

運用プログラム名【マーキュリー】

種別:トレンドフォロワー

実運用 2007/07 ~

シミュレーション 2005/01 ~ 2007/06

<基本統計>

	月次	年次
平均リターン	0.74%	8.92%
標準偏差	2.90%	10.04%
勝率	53.33%	
MDD	10.75%	
最長回復期間	6か月	
シャープ	0.23	0.79
ソルティノ	0.53	
プラス平均	3.01%	
マイナス平均	1.85%	
ペイオフ	1.63	

<パフォーマンス推移>

Jan-07	Feb-07	Mar-07	Apr-07	May-07	Jun-07	Jul-07	Aug-07	Sep-07	Oct-07	Nov-07	Dec-07	年率
0.57%	-3.02%	2.29%	2.16%	1.66%	-0.85%	-3.31%	4.92%	-0.47%	1.34%	2.31%	-1.04%	6.56%
Jan-08	Feb-08	Mar-08	Apr-08	May-08	Jun-08	Jul-08	Aug-08	Sep-08				年率
3.30%	7.39%	-3.03%	-2.27%	-0.37%	-1.60%	-1.20%	-2.30%	2.61%				2.55%

<期間推移>

1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	設定来
2.61%	-0.88%	-5.11%	6.30%

<証拠金比率>

全体	エネルギー	貴金属	穀物	ソフト
0%	0%	0%	0%	0%

実運用 累積パフォーマンス

