



冬迎謀智 震抗金含

計量選股策略

採用多因子計量模型分析，
發展不同以往的多元選股模式。

多空操作組合

透過計量選股與運用多空並進的
策略彈性進場，提升投資組合績效
及風險控制。

提前佈局防線

透過篩選與大盤的連動性、淨值
股價比、毛利率、營益率等，找出
含金量較高的個股，組成對抗指
數震盪時的最佳防線。



股票投資新思維《勝算樹》

勝算樹



國泰期貨證期顧問處

<https://consultant.cathayfut.com.tw/>

透過數理統計及計量分析模型，推出《勝算樹》股
票投資策略商品，積極為投資人尋找合宜的進出場
時點，建立股票投資組合部位，以高規格、高品質
的顧問諮詢服務，提供您穩健的財富管理。



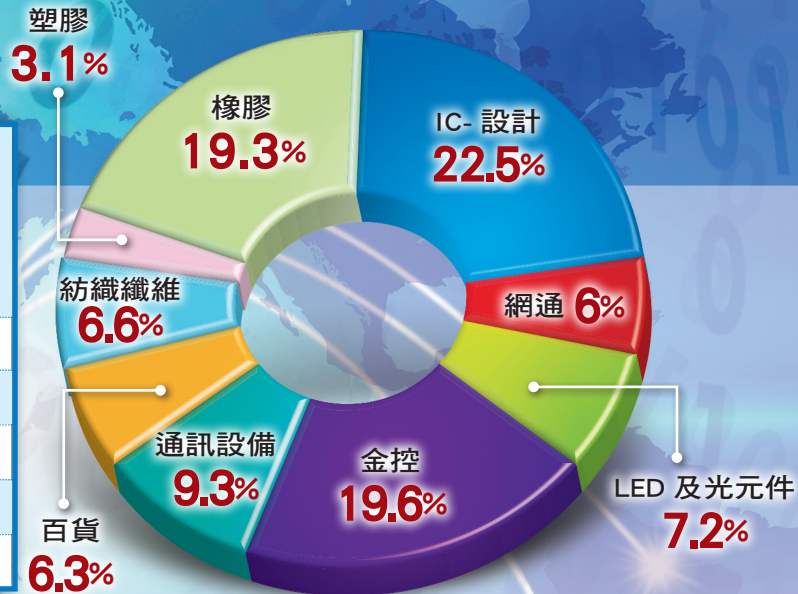
服務專線：(02)7712-3958



基本資料

商品設計

投資目標	以上市櫃熱門股票為標的，結合統計回歸、程式回溯做為投資組合的選擇參考。
操作期間	2014/11/07-2015/01/31
預估每單位使用資金	約 100 萬元 (新台幣)
操作檔數	共 12 檔個股
股票交易稅	3 ‰ (千分之3)
股票手續費 (單邊)	1.425 ‰ (千分之 1.425)



證券投資顧問 / 股票投資 · 策略商品 《勝算樹》

已結束商品	進行中的商品	匯款資訊：
封關令牌	除權息潮黑馬股	戶名：國泰期貨股份有限公司
黃梅雨季	八月風雲 傳金戴盈	銀行：國泰世華銀行信義分行
端午包粽	九月入秋 多空對沖	銀行代碼：013
六月作帳	十月中概 御宅經濟	帳號：015-030-030-815
		聯絡電話：02-7712-3958
		E-mail：CFC@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 2015/01/31 止。