

戦国 F X

過去の戦績レポート

- FX売買ロジック -

服部半蔵



主な戦績

獲得領地 24万石

出陣回数 155回

慎重かつ静かな戦略

※獲得領地 ”万石” は、純利益の金額で、単位は1万石=1万円となります。
※本戦績レポートの期間は、2008年5月12日～2011年5月12日の3年間となります。

by Strategy Trader

Initia Star
Your Expectation Factory
イニシア・スター証券株式会社

ストラテジーの運用成績サマリー	全取引	ロング取引	ショート取引
純利益	242,000.00	11,910.00	230,090.00
総利益	1,245,970.00	549,380.00	696,590.00
総損失	-1,003,970.00	-537,470.00	-466,500.00
調整純利益	-18,601.66	-167,191.85	41,106.00
調整総利益	1,121,991.35	470,083.83	600,906.00
調整総損失	-1,140,593.01	-637,275.67	-559,800.00
選択した純利益	279,610.00	122,790.00	156,820.00
選択した総利益	884,300.00	438,130.00	446,170.00
選択した総損失	-604,690.00	-315,340.00	-289,350.00
必要金額	192,990.00	215,570.00	118,270.00
口座のリターン	12,539.51	552.49	19,454.64
初期資金に対するリターン	242.00	11.91	230.09
ストラテジーにおける最大ドローダウン	-265,640.00	-276,030.00	-137,590.00
ストラテジーにおける最大ドローダウン(%)	-120.12	-201.64	-48.83
決済ベースの最大ドローダウン	-192,990.00	-215,570.00	-118,270.00
決済ベースの最大ドローダウン(%)	-92.56	-173.50	-38.49
ストラテジーの最大ドローダウンにおけるリターン	0.91	0.04	1.67
利益要因	1.24	1.02	1.49
調整利益要因	-0.98	-0.74	1.07
選択した利益要因	1.46	1.39	1.54
最大ポジション保有数	1.00	1.00	1.00
支払スリッページ	0.00	0.00	0.00
手数料	0.00	0.00	0.00
オープンポジションの損益	3,280.00	3,280.00	n/a
年間リターン率	81.90	4.05	77.87
月間リターン率	6.83	0.34	6.49
パイ&ホールドのリターン	-20,352.11	-19,496.69	-20,352.11
平均月次リターン	6,629.19		
月次リターン標準偏差	46,824.99		

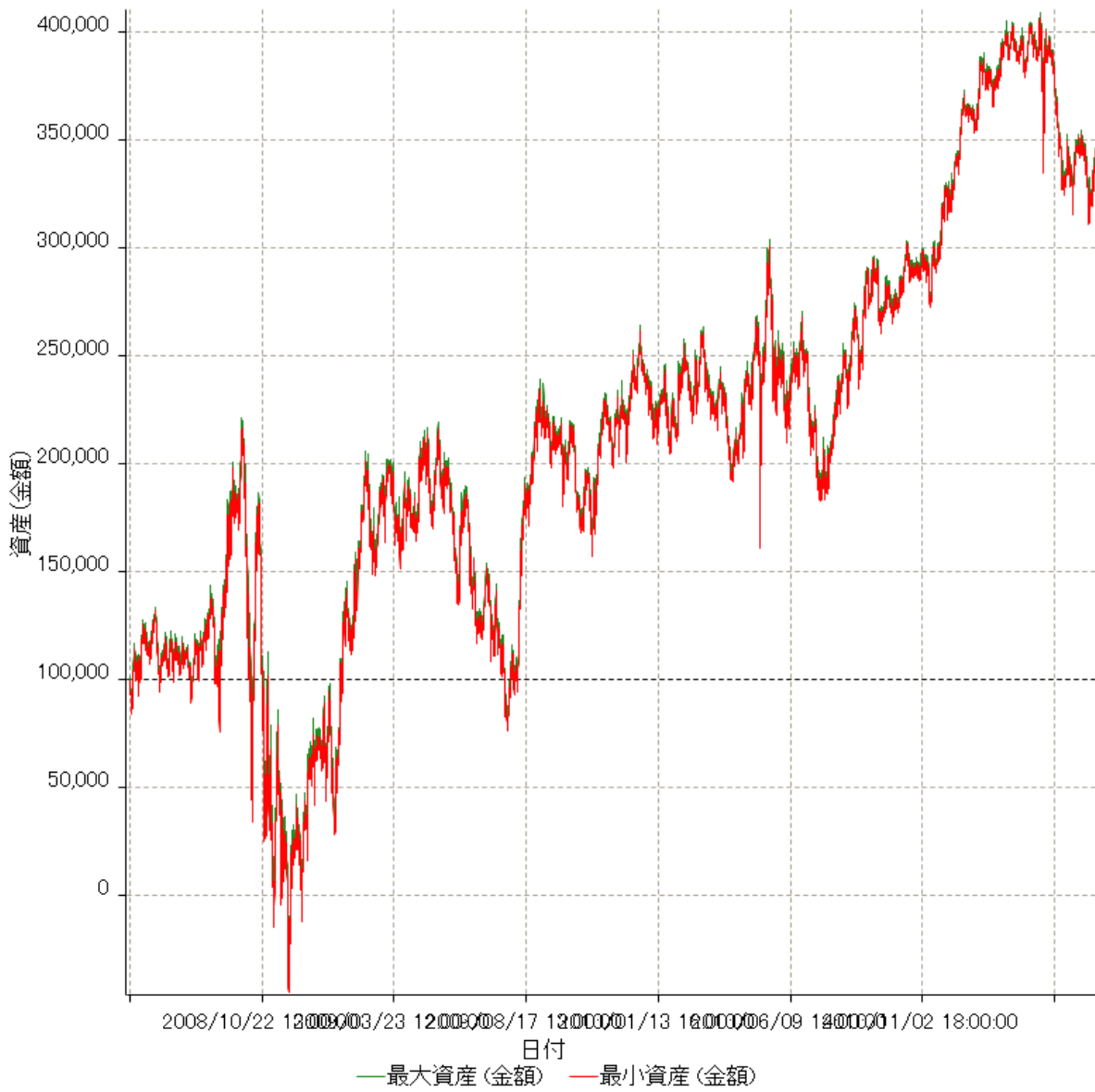
運用成績比率	
アップサイド潜在レシオ	6.85
シャープレシオ	0.25
ソルティノレシオ	0.55
フォースレシオ	0.00
カルマーレシオ	0.00
スターリングレシオ	0.00
純利益 / 最大損失	-237.95
純利益 / 取引の最大ドローダウン	-139.09
純利益 / ストラテジーの最大ドローダウン	-91.10
選択した純利益 / 最大損失	-274.94
選択した純利益 / 取引の最大ドローダウン	-160.70
選択した純利益 / ストラテジーの最大ドローダウン	-105.26
調整純利益 / 最大損失	18.29
調整純利益 / 取引の最大ドローダウン	10.69
調整純利益 / ストラテジーの最大ドローダウン	7.00

100,000円でスタートした場合、
初期資金に対するリターンは**242.0%**
資産にして、**342,000円**になる試算

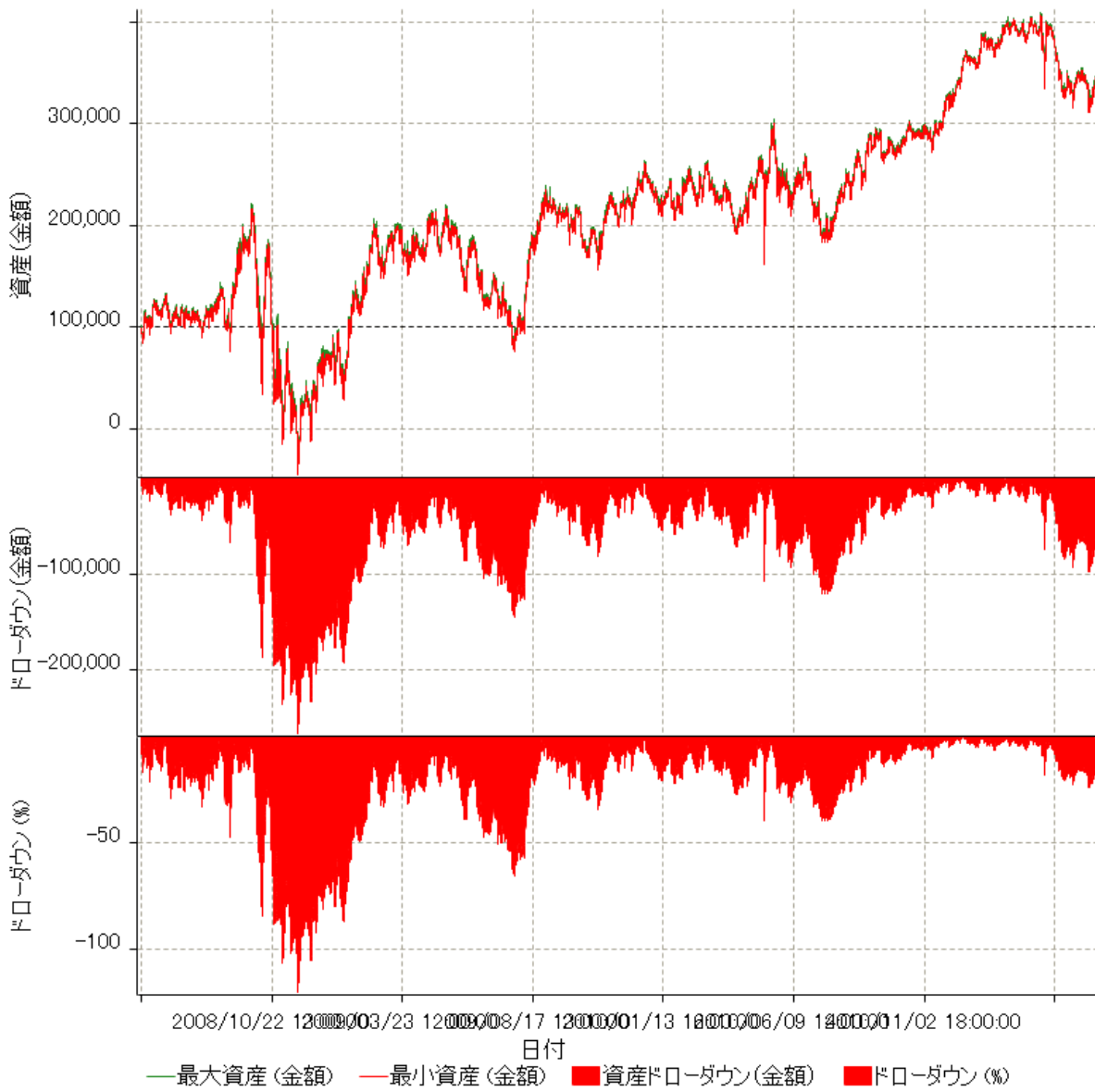
時間解析	
取引期間	2 Yrs, 11 Mths, 21 Dys, 5 Hrs
市場における(実行)時間	2 Yrs, 11 Mths, 20 Dys, 21 Hrs
市場における比率	99.97
最長のポジションなし期間	16 Dys, 16 Hrs
最大含み益の日付	39,736.00
最大ドローダウンの日付	39,731.00
ストラテジー中の最大ドローダウンの日付	39,772.71
決済ベースの最大ドローダウンの日付	39,776.58

最も有名な**オンレタ**系指標
(逆張り型指標) **RSI**を
活用したロジック。
通貨ペアの選択は**慎重に**。

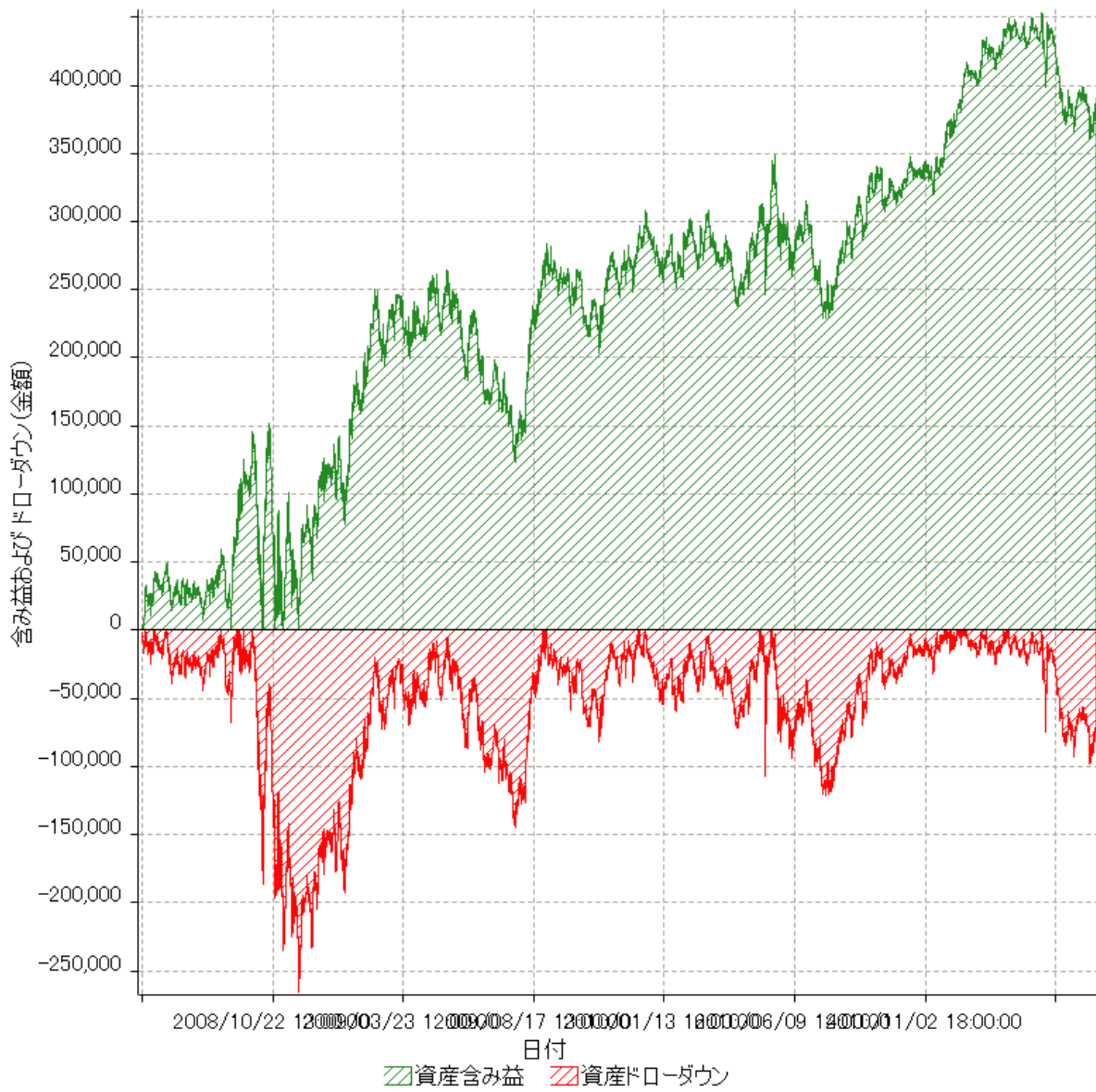
詳細にわたる資産曲線



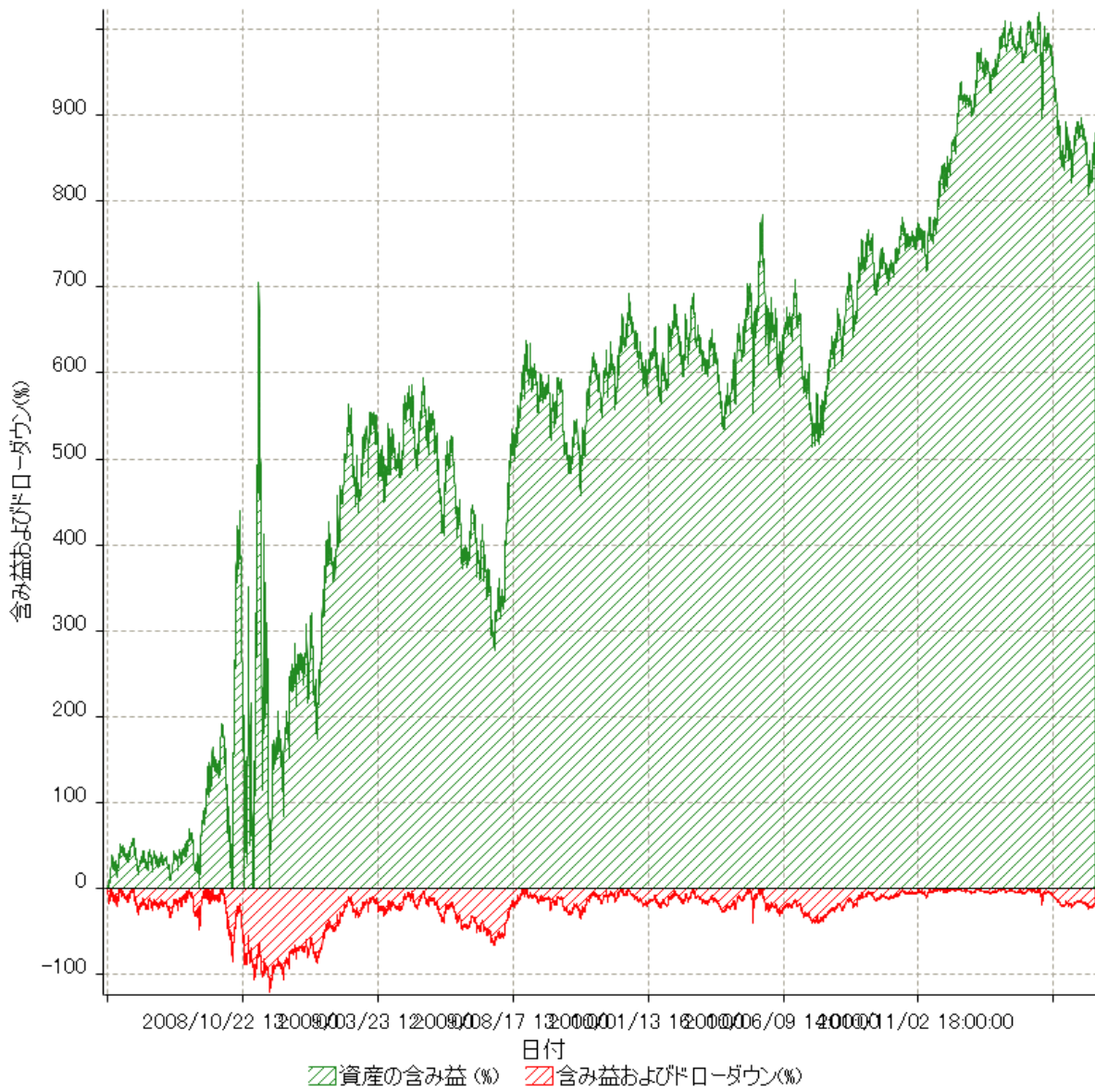
ドロダウンの詳細入り資産曲線



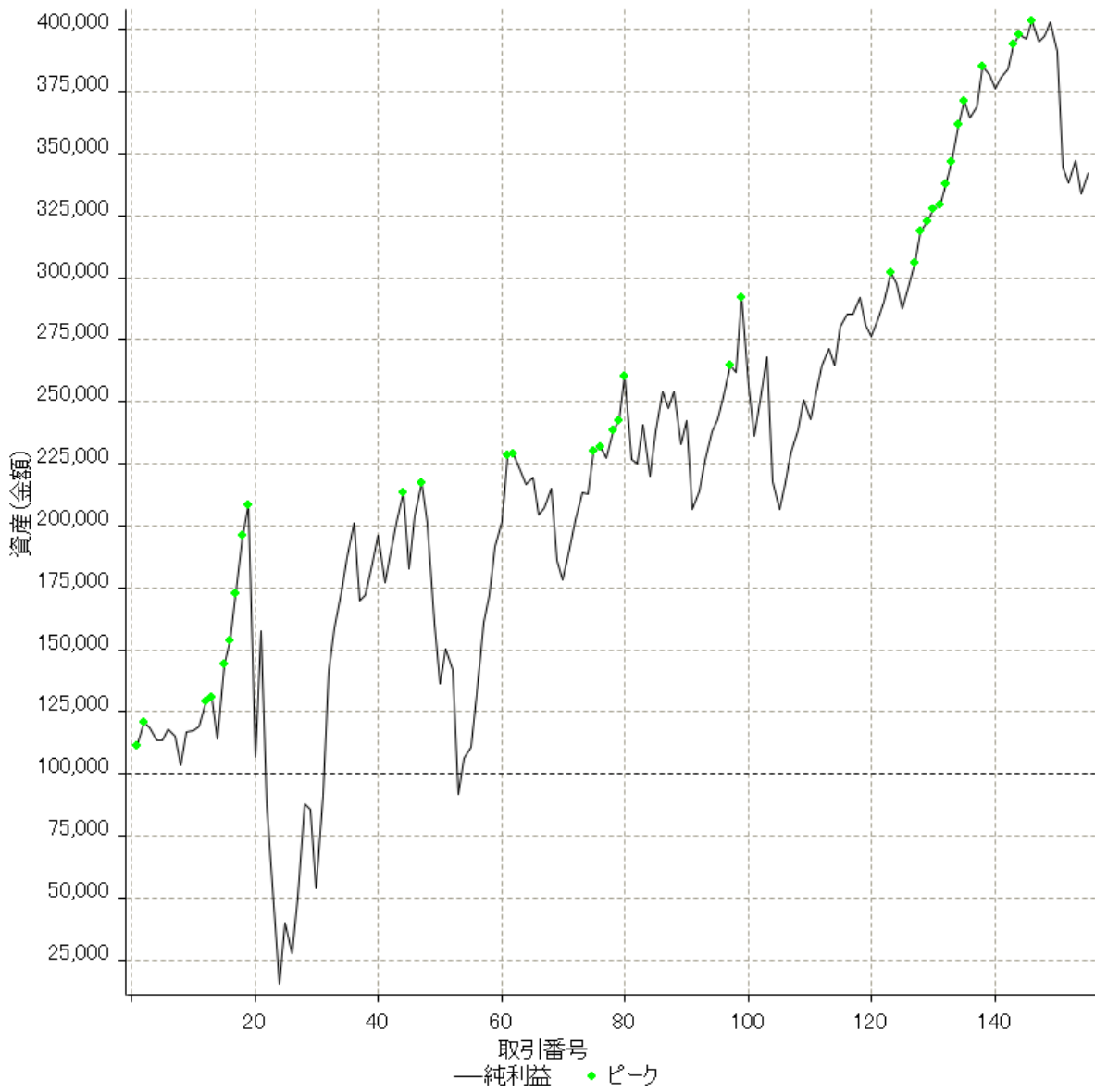
資産の含み益とドロダウン



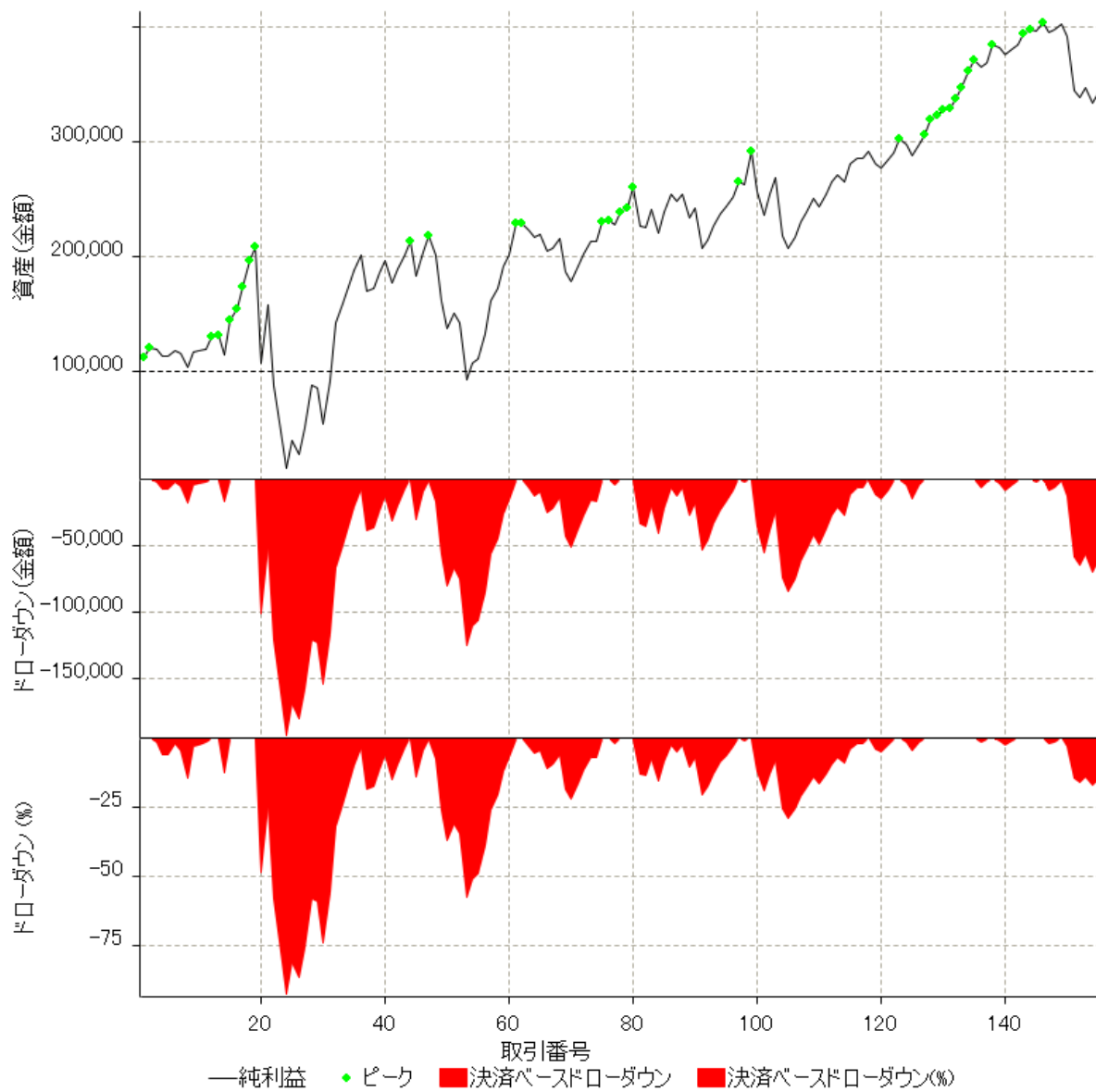
資産の含み益とドロダウン(%)



決済ベースの資産曲線



決済ベースの資産曲線とドロダウ



総トレード解析			
	全取引	ロング取引	ショート取引
合計取引数	155.00	77.00	78.00
オープントレードの合計数	1.00	1.00	0.00
勝ち取引数	101.00	48.00	53.00
負け取引数	54.00	29.00	25.00
% 利益	65.16	62.34	67.95
平均取引(勝ち及び負け)	1,561.29	154.68	2,949.87
平均勝ち取引	12,336.34	11,445.42	13,143.21
平均負け取引	-18,592.04	-18,533.45	-18,660.00
平均勝ち/負け比率	-0.66	-0.62	-0.70
最大勝ち取引	51,000.00	50,210.00	51,000.00
最大負け取引	-101,700.00	-101,700.00	-50,300.00
取引における平均バー数	118.80	129.20	108.70
勝ち取引の平均バー数	80.70	91.10	71.30
負け取引の平均バー数	190.10	192.10	187.80
取引間の平均バー数	n/a	n/a	n/a
勝ち取引間の平均バー数	103.20	295.90	279.20
負け取引間の平均バー数	153.90	448.60	555.40

異常値			
	全て	プラス	マイナス
1 Std. Deviation of Avg. Trade	20,103.78	9,244.57	19,443.21
平均取引+1標準偏差	21,665.07	21,580.91	851.18
平均取引-1標準偏差	-18,542.49	3,091.77	-38,035.25
異常値の数	18.00	11.00	7.00
異常値の損益	-37,610.00	361,670.00	-399,280.00

含み益/ドローダウン		
	含み益	ドローダウン
最大値	61,200.00	-173,990.00
最大値の日付	39,736.00	39,731.00
平均値	13,197.63	-21,162.95
最大値 (%)	8.27	-17.47
最大値 (%) の日付	39,834.00	39,721.00
平均値 (%)	1.56	-2.47
1標準偏差	10,510.43	25,189.77
平均取引+1標準偏差	23,708.06	4,026.82
平均取引-1標準偏差	2,687.20	-46,352.71

取引の連続解析	
Z値	0.02
信頼度	0.02
ストラテジーME	1,561.29
最大連続勝ち取引	10.00
最大連続負け取引	3.00
最大連続利益	147,100.00
最大連続損失	-142,290.00
最大連続利益(%)	273.06
最大連続損失(%)	-90.17

一日あたりの取引回数は
0.2回と少なめ。
推奨投資金額は、
800,000円以上ほど

取引の連続統計				
連続利益		連続数	連続あたりの平均利益	次の取引の平均損失
	1.00	12.00	15,256.67	-20,280.00
	2.00	9.00	13,296.11	-14,001.11
	3.00	6.00	10,215.00	-15,628.33
	4.00	3.00	7,696.67	-6,806.67
	5.00	2.00	12,182.00	-59,135.00
	6.00	2.00	17,072.50	-16,700.00
	9.00	1.00	15,256.67	-6,770.00
	10.00	1.00	8,333.00	-6,400.00
	連続損失		連続数	連続数あたりの平均損失
1.00		20.00	-18,066.50	14,539.50
2.00		11.00	-15,804.09	13,348.18
3.00		4.00	-24,579.17	12,990.00

◆ディスクレマー◆

※バックテスト結果等は過去のデータをもとにした結果であり、将来の運用成果等を保証するものではありません。

※同じ設定をした場合でもパソコンの環境等により必ずしも同じ結果が得られるとは限りません。

※バックテスト結果等の資料は、情報提供を唯一の目的としており、金融商品等の勧誘を目的としているものではありません。

※バックテスト結果等の資料に記載されている情報は、当社が信頼できると考える情報源に基づいたものですが、当社が正確かつ完全であることを保証するものではありません。

※この資料に記載された実績、評価の表示等は、検証期間、作成日時点におけるものであり、設定の如何等、環境の変化によっては、変わる場合がございます。