

運用プログラム名【S . システムトレード】

種別:トレンドフォロー&カウンター

実運用 2006/09~

<基本統計>

	月次	年次
平均リターン	2.56%	30.70%
標準偏差	9.66%	33.45%
勝率	44.00%	
MDD	35.51%	
最長回復期間	13か月	
シャープ	0.26	0.89
ソルティノ	0.63	
プラス平均	10.94%	
マイナス平均	4.02%	
ペイオフ	2.72	

<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
-0.86%	-0.50%	-13.17%	-4.55%	-3.52%	4.56%	-0.69%	7.74%	24.85%	8.74%	-11.00%	20.75%	32.34%
Jan-08	Feb-08	Mar-08	Apr-08	May-08	Jun-08	Jul-08	Aug-08	Sep-08				年率
1.31%	9.24%	-1.75%	-2.45%	6.35%	-3.47%	-0.31%	19.19%	16.40%				44.51%

<期間推移>

1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	設定来
16.40%	35.28%	35.70%	63.96%

<証拠金比率>

全体	エネルギー	貴金属	穀物	ソフト
3.5%	26%	33%	28%	13%

実運用 累積パフォーマンス

