

# 結果評価基準

## 結果評価基準

- 1) エントリーされた売買システムを、トレードシグナル上でシミュレーションし、期間終了時のパフォーマンスによりランキングを決定します

### ◆ 株価指数先物オーバーナイトおよびデイトレ部門

開始資金は 300 万円とし、最大建玉数は日経 225 先物：1 枚、日経 225mini：10 枚、TOPIX 先物：1 枚での運用成績とします。なお、トレード時間に、イブニングセッションは含みません。

### ◆FX部門

開始資金は 300 万円とし、最大建玉数は、USD/JPY、EUR/JPY、GBP/JPYの 3 通貨ペアで、すべて 100 K (10K×10) を上限として運用成績とします。成績はB I D価格にて計算し評価します。

ランキングは、収益ごとの評価としますが、300 万円を損金を上回った時点でコンテスト参加は終了となります。弊社が行うバックテスト期間は、トレードシグナルで取得可能な最大期間を使用します。売買システムは、パッケージもしくはコードでも受付可能としますが、トレードシグナル上で動作できないものは無効となります。

- 2) 弊社ホームページに専用ページを作成し、ランキングを表記、更新は営業日ごとに行うこととします。
- 3) リアルタイムトレードでは運用できない（バックテストとリアルタイムトレードではシグナルが異なってくるようなコードの書き方となっている場合やスリッページ等を考慮すると実売買での運用は難しい等）と判断された場合は、評価対象外とします。
- 4) 手数料・スリッページは、日経 225 先物、日経 225mini、および TOPIX 先物ともに 1 枚につき往復で 1 ティック分を適用します。ドル円：スプレッドおよびスリッページ込みで片道 1.5 ポイント、ユーロ円：スプレッドおよびスリッページ込みで片道 2 ポイント、ポンド円：スプレッドおよびスリッページ込みで片道 2.5 ポイントとして計算します。
- 5) コンテスト最終日のポジションが残った場合は、株価指数先物取引の場合は、最終日の大引けの値段で評価を行うものとします。なお 9 月 SQ につきましては、9 月限にポジションがある場合は SQ 日から 12 月限に持ち越し、12 月限の売買シグナルにより評価していきます。評価においては、つなぎ足を使用して判断します。FX部門は、開始を 2010 年 8 月 16 日 7:00 とし、終了を 2010 年 10 月 30 日 6:00 としポジションがある場合は、評価します。
- 6) 売買回数  
提出された売買システムにおいて、各部門ともにコンテスト開催期間内で売買回数は、5 トレード以上（5 回決済）あることが条件となります。

コンテスト運用規定（5 条）より抜粋

平成 22 年 6 月 10 日