

2007年7月度 優秀アルゴリズム賞発表

今回の審査は、前回大会の表彰から8ヶ月経過していますので、表彰が23体と多くなっています。受賞されました作者の方、たいへんおめでとうございます！

これらの「優秀アルゴリズム賞」から、より詳細な分析評価を行い事業化を前提とするカプロボ「最優秀賞」を選出します。今後も2ヶ月毎に、この「優秀アルゴリズム賞」の審査を行います。今回選に漏れたカプロボも、運用を続けていただくことで、今後の審査で選出される場合があります。（毎回の審査は、今回選に漏れたカプロボを含め、すべてのカプロボを対象に、同一の条件で行います。）

カプロボ名	作者名	種類	トレード	テクニカル	ファンダメンタル	10年BT年利回り平均
1 FOOBER_07	FOOBER	KBストラテジー	中期	未使用	ハリュー	15.9%
低PBR、PER銘柄に投資する、シンプルな構造です。						
2 VM2006	anonymous	JAVA	長期	逆張り	ハリュー	12.7%
株主価値に対して株価が40%以上割安なら現物買い。損益プラスマイナス10%で売却。						
3 New Type_06	New Type	KBストラテジー	長期	逆張り	ハリュー	16.7%
総資産利益率(ROA) 5%以上 株主資本利益率(ROE)15%以上 株価収益率(PER)20以下の銘柄を現物買・長期保有						
4 ギターマン_06	ギターマン	KBユニバーサル	中期	逆張り	未使用	13.6%
ディフェンシブ銘柄の逆張りトレード						
5 相模家2号	相模家	JAVA	長期	順張り	グロス	6.9%
増収・増益企業への投資						
6 はげ茶_06	はげ茶	KBユニバーサル				12.7%
RSIと出来高を考慮						
7 ミー_08	ミー	KBユニバーサル				12.2%
PER,PBR,ROE,ROA、株主資本比率、日経平均の変動などで選定						
8 SECI_10	SECI	KBユニバーサル				11.5%
全体相場に影響を受けないようにモーメントの強弱の変化を見る						
9 Proj19-GonbeSP1	Proj19-GonbeSP	JAVA	中期	逆張り	未使用	19.3%
ローソク足+テクニカル						
10 testY11	ドリックス	JAVA	短期	その他	ハリュー	10.3%
チャート重視の短期売買ロボットです。場面によって順張り買い、逆張り買い、空売りをバランスよく発注します。ヘッジを巧みに行いますが、それ故に急な上						
11 tantakatan_hard	tantakatan	JAVA	短期	逆張り	未使用	30.2%
非常に厳しい条件で銘柄を選定しています。取引回数が少ないため全力で仕掛けます。						
12 玉藻の前	台満猫	JAVA	中期	データ	データ	4.7%
評議会を模したプログラムになっています。テクニカル(オシレーター)分析評議員、テクニカル(トレンド)分析評議員、テクニカル(ボリューム)分析評議員、						
13 jav1	Proj19-oz	JAVA	短期	逆張り	未使用	23.3%
短期で逆張りのカプロボです						
14 ニューロ君・サン	とものぶ	JAVA	中期	学習	未使用	8.5%
ニューラルネットワークにより、過去の2年間のデータを学習、学習成功率97%						
15 RED WINE	FUJI資産運用ファンド	JAVA	長期	逆張り	ハリュー	19.6%
資産運用ツールであることを目的として開発しました。したがって、優良銘柄に対して、順張りや逆張りを行うことでTOPIXを安定的に上回ることを目指していま						
16 02_toru_28	toru	JAVA	長期	その他	未使用	7.8%
逆張りや順張りを組み合わせています。						
17 ChartNN_prob	ゆんゆん	JAVA	中期	未使用	未使用	7.8%
前日の株価の上昇下降という情報を10日間集めてニューラルネットのバックプロパゲーションという学習方法で学習させ次の日の株価が上昇するか下降するか						
18 温故知新型ロボット(改)	森封	JAVA	中期	学習	未使用	11.1%
最近の値動きのグラフの形状が、過去の値動きの形状に近い動きをしていた場合で、過去のデータでは今後の値上がりを示しているものを買う。空売りはしな						
19 mizo_10	mizo	KBユニバーサル				13.4%
上昇トレンドと下降トレンドの変化を見る						
20 くいっぱ_04	くいっぱ	JAVA				6.8%
為替、指数なのでポジションを管理						
21 ジン_06	ジン	KBユニバーサル	短期	逆張り	未使用	19.8%
シンプルな短期の逆張り						
22 ATRRobot	tomo	JAVA	中期	順張り	その他	11.3%
トレーリングストップの拡張版を開発						
23 A	Cambell	JAVA	短期	逆張り	未使用	23.7%
徹底した逆張り戦略						

掲載順は、成績もしくは評価順ではありません。表彰は、現在運用中の成績に加えて、10年間バックテストの成績とアルゴリズムの定性評価などを総合して行っています。成績は、リターンだけでなく、例えばシャープレシオなど複数の指標で評価しています。詳しくは、審査基準をご参照ください。

備考：19 mizo\_10 と 20 くいっぱ\_04 の2体は、前回大会の「優秀アルゴリズム賞」のカプロボです。その後、運用を続けていまして、今回のそのフォワード運用成績も含めて再審査し、表彰させていただくことになりました。

21 ジン\_06、22 ATRRobot、23 A の3体は、カプロボ運営側に関係する人が開発したカプロボです。運用や参加方法に関して不正がないことを確認していますので、こちらで選出させていただいておりますが、いわゆる表彰については対象外です。

年間の表彰予定数は、「優秀アルゴリズム賞」が30-50体、「最優秀賞」が10体程度です。いつからでもご参加いただけますので、これからでも奮ってご参加ください。