

## 2008年9月度「優秀アルゴリズム賞」受賞ロボット

2008年10月1日  
カブロボ運営事務局

カブロボ名	作者名	機種	選考理由	現在の運用状況 (9月23日時点)		10年間バックテスト
				運用 日数	トータル 純損益	年利回り
順張りエース B	GREAT 4	KB Universal	順張り型の中では稀有な好成績であり、下落相場でのドロダウが比較的抑えられている。シンプルなロジックであり過剰なカーブフィッティングは感じられない。	28	-0.4%	9.7%
両建てロボ4	ちーぱぱ	JAVA	銘柄のペアの片方を買ひ、もう一方を信用売りするロングショート型の運用を行う。銘柄が固定であり、データがロボットに内蔵されているため、後知恵バイアスがバックテストの好パフォーマンスに寄与している可能性を排除できないが、ロングショート型運用はオルタナティブ投資の主要分野の1つであるため、今後の汎用性の向上を期待する。	42	-3.4%	3.6%

上記のとおり、発表致します。  
おめでとうございます！