

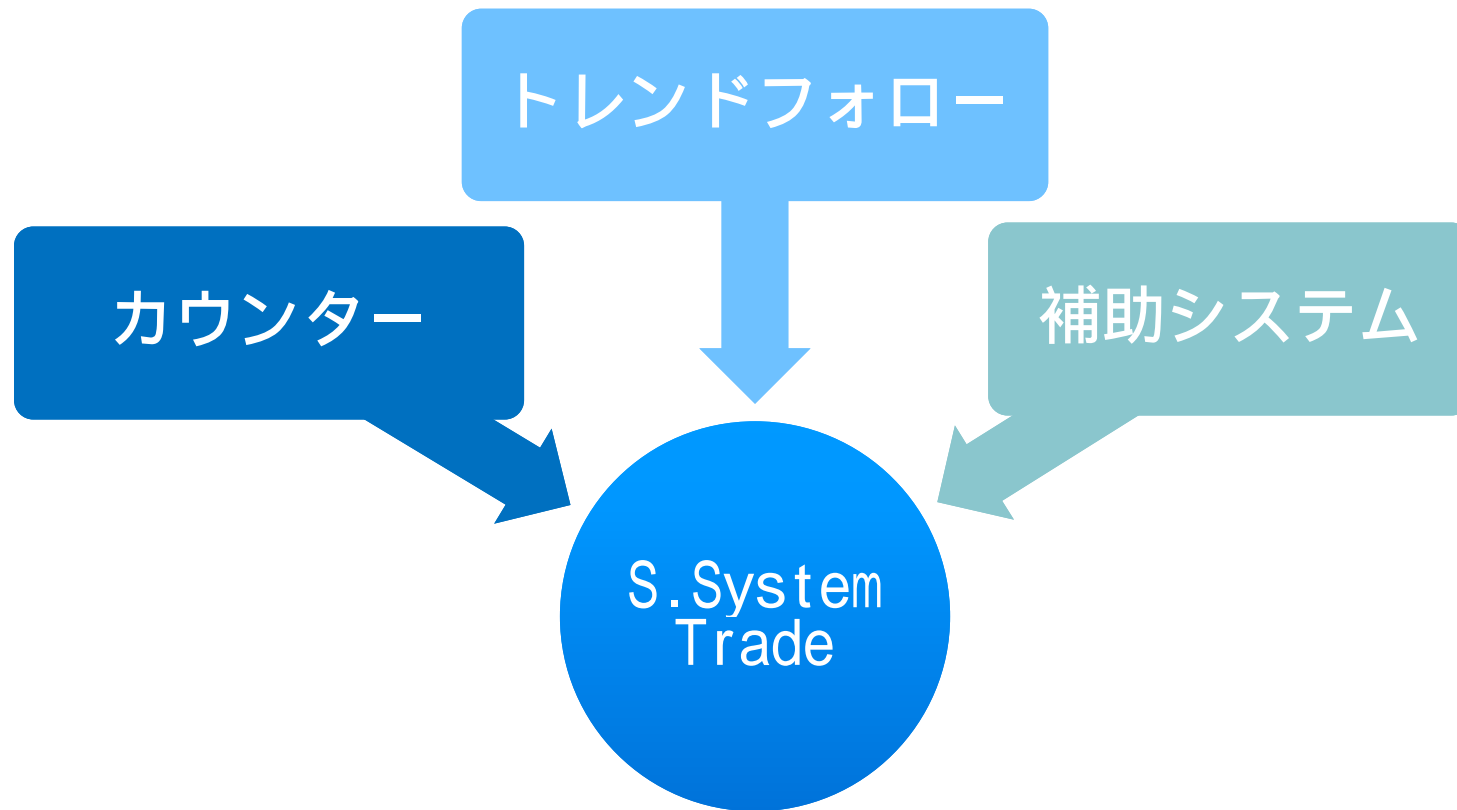
S system trade

2008.03.31

YutakaFutures

システム概要

トレンドフォローとカウンターという2つの相対する手法には双方に欠陥があります。一方の短所がもう一方の長所であるということを考えれば、この双方を組み合わせることにより双方の長所を引き出せます。



システム概要

トレンドフォロー

- 5種類のトレンド判定を行います

カウンター

- 6種類のカウンターでマーケットの行き過ぎや売買のタイミングを計ります

補助システム

- マーケットの流動性や価格変動を軸として、資産配分と運用管理を行います

システム概要

運用プログラム

- トレンドフォロワーとカウンター的合成
- ポジション保有期間は1ヵ月～2ヵ月
- 発注以外すべてシステムティック
- 基本的に流動性の高い期先において運用する

運用配分

- 配分比率は各マーケットの流動性とボラティリティーにより決定

ロスカット

- 売買の転換点がそのままロスカットレベルに設定されている