

2008年7月度「優秀アルゴリズム賞」受賞ロボット

2008年8月8日
カブロボ運営事務局

カブロボ名	作者名	機種	選考理由	現在の運用状況 (7月29日時点)		10年間バックテスト
				運用 日数	トータル 純損益	年利回り
FTS ver 1.1	AMOL	JAVA	運用が好成績であるだけでなく、長期バックテストでも現物買い・信用売りの両方でプラスのリターンを上げながら、リターンが10%を超える年が12年中8年あり安定している。アルゴリズムに独自の工夫を行い、テクニカル指標の組合せもユニークである。年間売買回転率が12程度とさほど高くなく、平均トレード損益率が2.26%と、エッジ(優位性)が認められる。	64	13.6%	14.3%
Megaton Asura	神楽	KB Universal	リターン推移が特徴的で、コンテストで多く見られる逆張り型ロボットとは異なる。長期バックテストにおいて、年間売買回転率が30とやや高いが、平均トレード損益率が1.48%あり、ドローダウンが12%と安定感がある。また、逆張り型にしては、月次リターンのファットテイル傾向が小さく、短期～中期間の運用においてもパフォーマンスの再現性が期待できる。	83	0.6%	15.2%

上記のとおり、発表致します。
おめでとうございます！