

Starwin策略分類說明

- ◆ 策略分類概念介紹
- ◆ Starwin策略分類結果
- ◆ 策略分類用途
- ◆ Starwin平台呈現方式



富邦期顧Starwin - 策略分類概念介紹



- ◆ 台指期自2017年下半年開放夜盤交易，在指數逼近全天交易情況下，過去使用當沖/留倉進行策略分類方式已較難區分策略特性；同時，單純從策略使用指標及說明，較難區分此策略獲利來源為做多或做空交易，因此期顧在策略分類上進行優化。
- ◆ 策略分類以多/空/均衡，和持倉時間做主要分類，同時透過其他指標描述策略特性，概念如下：

	多方優勢 (做多次數比重70%以上)	多空均衡 (做多次數比重30~70%)	空方優勢 (做多次數比重30%以下)
持倉時間*中長 (持倉時間>40%) (核心策略)	多方-核心策略 Ex:交易頻率低、勝率中等->策略訊號變化慢(不敏感)、以長波段為主 (部分MH系列)	均衡-核心策略 Ex:交易頻率高、持倉時間高、勝率中等->類似翻單策略、訊號反應較為敏感、中短波段操作為主 (HW奇策205)	空方-核心策略 從缺
持倉時間低 (持倉時間<40%) (輔助策略)	多方-輔助策略 Ex:勝率較低、賺賠比高->機會型策略，以追求較高賺賠比獲利 (FJ奧本海默3號)	均衡-輔助策略 Ex:勝率較高、交易頻率高->打游擊策略，尋找具有統計優勢交易機會 (HW奇策103)	空方-輔助策略 Ex:拚高勝率、交易頻率極低->尋找短線做空機會，輔助為主 (MH台指Y04)

持倉時間：所有策略運行時間中，有部位在市場上的時間比例，越高通常代表該策略多數時間在市場上交易，越低則代表策略多數在場外觀望。

富邦期顧Starwin - 策略分類結果



持倉時間中長
(持倉時間>40%)
(核心策略)

持倉時間低
(持倉時間<40%)
(輔助策略)

多方優勢

(做多次數比重70%以上)

MH台指A03
MH台指D06
CT_火星
CT_金星
TS探吉03
MH台指E02
MH台指D02
TS探吉02
TS輝達5號
IFN小飛俠

JJE乘風台指10
MH台指E04
LF盧卡之星01
TS輝達3號
MH台指F06
TS輝達1號
風華FTB Band
FJ神穩

多空均衡

(做多次數比重30~70%)

GT耀眼2號
HW奇策537
HW奇策522
MH妙算TX10
HW奇策526
HW奇策225
TS撿賺石01
FJ奧本海默62號
AT悍將01

FJ奧本海默6號
FJ封神
FJ神選
HW奇策102
GT耀眼43號
FJ奧本海默3號
GT耀眼59號

MH奇謀06
HW奇策103
GT耀眼54號
FJ神盈
WL奇樂55
KV奇樂05
GT耀眼51號
CT_水星
GT耀眼55號

空方優勢

(做多次數比重30%以下)

HW奇策506
FJ神擊
JF咖啡焦糖
HW奇策525
MH台指C04
TS吉星1號
HW奇策536
HW奇策205
HW奇策526
TS金讚01

MH台指A02
MH台指G03
AT悍將02
AT悍將03
AT悍將04

無

MH台指F04
MH台指Y04
MH台指A06
FJ迅雷31號

富邦期顧Starwin - 策略分類用途說明1



- ◆ 透過策略分類以及分析目前盤勢狀況，來因應現況挑選適合的策略。
- ◆ 情境範例說明：
 - 情境：指數處於低檔，多空仍不明朗，但低檔有限，未來有機會有波段走勢：
 - ✓ 配置較高的多方-核心策略(1)，並搭配部分均衡型(2)策略，多策略投資人可搭配少量(4)或(5)型策略來穩定損益曲線
 - 未來將推出各情境進行分析以及策略種類範本

	多方優勢 (做多次數比重70%以上)	多空均衡 (做多次數比重30~70%)	空方優勢 (做多次數比重30%以下)
持倉時間中長 (核心策略)	<u>多方-核心策略</u> 1	<u>均衡-核心策略</u> 2	<u>空方-核心策略</u> 3
持倉時間短 (輔助策略)	<u>多方-輔助策略</u> 4	<u>均衡-輔助策略</u> 5	<u>空方-輔助策略</u> 6

富邦期顧Starwin - 策略分類用途說明2



- ◆ 若對目前盤勢無特殊想法，主要希望組成較平穩權益曲線的策略投組，也可透過布局不同分類的策略來找出不同特性的策略。
- ◆ 範例說明：
 - 希望挑選3檔策略，希望掌握波段走勢，可接受較大MDD：
 - ✓ 1 x 均衡-核心策略(2)、1 x 多方-核心策略(1)、1 x 均衡-輔助策略(5)
 - 希望挑選3檔策略，希望可以獲利穩定小MDD，不追求大波段走勢：
 - ✓ 1 x 均衡-核心策略(2)、1 x 均衡-輔助策略(5)、1 x 多方-輔助策略(4)

	多方優勢 (做多次數比重70%以上)	多空均衡 (做多次數比重30~70%)	空方優勢 (做多次數比重30%以下)
持倉時間中長 (核心策略)	<u>多方-核心策略</u> 1	<u>均衡-核心策略</u> 2	<u>空方-核心策略</u> 3
持倉時間短 (輔助策略)	<u>多方-輔助策略</u> 4	<u>均衡-輔助策略</u> 5	<u>空方-輔助策略</u> 6

- ◆ 目前策略分類以內期為主，近期將陸續分類海期策略，手機及網站皆可透過滑動來找尋六大分類。



- ◆ 進入個別策略說明中，將有對策略特性更詳細的描述及說明。

| 策略說明

說明：以長短雙均線搭配價格濾網交叉時伺機進場，多空對翻

屬性：波段/雙向/不加碼

風險：請參考MDD數值

停損：以ATR計算停損停利位置，並納入賺賠比作為出場考量

特性：多空均衡-核心策略，以中期波段操作為主，做多獲利佔整體比重較高，策略勝率持平。



Thank You

