

## 東大マスターシステム概要

### システム概要

**東大 Master** は、海外指標をインジケータとして利用することにより、日本の株価指数先物 (**TOPIX** および**日経 225**)の1日の方向性を予測します。寄り付き時の株価指数先物の GAP の大きさによりエントリー・シグナルが確定し、その後(システムは5分足を利用するので、9時05分)エントリーを行います。エントリーは1日1回のみ、エントリー後はロスカットおよびトレイリング・ストップにヒットしない限り、大引け(具体的には、15時05分)にエグジットを行います。

エントリー・ルール(戦略)は非常にシンプルであり、たった**1つの戦略のみ(ロング↑とショート↓)**で1つずつから成り立っています。また、移動平均やRSI、ストキャスティックといった既存のテクニカル指標は一切利用していません。戦略は非常にシンプルですが、**寄り付きのGAPのとりえ方は斬新**であり、日本の株価指数先物のその日の方向性を示すインジケータを利用してしています。また、マーケットの状況が突発的な事象等で極めて不安定な状態になっているときには、エントリーを避け、トレードを回避するように条件設定されています。

### 資産曲線



2006年10月1日～2007年12月13日の価格データよりウエストビレッジインベストメント社が検証。検証結果は過去のデータであり、将来の実績及び確実な利益を保証するものではありません。

手数料及びスリッページは含まれておりません。

ロスカットは0.8%で設定、トレイリング・ストップ(ブレイクイーブン+5円)を設定しております。

## 検証結果

ウエストビレッジインベストメント社が検証した 2006 年 10 月 1 日から 2007 年 12 月 13 日までのデータになります。

### 【 日経 225 先物 mini 】

テスト期間	2006 年 10 月 1 日 ~ 2007 年 12 月 13 日		
総利益	¥ 418,500		
総収益	¥ 822,000	総損失	( ¥ 403,500 )
勝率	63.64%		
プロフィット・ファクター	2.04 (総収益÷総損失)		
トレード回数	143 回 (取引回数の総数)	平均トレード回数	10 回 / 月
勝ちトレード回数	91 回	負けトレード回数	52 回
1 回当り平均収益	¥ 2,927		
1 回当り平均利益	¥ 9,033	1 回当り平均損失	( ¥ 7,760 )
最大連勝回数	11 回	最大連敗回数	3 回
最大日中ドローダウン	( ¥ 52,000 )		