1.82

Venus

權益增加 & 拉回



使用指標範例



Venus

CF_109 模擬真實績效

策略說明

商品：大台指(全日盤) 2017/1 /1 - 2023/5/31

說明 : 台指波段，運用MACD交叉作進出場的判斷, 符合條件即進場交易

屬性：60分線 波段多空分離 , 最大口數1 口, 不加碼

停損停利: 採取多空分離,依照行情以固定停損停利,移動停利等方式出場, 結算日自動轉倉 建議最多使用1口以控制風險

交易成本：每口進出共4 Tick約NT$800元

優勢: 多空雙向交易比率平均 缺點: 交易次數較多,盤整時較易虧損

建議本金: $800,000 最大策略虧損：1口:239,000 淨利:3,341,400

Venus

	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	Total
2017					28600	49400	42200	68000	21800	-57400	26200	129600	308400
2018	-39600	83000	113000	-3400	107400	-47200	-29000	103600	-24800	48200	49000	-400	359800
2019	167600	-26000	66600	-28800	44200	48400	-400	124800	27600	4400	25000	-38600	414800
2020	93800	5400	181200	121200	-7400	61800	1400	45400	97600	-44600	27400	31800	615000
2021	58000	-89000	97600	32000	345600	43600	166400	-5200	-47600	37600	-71400	45200	612800
2022	83400	94000	-51200	54000	-600	118000	135200	123200	91400	-28200	49400	291400	960000
2023	64400	106400	-68000	8200	-20200								90800

投組 Annual 週期分析

期間	淨利	獲利(%)	毛利	毛損	交易次數	勝率
2023	90,800	2.41	944400	-853600	125	35.20
2022	960,000	34.15	3795200	-2835200	364	39.29
2021	612,800	27.88	3137600	-2524800	344	37.79
2020	615,000	38.85	2925200	-2310200	347	39.48
2019	414,800	35.51	1723400	-1308600	342	38.89
2018	359,800	44.51	2102600	-1742800	336	39.29
2017	308,400	61.68	974600	-666200	203	42.36

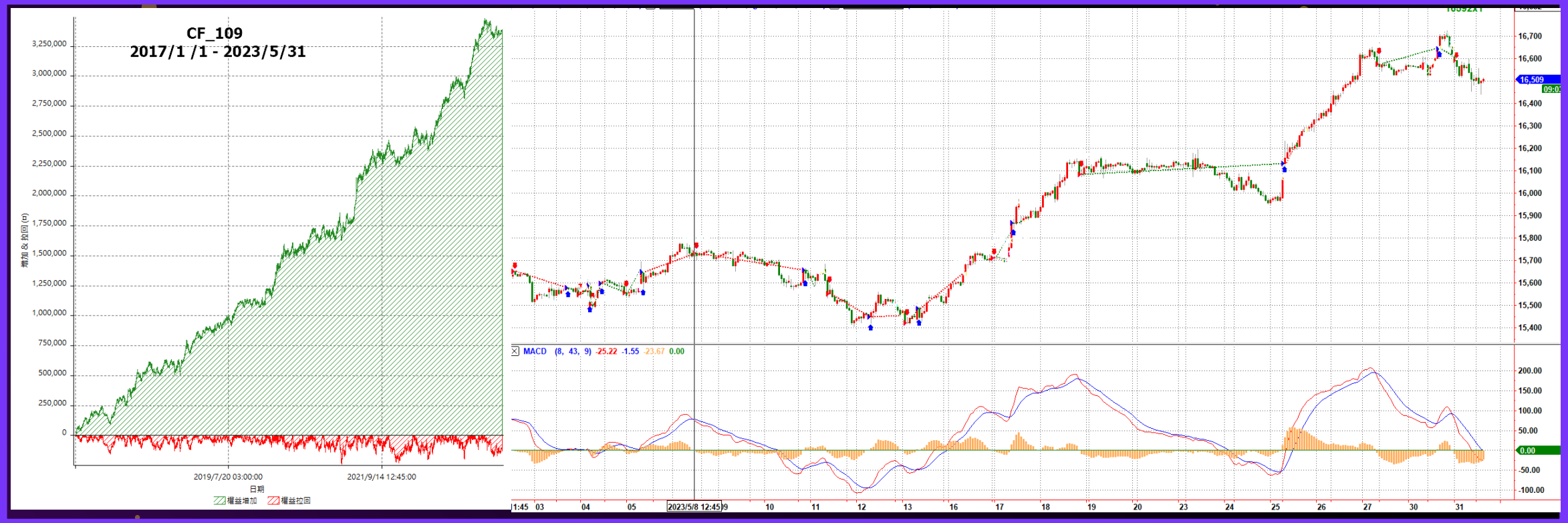
總交易分析

	所有交易	多單	空單
交易總次數	2054	1027	1027
未平倉交易總數量	1	0	1
獲利交易次數	800	421	379
虧損交易次數	1236	594	642
勝率	38.95	40.99	36.90
平均交易(獲利 & 虧損)	1628.72	1628.24	1629.21
平均獲利交易	19458.25	17220.43	21944.06
平均虧損交易	-9887.70	-9389.90	-10348.29
平均獲利/平均虧損 比率	1.97	1.83	2.12

Venus

權益增加 & 拉回

使用指標範例



Venus

請洽所屬營業員

功能限制&警語：

1.任何系統參數須由交易人員自行設定：過去績效不代表未來獲利，交易人要依據本身狀況審慎評估。

2.相關圖表及數據均以歷史數據繪製及統計，不具預測未來之能力。

3.期權交易財務槓桿高，交易人請慎重考量自身財務能力，可能產生極大利潤，也可能極大損失，交易人於開戶前應審慎考慮本身的財務能力及經濟狀況，審慎評估並自負投資風險。

105 台北市復興北路143號6樓　電話 02-2717-1339　期貨商許可證照字號：111年金管期總字第006號