

黃梅雨季 勝算樹商品公開說明書

2014年2月17日

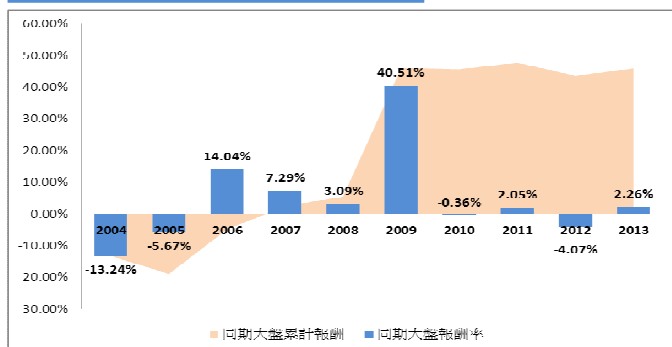
產品特色

- (1) 挑選績優股：回溯 ETF50、ETF51 過去 10 年來勝率為 100% 的交易策略。
- (2) 特定的節氣效應：以清明節為主軸，尋找節氣期間股票獲利的交易機會。
- (3) 採多變量最佳化：考量報酬、風險、持倉時間等多因子，進行投資組合最佳化。

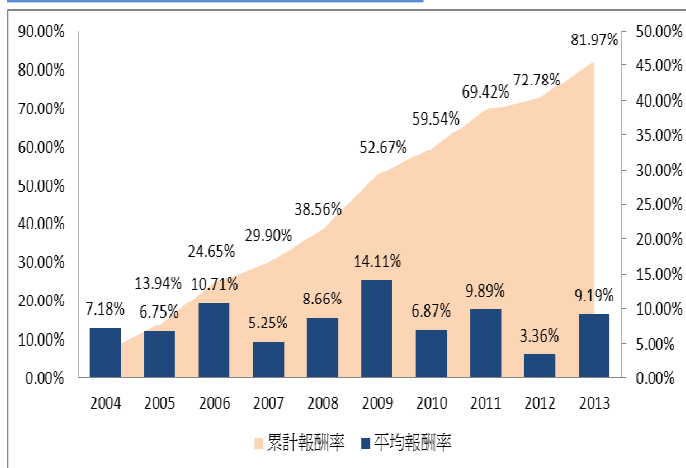
基本資料

| | |
|------------|---|
| 商品設計 | 國泰證期金融學苑 |
| 投資目標 | 以 ETF50、ETF51 為標的，尋找清明節氣前後的交易機會，並藉多因子考量，組合成追求節氣期間最佳的投資組合。 |
| 操作期間 | 2014/03/01-2014/06/31 |
| 每單位使用資金 | 135 萬元 (新台幣) |
| 股票交易稅 | 3‰ (千分之 3) |
| 股票手續費 (單邊) | 1.425‰ (千分之 1.425) |

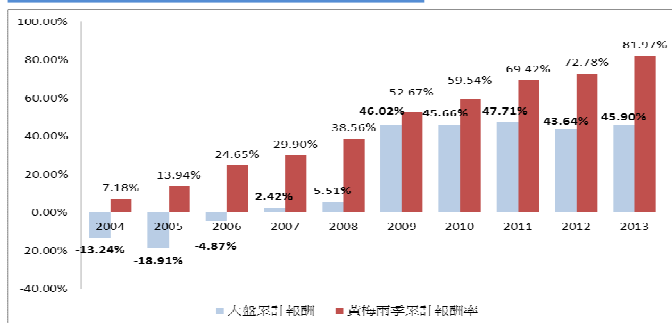
同期大盤表現(%)



年度與累積表現(%)



相對報酬(%)



| 西元年 | 2004 | 2005 | 2006 | 2007 | 2008 |
|-------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 年報酬率 | 7.18% | 6.75% | 10.71% | 5.25% | 8.66% |
| 累積報酬率 | 7.18% | 13.94% | 24.65% | 29.90% | 38.56% |
| 西元年 | 2009 | 2010 | 2011 | 2012 | 2013 |
| 年報酬率 | 14.11% | 6.87% | 9.89% | 3.36% | 9.19% |
| 累積報酬率 | 52.67% | 59.54% | 69.42% | 72.78% | 81.97% |

| 西元年 | 2004 | 2005 | 2006 | 2007 | 2008 |
|-----------|---------|---------|--------|--------|--------|
| 大盤累積報酬率 | -13.24% | -18.91% | -4.87% | 2.42% | 5.51% |
| 黃梅雨季累積報酬率 | 7.18% | 13.94% | 24.65% | 29.90% | 38.56% |
| 西元年 | 2009 | 2010 | 2011 | 2012 | 2013 |
| 大盤累積報酬率 | 46.02% | 45.66% | 47.71% | 43.64% | 45.90% |
| 黃梅雨季累積報酬率 | 52.67% | 59.54% | 69.42% | 72.78% | 81.97% |

以上資料來源為國泰期貨商品研發部統計整理，圖表資料為運用 Excel 軟體所做的統計運算結果，透過專業的回溯軟體對台灣證券交易所上市櫃股票標的商品歷史成交價做模擬，模擬回測中已扣除交易稅與手續費，惟標的商品成交量的流動性風險並不包含在內，不保證未來標的商品的市況表現如同歷史行情，以上提供的績效亦不代表未來績效之保證，投資人應自行判斷投資標的之風險，承擔投資損益結果，不應將本資料內容引為投資之唯一依據，本投資建議不負責任何盈虧，亦不保證最低之收益及最大虧損。本廣告文宣內容有效期至 2014/06/30 止。

國泰期貨股份有限公司 臺北市大安區敦化南路 2 段 333 號 19 樓 電話:(02)2326-9899 102 年金管期總字第 004 號



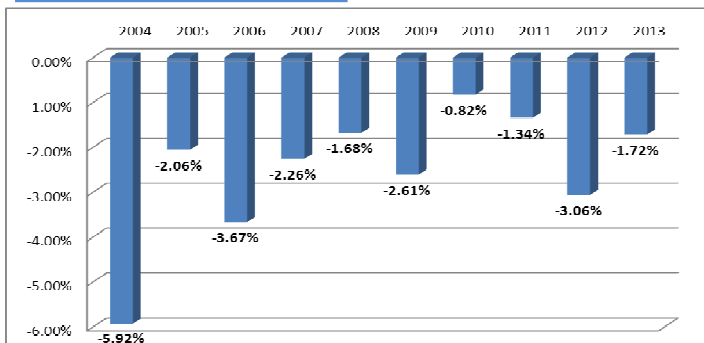
國泰期貨
Cathay Futures

國泰金控

黃梅雨季 勝算樹商品公開說明書

2014年2月17日

持倉期間最大風險(%)



| 西元年 | 2004 | 2005 | 2006 | 2007 | 2008 |
|----------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 持倉期間最大風險 | -5.92% | -2.06% | -3.67% | -2.26% | -1.68% |

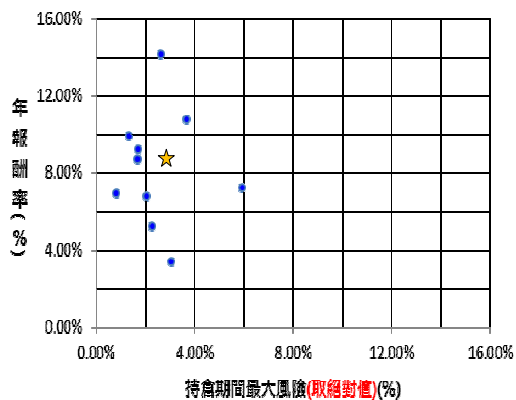
| 西元年 | 2009 | 2010 | 2011 | 2012 | 2013 |
|----------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 持倉期間最大風險 | -2.61% | -0.82% | -1.34% | -3.06% | -1.72% |

風險報酬定位

槓桿報酬=年報酬/持倉期間最大風險 **平均槓桿報酬: 4.25**

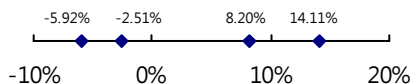
| 西元年 | 2004 | 2005 | 2006 | 2007 | 2008 |
|------|------|------|------|------|------|
| 槓桿報酬 | 1.21 | 3.29 | 2.92 | 2.33 | 5.16 |

| 西元年 | 2009 | 2010 | 2011 | 2012 | 2013 |
|------|------|------|------|------|------|
| 槓桿報酬 | 5.41 | 8.36 | 7.36 | 1.10 | 5.35 |

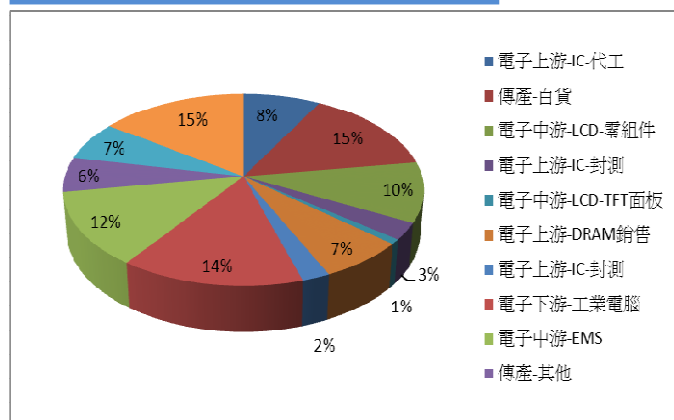


藍點象徵年度表現狀況，橫座標為該年度持倉期間風險，縱坐標為該年度報酬；星號的橫座標為平均持倉期間風險，縱坐標為平均年報酬率。

| | | |
|----------|-----|--------|
| 年度報酬 | 最高值 | 14.11% |
| | 平均值 | 8.2% |
| 持倉期間最大風險 | 最大值 | -5.92% |
| | 平均值 | -2.51% |



Portfolio 主要持股比例



| 股票名稱 | 信評等級(TCRI) | 指數彙編分類 | 所佔百分比 |
|------|------------|-----------------|--------|
| 隱藏 | 1 | 電子上游-IC-代工 | 7.94% |
| 隱藏 | 1 | 傳產-百貨 | 14.67% |
| 隱藏 | 3 | 電子中游-LCD-零組件 | 10.09% |
| 隱藏 | 3 | 電子上游-IC-封測 | 2.84% |
| 隱藏 | 5 | 電子中游-LCD-TFT 面板 | 0.82% |

營業員MEMO (名片)

匯款資訊

戶名: 國泰期貨股份有限公司
 銀行: 國泰世華銀行信義分行
 銀行代碼: 013
 帳號: 015-030-030-815
 連絡電話: 02-7711-1690
 e-mail: guanjou@cathayfut.com.tw

以上資料來源為國泰期貨商品研發部統計整理，圖表資料為運用 Excel 軟體所做的統計運算結果，透過專業的回溯軟體對台灣證券交易所上市櫃股票標的商品歷史成交價做模擬，模擬回測中已扣除交易稅與手續費，惟標的商品成交量的流動性風險並不包含在內，不保證未來標的商品的市況表現如同歷史行情，以上提供的績效亦不代表未來績效之保證，投資人應自行判斷投資標的之風險，承擔投資損益結果，不應將本資料內容引為投資之唯一依據，本投資建議不負責任何盈虧，亦不保證最低之收益及最大虧損。本廣告文宣內容有效期限到 2014/06/30 止。