

# 룰데로 Algo 트레이딩

## 룰데로 운용 개요

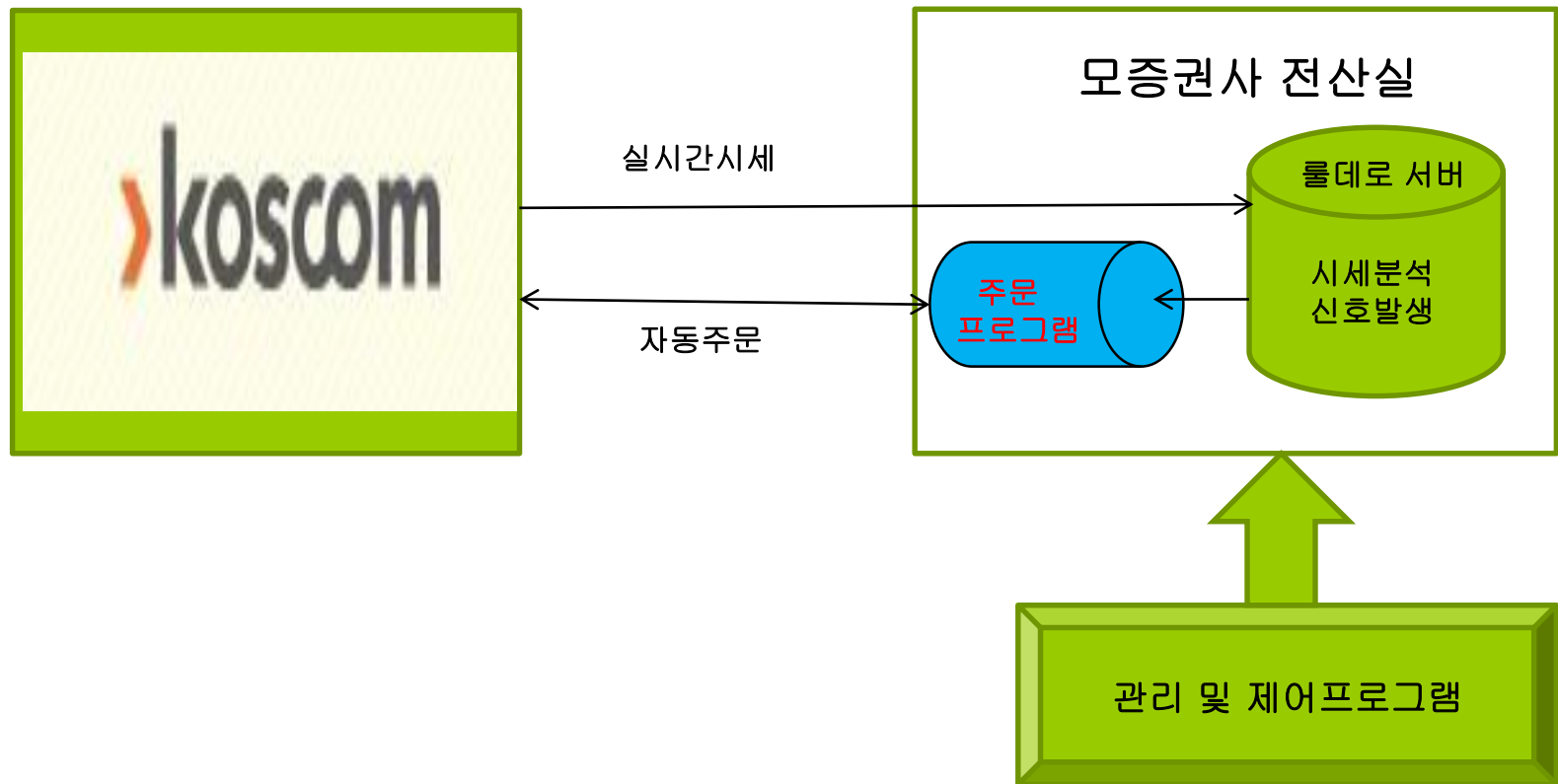
1. 운용 목표 - 년 평균 10% 이상의 **안정적 수익추구**
2. 운용 방식 - 자체 개발한 매매툴을 이용한 전자동 매매
3. 운용 대상 - 주가지수 선물, 옵션 (현행)
4. 운용 경험 - 2006년부터 알고리즘매매 시작
5. 운용 방식 - 전략아이디어 -> 시뮬레이션 -> 실전테스트 -> 적용

### 4. 운용 특징

- **안정성** : 1) 포트폴리오에 의한 투자  
2) **당일청산 전략만 구사**  
(롤오버 없음 ; 서버에서 자동관리)
- 자동화 : 1) 옵션 자동종목선정  
2) 자동주문 , 자동청산 , 자동손절매

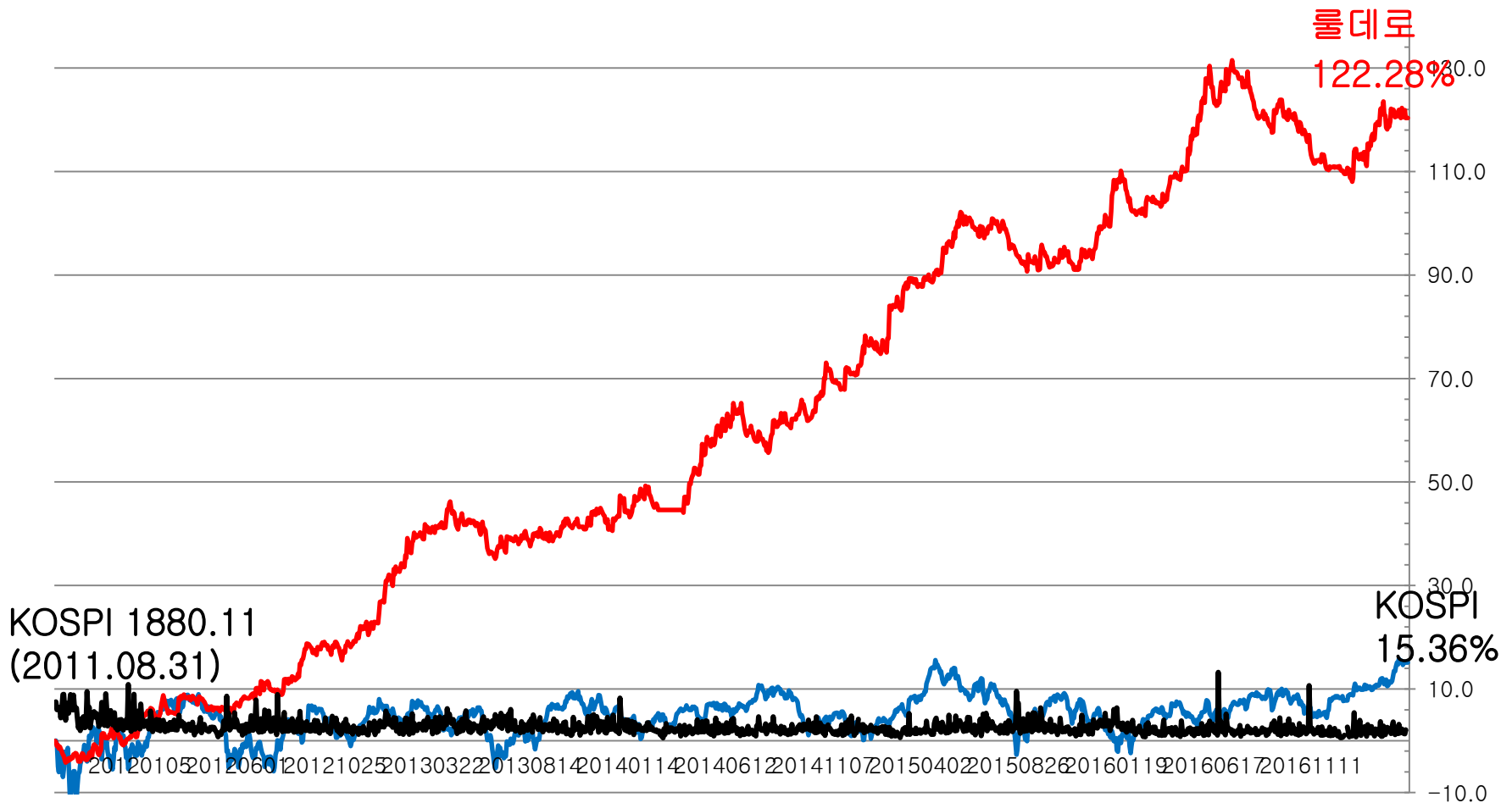
# 투자자 입장에서 심리적으로 편안한 수익을 추구

## 룰데로 운용 구조



- 좀 더 빠른 시세 및 주문처리를 위한 DMA 방식의 구조

# 롤데로 총수익율(2011.9.1~2017.03.30)



승률 : 44.31%

거래기간 : 5년 7개월

총수익율 : 122.28%

# 룰데로 총수익율(2011.9.1~2017.01.26)

[시스메틱 안내](#)
[브로커](#)
[전략랭킹](#)
[포트폴리오](#)

[전략랭킹](#)
[나의 관심전략](#)

[목록으로](#)
[전략 프린트하기](#)

S

D

K200선물

K200옵션

룰데로 K200 선물 & 옵션

- 자체 알고리즘을 통한 K200 선물 & 옵션 자동 매매 (DMA 방식)
- 룰오버 없이 당일청산
- 적은 MDD로 수익성보다 안정성에 비중 (단, 투자비율 조절시 손익 변동성 증가)

트레이더

증권사

매매통

룰데로

KB증권

KB스마트

투자원금(KRW)

147,662,823

SM Score

50.57

평당금액(KRW)

3,800,000,000

투자자 수

7

[페이스북 공유](#)

Followers

28

누적 수익률

81.5%

최대 자본인하율

-10.23%

평균 손익률

0.0610%

Profit Factor

1.3201 : 1

승률

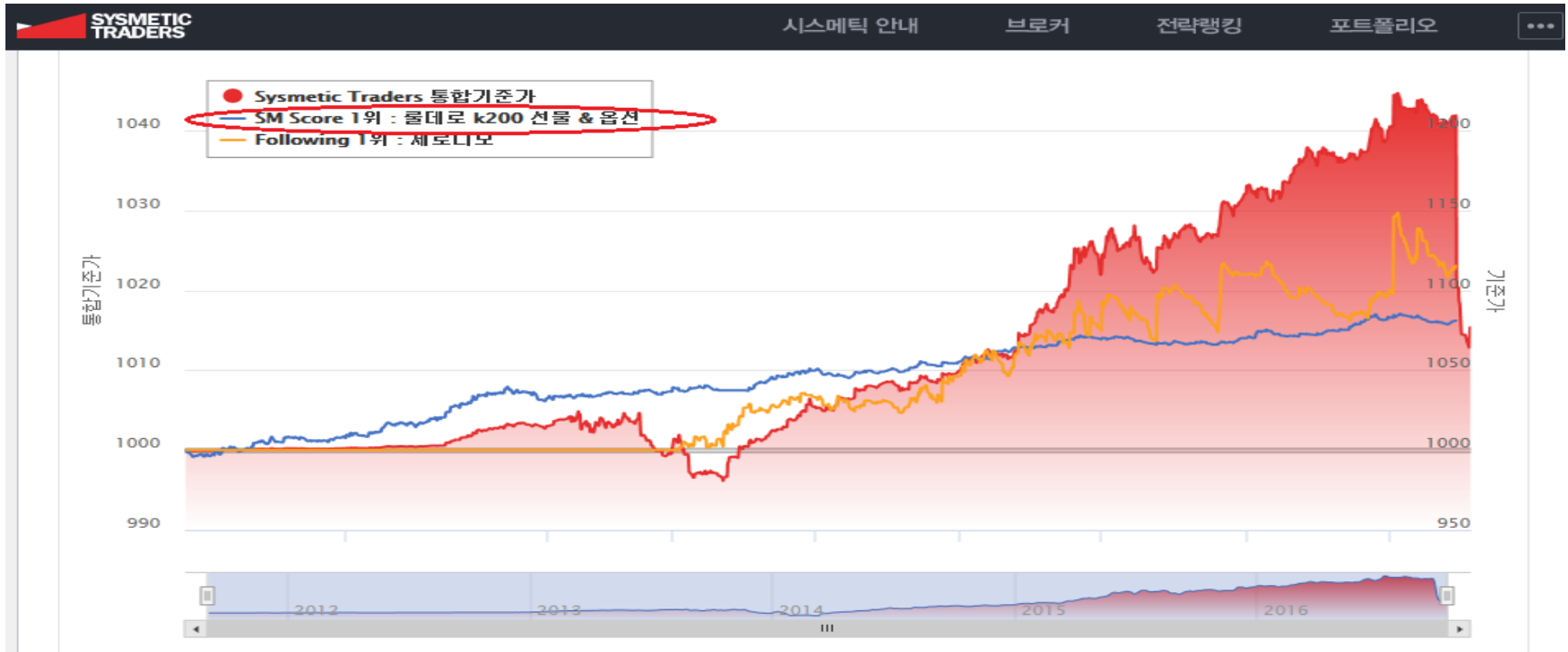
46.0123%

월간 수익률

	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	YTD
2011									-2.73%	2%	2.5%	-1.1%	0.67%
2012	3.48%	1.06%	2.38%	-1.3%	0.99%	2.64%	-0.22%	2.28%	4.77%	-0.04%	3.54%	0.47%	20.06%
2013	8.27%	5.86%	1.2%	1.24%	-1.7%	-2.39%	0.8%	1.66%	-0.76%	1.12%	2.32%	-0.89%	16.73%
2014	2.37%	-1.45%		5.93%	4.65%	2.06%	-2.32%	1.42%	0.77%	2.15%	1.52%	2.13%	19.23%
2015	1.36%	6.35%	1.41%	1.47%	5.19%	-1.52%	1.12%	-3.4%	1.01%	-0.35%	0.66%	2.09%	15.38%
2016	4.59%	-3.34%	1.9%	2.61%	6.13%	0.96%	0.27%	-3%	1.07%	-2.11%	-1.78%	-1.71%	5.6%
2017	1.6%												1.6%

# 실전 시스템트레이딩 플랫폼(SYSMETIC)에서 종합수익 최우수 판정

✓ 손실기간과 손실규모를 반영한 종합수익 부문 최우수 시스템으로 인정



## SM SCORE 랭킹 TOP5

1	물데로 k200 선물 &...	물데로	0.85%	84.49%
2	ETF레버리지/인버스	MACB	0.82%	39.01%
3	설현사랑 FuturesDay	설현사랑	0%	52.23%
4	아키온 합성옵션	MACS	0.16%	24.12%
5	주식 10년 우상향	안전 우상향	-0.16%	155.22%

## Follow 랭킹 TOP5

1	제로니모	제로니모	0%	146.32%
2	아파트	아파트수집가	-0.8%	124.6%
3	STA FuturesDay	STA	9.79%	98.28%
4	ETF레버리지/인버스	MACS	-0.02%	39.01%
5	DreamBox OptionDay	삼릉미	5.09%	31.79%

# 현재 실계좌 운영현황

## 8계좌 40억 규모를 운영중

<div> <div>[2567] 당일손익조회 [공격형:권유회망:045세:6년:****취약미해당:2017...]</div> <div> <div>계좌번호 248 01 선평출선 활동</div> <div>비밀번호 ****</div> <div>조회 취소</div> </div> <div> <div>전일자산평가총액 166,153,892 당일자산평가총액 165,194,162</div> <div>당일손익 -959,730 당일손익률(%) -0.58</div> </div> <div> <table> <tr> <th>선 물</th> <th>실현손익</th> <th>평가손익</th> <th>매매수수료</th> <th>청산수수료</th> <th>합계</th> </tr> <tr> <td></td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> </tr> </table> <div> <div>- 당일입출금시 손익률은 차이가 발생하므로 손익으로만 확인하시기 바랍니다.</div> <div>- 선물실현손익은 장 종료후 당일종가로 평가한 정산차금으로 대체됩니다.</div> <div>- 미니선물 분기월의 최종 정산가격은 장종료 후 코스피선물의 정산가격을 적용하므로 장중 손익과 다소 차이가 있을 수 있습니다.</div> </div> <div> <div>2016년10월12일13:36:58</div> <div>정상적으로 조회되었습니다.</div> </div> </div> </div>	선 물	실현손익	평가손익	매매수수료	청산수수료	합계		0	0	0	0	0	<div> <div>[2567] 당일손익조회 [공격형:권유회망:026세:1년:****취약미해당:2018...]</div> <div> <div>계좌번호 02 선평출선 활동</div> <div>비밀번호 ****</div> <div>조회 취소</div> </div> <div> <div>전일자산평가총액 314,762,819 당일자산평가총액 312,972,759</div> <div>당일손익 -1,790,060 당일손익률(%) -0.57</div> </div> <div> <table> <tr> <th>선 물</th> <th>실현손익</th> <th>평가손익</th> <th>매매수수료</th> <th>청산수수료</th> <th>합계</th> </tr> <tr> <td></td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> </tr> </table> <div> <div>- 당일입출금시 손익률은 차이가 발생하므로 손익으로만 확인하시기 바랍니다.</div> <div>- 선물실현손익은 장 종료후 당일종가로 평가한 정산차금으로 대체됩니다.</div> <div>- 미니선물 분기월의 최종 정산가격은 장종료 후 코스피선물의 정산가격을 적용하므로 장중 손익과 다소 차이가 있을 수 있습니다.</div> </div> <div> <div>2016년10월12일13:37:03</div> <div>정상적으로 조회되었습니다.</div> </div> </div> </div>	선 물	실현손익	평가손익	매매수수료	청산수수료	합계		0	0	0	0	0	<div> <div>[2567] 당일손익조회 [공격형:권유회망:052세:3년:****취약미해당:2018...]</div> <div> <div>계좌번호 02 선평출선 활동</div> <div>비밀번호 ****</div> <div>조회 취소</div> </div> <div> <div>전일자산평가총액 314,707,727 당일자산평가총액 314,707,727</div> <div>당일손익 -1,820,050 당일손익률(%) -0.57</div> </div> <div> <table> <tr> <th>선 물</th> <th>실현손익</th> <th>평가손익</th> <th>매매수수료</th> <th>청산수수료</th> <th>합계</th> </tr> <tr> <td></td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> </tr> </table> <div> <div>- 당일입출금시 손익률은 차이가 발생하므로 손익으로만 확인하시기 바랍니다.</div> <div>- 선물실현손익은 장 종료후 당일종가로 평가한 정산차금으로 대체됩니다.</div> <div>- 미니선물 분기월의 최종 정산가격은 장종료 후 코스피선물의 정산가격을 적용하므로 장중 손익과 다소 차이가 있을 수 있습니다.</div> </div> <div> <div>2016년10월12일14:02:12</div> <div>정상적으로 조회되었습니다.</div> </div> </div> </div>	선 물	실현손익	평가손익	매매수수료	청산수수료	합계		0	0	0	0	0
선 물	실현손익	평가손익	매매수수료	청산수수료	합계																																	
	0	0	0	0	0																																	
선 물	실현손익	평가손익	매매수수료	청산수수료	합계																																	
	0	0	0	0	0																																	
선 물	실현손익	평가손익	매매수수료	청산수수료	합계																																	
	0	0	0	0	0																																	
<div> <div>[2567] 당일손익조회 [공격형:권유회망:056세:10년:****취약미해당:201...]</div> <div> <div>계좌번호 250 02 선평출선 활동</div> <div>비밀번호 ****</div> <div>조회 취소</div> </div> <div> <div>전일자산평가총액 2,523,834,851 당일자산평가총액 2,504,053,581</div> <div>당일손익 -19,781,270 당일손익률(%) -0.79</div> </div> <div> <table> <tr> <th>선 물</th> <th>실현손익</th> <th>평가손익</th> <th>매매수수료</th> <th>청산수수료</th> <th>합계</th> </tr> <tr> <td></td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> </tr> </table> <div> <div>- 당일입출금시 손익률은 차이가 발생하므로 손익으로만 확인하시기 바랍니다.</div> <div>- 선물실현손익은 장 종료후 당일종가로 평가한 정산차금으로 대체됩니다.</div> <div>- 미니선물 분기월의 최종 정산가격은 장종료 후 코스피선물의 정산가격을 적용하므로 장중 손익과 다소 차이가 있을 수 있습니다.</div> </div> <div> <div>2016년10월12일14:01:47</div> <div>정상적으로 조회되었습니다.</div> </div> </div> </div>	선 물	실현손익	평가손익	매매수수료	청산수수료	합계		0	0	0	0	0	<div> <div>[2567] 당일손익조회 [공격형:권유회망:024세:1년:****취약미해당:2018...]</div> <div> <div>계좌번호 02 선평출선 활동</div> <div>비밀번호 ****</div> <div>조회 취소</div> </div> <div> <div>전일자산평가총액 314,803,067 당일자산평가총액 312,933,017</div> <div>당일손익 -1,870,050 당일손익률(%) -0.60</div> </div> <div> <table> <tr> <th>선 물</th> <th>실현손익</th> <th>평가손익</th> <th>매매수수료</th> <th>청산수수료</th> <th>합계</th> </tr> <tr> <td></td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> </tr> </table> <div> <div>- 당일입출금시 손익률은 차이가 발생하므로 손익으로만 확인하시기 바랍니다.</div> <div>- 선물실현손익은 장 종료후 당일종가로 평가한 정산차금으로 대체됩니다.</div> <div>- 미니선물 분기월의 최종 정산가격은 장종료 후 코스피선물의 정산가격을 적용하므로 장중 손익과 다소 차이가 있을 수 있습니다.</div> </div> <div> <div>2016년10월12일13:37:02</div> <div>정상적으로 조회되었습니다.</div> </div> </div> </div>	선 물	실현손익	평가손익	매매수수료	청산수수료	합계		0	0	0	0	0	<div> <div>[2567] 당일손익조회 [공격형:권유회망:058세:10년:****취약미해당:2018...]</div> <div> <div>계좌번호 01 선평출선 활동</div> <div>비밀번호 ****</div> <div>조회 취소</div> </div> <div> <div>전일자산평가총액 209,702,446 당일자산평가총액 209,702,446</div> <div>당일손익 -1,381,750 당일손익률(%) -0.66</div> </div> <div> <table> <tr> <th>선 물</th> <th>실현손익</th> <th>평가손익</th> <th>매매수수료</th> <th>청산수수료</th> <th>합계</th> </tr> <tr> <td></td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> </tr> </table> <div> <div>- 당일입출금시 손익률은 차이가 발생하므로 손익으로만 확인하시기 바랍니다.</div> <div>- 선물실현손익은 장 종료후 당일종가로 평가한 정산차금으로 대체됩니다.</div> <div>- 미니선물 분기월의 최종 정산가격은 장종료 후 코스피선물의 정산가격을 적용하므로 장중 손익과 다소 차이가 있을 수 있습니다.</div> </div> <div> <div>2016년10월12일13:37:05</div> <div>정상적으로 조회되었습니다.</div> </div> </div> </div>	선 물	실현손익	평가손익	매매수수료	청산수수료	합계		0	0	0	0	0
선 물	실현손익	평가손익	매매수수료	청산수수료	합계																																	
	0	0	0	0	0																																	
선 물	실현손익	평가손익	매매수수료	청산수수료	합계																																	
	0	0	0	0	0																																	
선 물	실현손익	평가손익	매매수수료	청산수수료	합계																																	
	0	0	0	0	0																																	
<div> <div>[2567] 당일손익조회 [공격형:권유회망:082세:7년:****20160724:로알...]</div> <div> <div>계좌번호 02 선평출선 활동</div> <div>비밀번호 ****</div> <div>조회 취소</div> </div> <div> <div>전일자산평가총액 209,615,708 당일자산평가총액 208,243,968</div> <div>당일손익 -1,371,740 당일손익률(%) -0.66</div> </div> <div> <table> <tr> <th>선 물</th> <th>실현손익</th> <th>평가손익</th> <th>매매수수료</th> <th>청산수수료</th> <th>합계</th> </tr> <tr> <td></td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> </tr> </table> <div> <div>- 당일입출금시 손익률은 차이가 발생하므로 손익으로만 확인하시기 바랍니다.</div> <div>- 선물실현손익은 장 종료후 당일종가로 평가한 정산차금으로 대체됩니다.</div> <div>- 미니선물 분기월의 최종 정산가격은 장종료 후 코스피선물의 정산가격을 적용하므로 장중 손익과 다소 차이가 있을 수 있습니다.</div> </div> <div> <div>2016년10월12일13:37:00</div> <div>정상적으로 조회되었습니다.</div> </div> </div> </div>	선 물	실현손익	평가손익	매매수수료	청산수수료	합계		0	0	0	0	0	<div> <div>[2567] 당일손익조회 [공격형:권유회망:053세:9년:****취약미해당:2018...]</div> <div> <div>계좌번호 01 선평출선 활동</div> <div>비밀번호 ****</div> <div>조회 취소</div> </div> <div> <div>전일자산평가총액 104,715,525 당일자산평가총액 103,710,815</div> <div>당일손익 -1,004,710 당일손익률(%) -0.96</div> </div> <div> <table> <tr> <th>선 물</th> <th>실현손익</th> <th>평가손익</th> <th>매매수수료</th> <th>청산수수료</th> <th>합계</th> </tr> <tr> <td></td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> <td>0</td> </tr> </table> <div> <div>- 당일입출금시 손익률은 차이가 발생하므로 손익으로만 확인하시기 바랍니다.</div> <div>- 선물실현손익은 장 종료후 당일종가로 평가한 정산차금으로 대체됩니다.</div> <div>- 미니선물 분기월의 최종 정산가격은 장종료 후 코스피선물의 정산가격을 적용하므로 장중 손익과 다소 차이가 있을 수 있습니다.</div> </div> <div> <div>2016년10월12일13:37:15</div> <div>정상적으로 조회되었습니다.</div> </div> </div> </div>	선 물	실현손익	평가손익	매매수수료	청산수수료	합계		0	0	0	0	0													
선 물	실현손익	평가손익	매매수수료	청산수수료	합계																																	
	0	0	0	0	0																																	
선 물	실현손익	평가손익	매매수수료	청산수수료	합계																																	
	0	0	0	0	0																																	

## 룰데로 트레이딩의 경험 및 방향

### 경험

- ✓ 시중에 출시된 시스템트레이딩 툴 (TS, MC, YT, CT등)을 배제
- ✓ 2006년부터 알고리즘 트레이딩으로만 매매하며 다양한 시장경험 및 노하우 축적
- ✓ 수익의 변동성 보다는 안정적 수익실현에 대한 자신감 확보

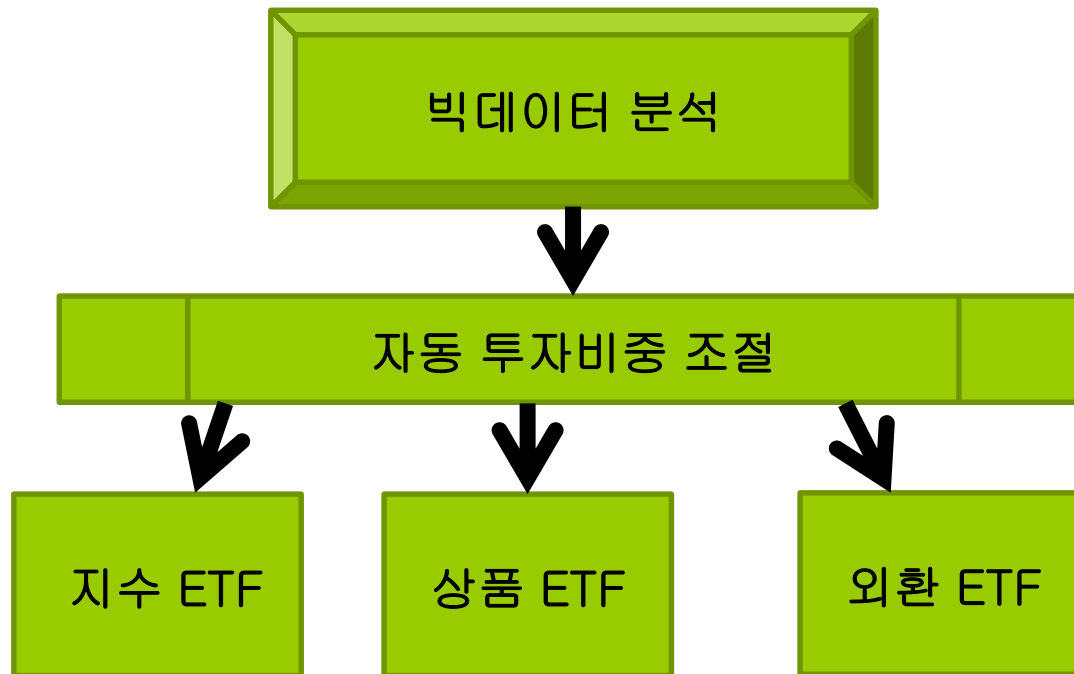


### 비전

- ✓ 고액, 다수의 계좌 운용
- ✓ ETF 및 다양한 상품군에 로보어드바이저(4단계) 도입
- ✓ 24시간 포트폴리오 운영 및 RISK 제어 완전 자동화 수립



## 추가 Plan : 로버어드바이저 엔진 개발



**빅데이터 분석을 통하여 다수의 시장과 투자대상에 대하여 자동 자산배분과 투자비중이 조절되어 자동매매까지 가능한 로보어드바이저 엔진 개발**

감 사 합 니 다.