1) Short-Term Rates Momentum

a. 트레이딩 전략 스킴

- 통화 정책 변화에 따른 단기 금리 선물의 모멘텀 효과를 수취.

b. 포지션 계산 방식

- 자산 유니버스: SOFR, EURIBOR 선물

- 시그널

(1) 125d, 250d, 500d EMMA로 모멘텀 스코어 계산

- 사이즈

(1) 각 자산간 변동성을 계산해 변동성 중립 포지션을 취함

(2) 최대 베팅 비중 250%

(3) 일일 최대 회전율 25%

(4) 전체 포트폴리오의 변동성 타겟 5%

- 최종 포지션: 시그널 \* 사이즈

- 패러미터: 시그널 계산 룩백 윈도우, 변동성 계산 룩백 윈도우

c. 백테스팅 결과

- 샤프비율: 0.87 / 승률: 54% / 손익비: 1.02







