

運用プログラム名【ピア】

種別:ロングショート

実運用 2008/03~

シミュレーション 2005/01~2008/02

<基本統計>

	月次	年次
平均リターン	1.24%	14.87%
標準偏差	2.66%	9.21%
勝率	73.33%	
MDD	5.39%	
最長回復期間	4か月	
シャープ	0.44	1.51
ソルティノ	0.76	
プラス平均	2.40%	
マイナス平均	1.95%	
ペイオフ	1.23	

<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
2.42%	0.02%	1.44%	1.15%	-1.19%	0.83%	1.00%	0.97%	-0.28%	0.37%	0.47%	3.22%	10.41%
Jan-08	Feb-08	Mar-08	Apr-08	May-08	Jun-08	Jul-08	Aug-08	Sep-08				年率
0.93%	2.63%	1.58%	3.48%	2.24%	-2.28%	3.01%	-5.39%	8.26%				14.45%

<期間推移>

1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	設定来
8.26%	5.88%	9.32%	55.76%

<証拠金比率>

全体	エネルギー	貴金属	穀物	ソフト
4.7%	32%	41%	27%	0%

シミュレーション+実運用 累積パフォーマンス

