

ストラテジーの運用成績サマリー

AUDJPY 60分足 ASK 期間(2008年3月25日～2011年3月25日)

ストラテジーアドバイザー名 : AK_Rider

	全取引	ロング取引	ショート取引
純利益	-27770	-76130	48360
総利益	5267870	2604740	2663130
総損失	-5295640	-2680870	-2614770
調整純利益	-316776.1967	-278615.5189	-158226.6413
調整総利益	5102520.827	2491916.187	2541827.752
調整総損失	-5419297.023	-2770531.705	-2700054.394
選択した純利益	-482870	-123390	-359480
選択した総利益	2978400	1591660	1386740
選択した総損失	-3461270	-1715050	-1746220
必要金額	348000	319810	201420
口座のリターン	-797.9885057	-2380.475908	2400.953232
初期資金に対するリターン	-27.77	-76.13	48.36
ストラテジーにおける最大ドローダウン	-381490	-333230	-222830
ストラテジーにおける最大ドローダウン(%)	-143.7198614	-246.8736109	-75.35652648
決済ベースの最大ドローダウン	-348000	-319810	-201420
決済ベースの最大ドローダウン(%)	-149.523073	-249.1508258	-71.98470288
ストラテジーの最大ドローダウンにおけるリターン	-0.07279352	-0.228460823	0.217026433
利益要因	-0.994756063	-0.971602502	1.018494935
調整利益要因	-0.941546626	-0.899436084	-0.941398721
選択した利益要因	-0.860493403	-0.928054576	-0.794138196
最大ポジション保有数	1	1	1
支払スリッページ	0	0	0
手数料	0	0	0
オープンポジションの損益	1140	1140 n/a	
年間リターン率	-9.461378989	-25.93787477	16.48226128
月間リターン率	-0.788448249	-2.161489564	1.373521773
バイ&ホールドのリターン	-12863.69799	-12863.69799	-12959.915
平均月次リターン	-739.7222222		
月次リターン標準偏差	51159.47836		

運用成績比率

アップサイド潜在レシオ	-0.145736173
シャープレシオ	-0.01639398
ソルティノレシオ	-0.01617423
フォースレシオ	-19.15094668
カルマーレシオ	5.23716E-06
スターリングレシオ	0.000151412
純利益 / 最大損失	60.10822511
純利益 / 取引の最大ドローダウン	57.210548
純利益 / ストラテジーの最大ドローダウン	7.279352014
選択した純利益 / 最大損失	1045.17316
選択した純利益 / 取引の最大ドローダウン	994.7878039
選択した純利益 / ストラテジーの最大ドローダウン	126.5747464
調整純利益 / 最大損失	685.6627634
調整純利益 / 取引の最大ドローダウン	652.6085634
調整純利益 / ストラテジーの最大ドローダウン	83.03656627

推奨投資
資金は、
1,200,000円
以上

[富裕層向け]

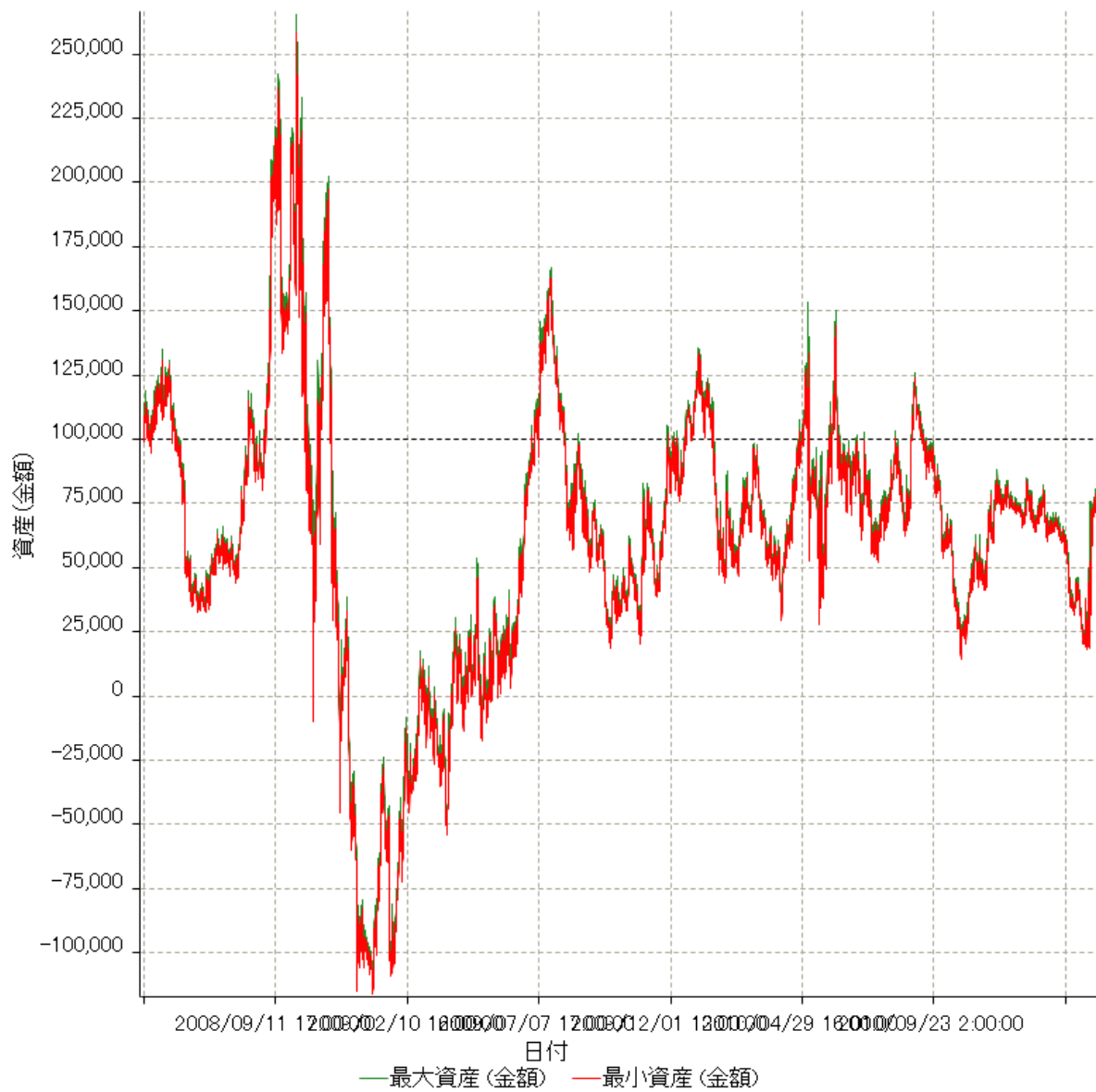
最大わずか
1 LOT
での取引

時間解析

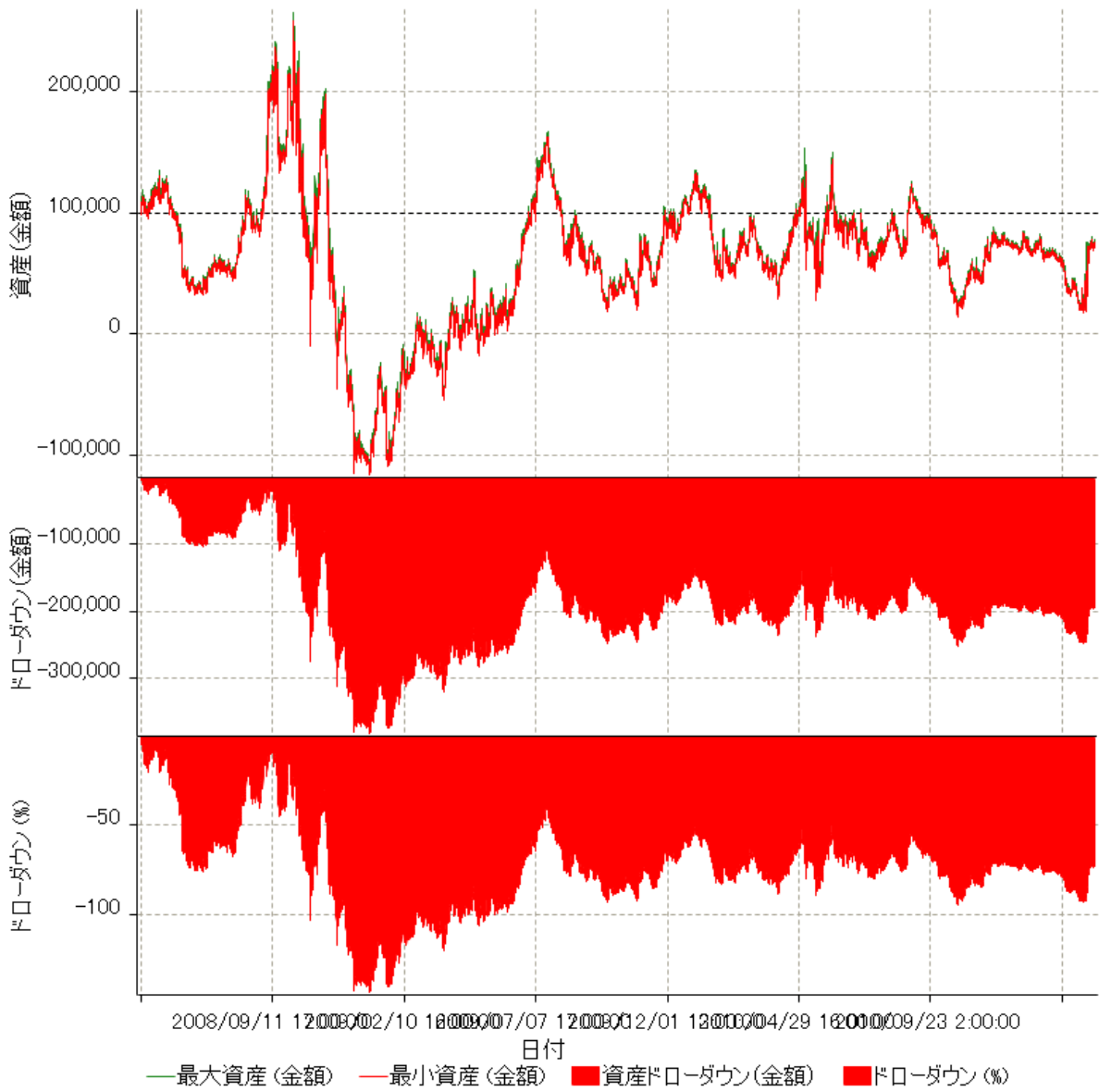
取引期間	2 Yrs, 11 Mths, 14 Dys, 1 Hr
市場における(実行)時間	2 Yrs, 11 Mths, 13 Dys, 21 Hrs
市場における比率	99.98445334
最長のポジションなし期間	14 Dys, 20 Hrs
最大含み益の日付	2008/10/6
最大ドローダウンの日付	2008/11/13
ストラテジー中の最大ドローダウンの日付	2008/12/31 11:00
決済ベースの最大ドローダウンの日付	2008/12/31 12:00

設定期間での
純利益は、
-27,770円

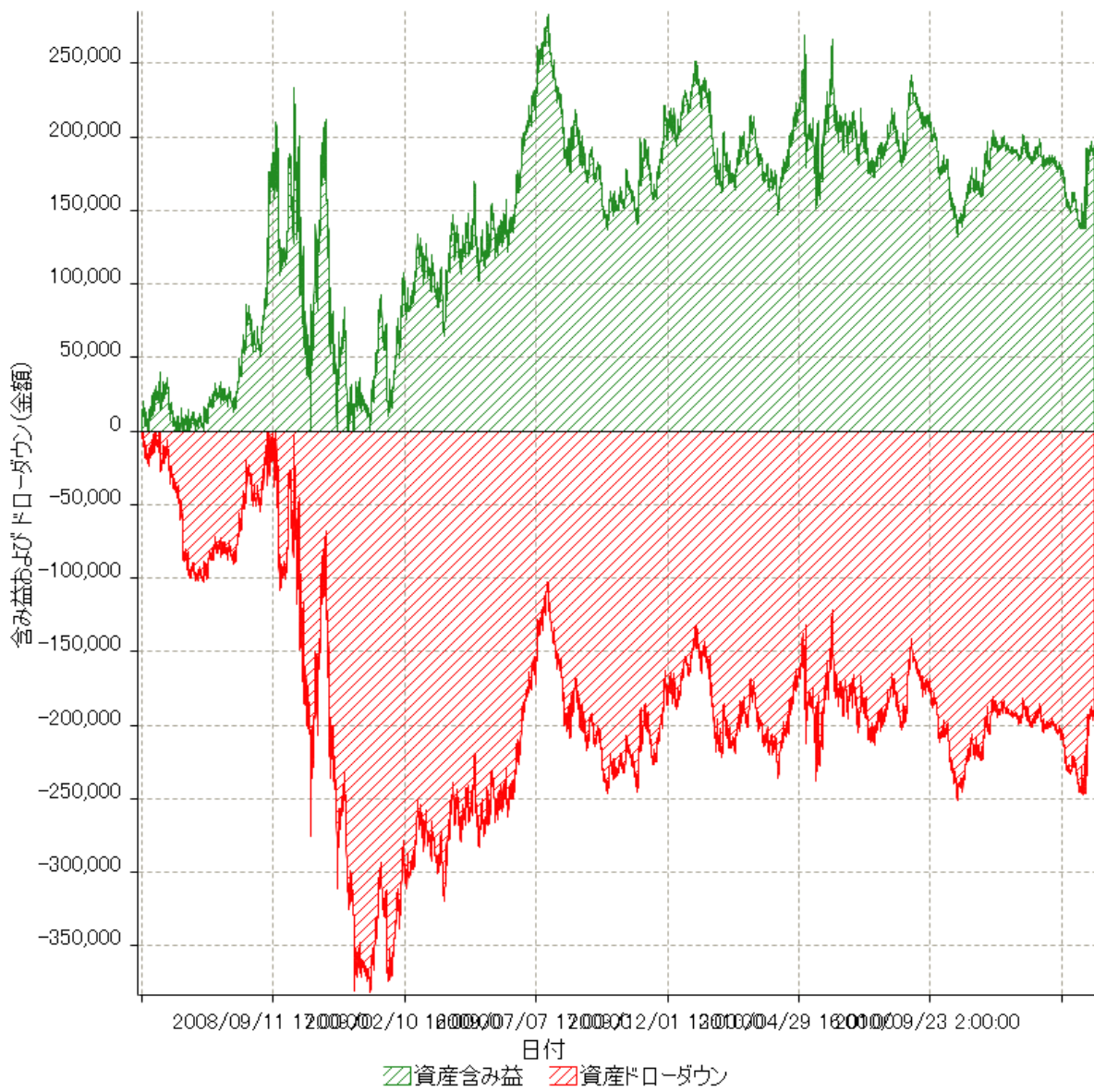
詳細にわたる資産曲線



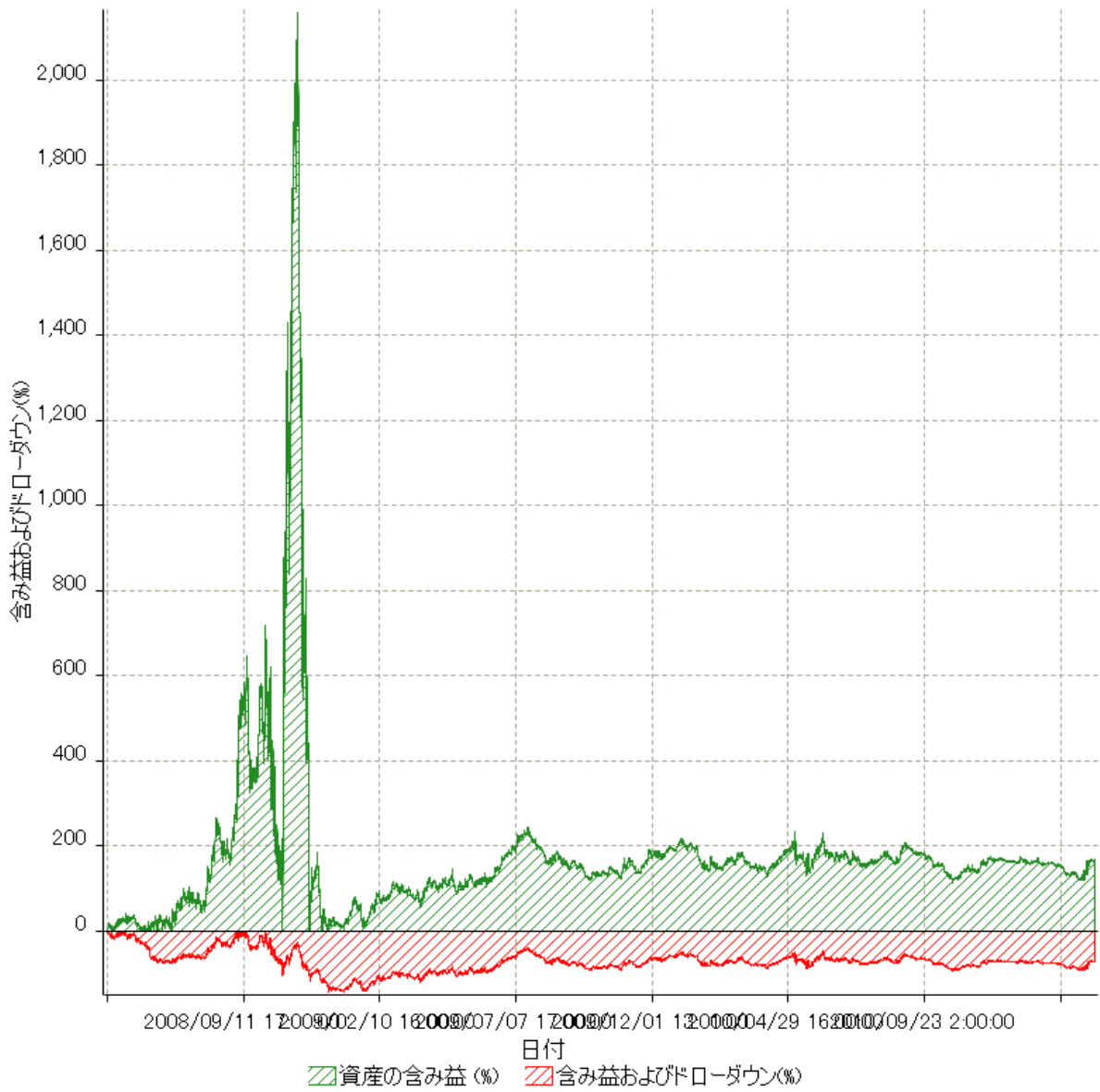
ドロダウンの詳細入り資産曲線



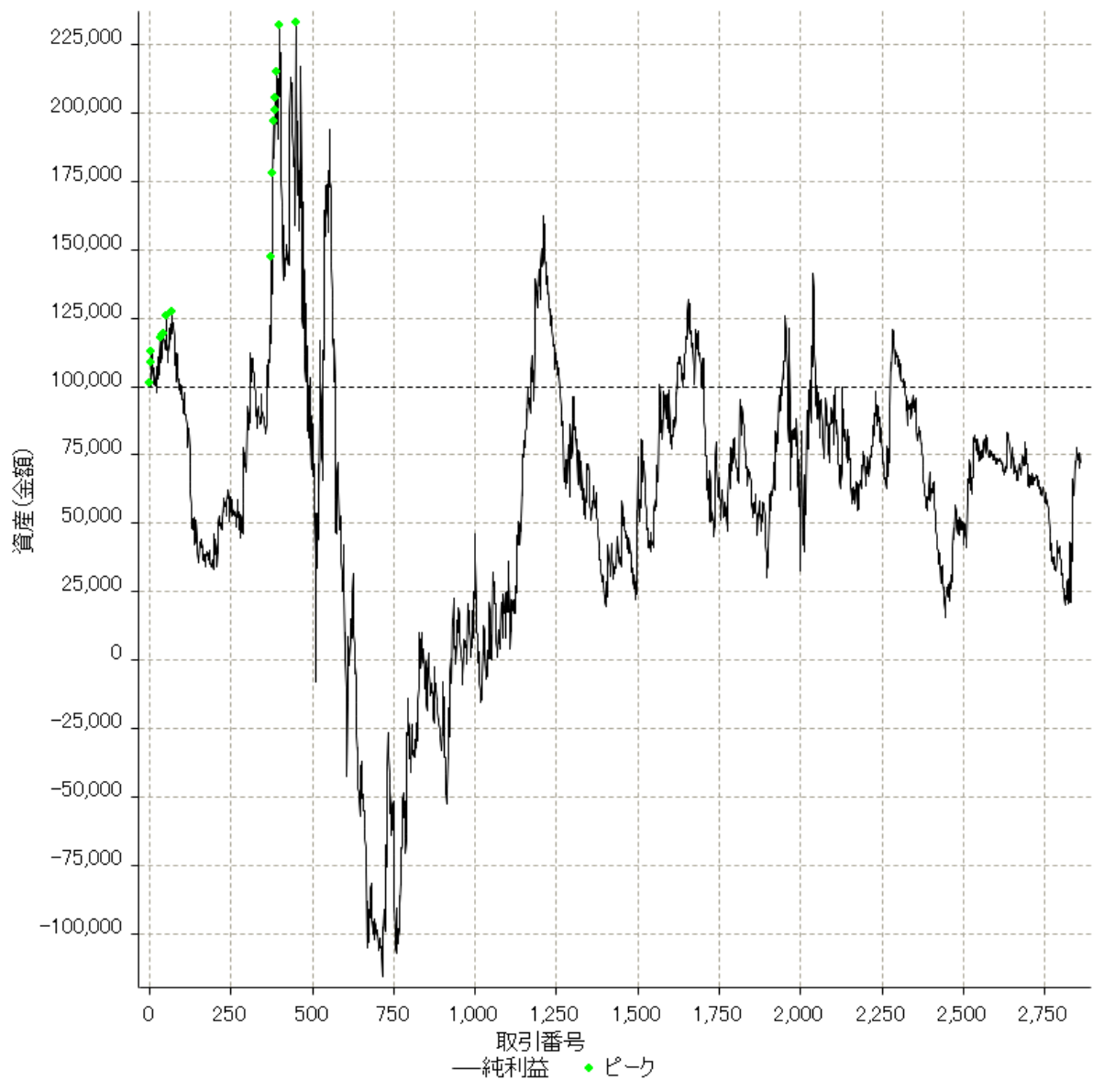
資産の含み益とドロダウ



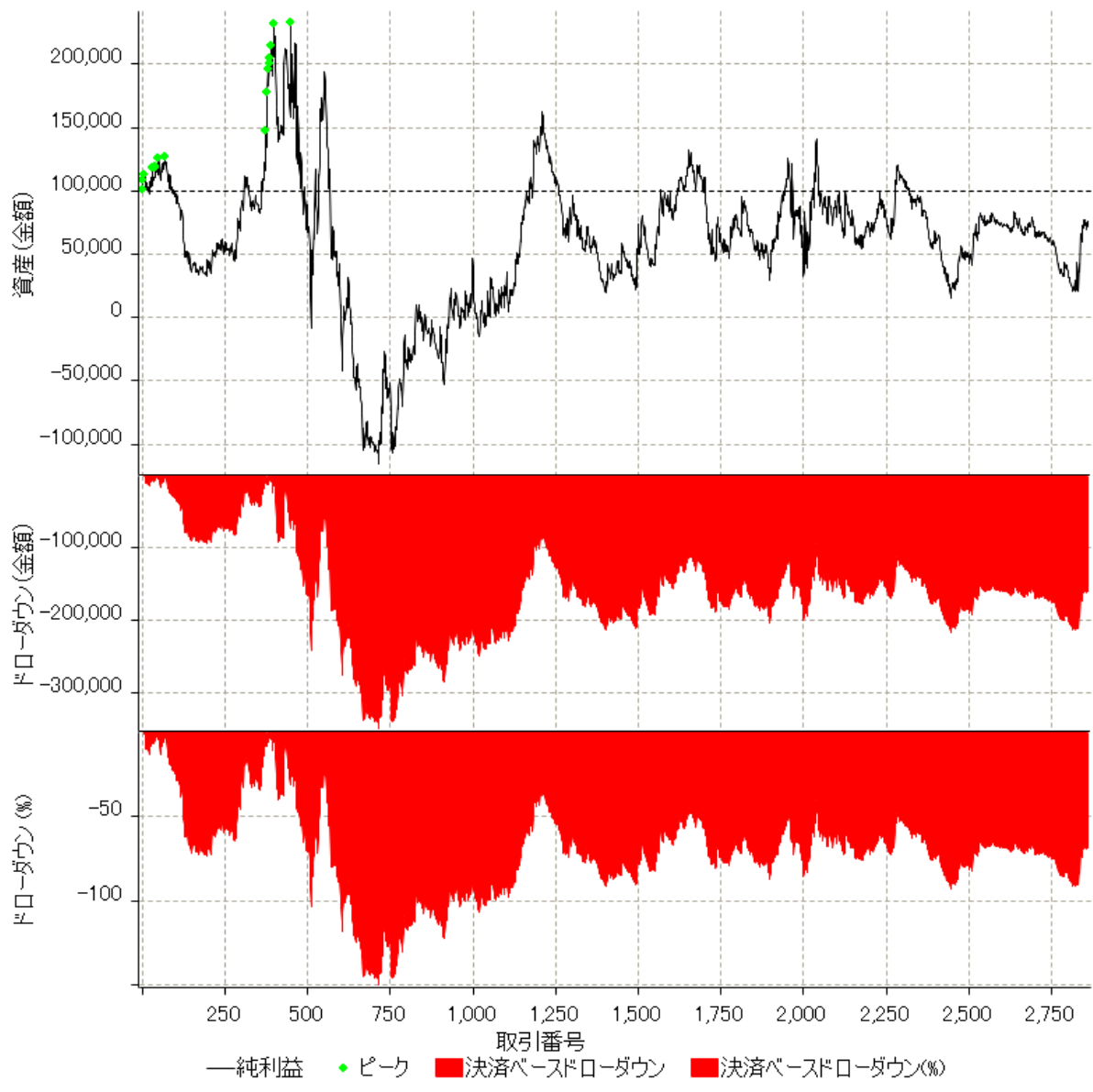
資産の含み益とドローダウン(%)



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ン



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	2860	1430	1430
オープントレードの合計数	1	1	0
勝ち取引数	1015	533	482
負け取引数	1834	894	940
% 利益	35.48951049	37.27272727	33.70629371
平均取引(勝ち及び負け)	-9.70979021	-53.23776224	33.81818182
平均勝ち取引	5190.019704	4886.941839	5525.165975
平均負け取引	-2887.480916	-2998.736018	-2781.670213
平均勝ち/負け比率	1.797421301	1.629667236	1.986276428
最大勝ち取引	73940	46100	73940
最大負け取引	-46200	-38200	-46200
取引における平均バー数	7.3	7.6	7.1
勝ち取引の平均バー数	11.4	11.7	11.1
負け取引の平均バー数	5.1	5.2	5
取引間の平均バー数	6.8	7	6.8
勝ち取引間の平均バー数	6.7	22.8	27
負け取引間の平均バー数	4.9	15.4	14.6

異常値

	全て	プラス	マイナス
1 Std. Deviation of Avg. Trade	6380.234016	7165.686245	3439.553613
平均取引+1標準偏差	6370.524226	12355.70595	552.072697
平均取引-1標準偏差	-6389.943806	-1975.666541	-6327.034529
異常値の数	272	104	168
異常値の損益	455100	2289470	-1834370

含み益/ドロウダウン

	含み益	ドロウダウン
最大値	106640	-48540
最大値の日付	2008/10/6	2008/11/13
平均値	4728.14051	-3397.759525
最大値 (%)	13.23483181	-8.00990099
最大値 (%) の日付	2008/10/23	2008/11/13
平均値 (%)	0.624279679	-0.451491727
1標準偏差	7036.148171	3663.615812
平均取引+1標準偏差	11764.28868	265.8562873
平均取引-1標準偏差	-2308.007661	-7061.375337

取引の連続解析

Z値	1.590412467
信頼度	0.888258215
ストラテジーME	-9.70979021
最大連続勝ち取引	6
最大連続負け取引	19
最大連続利益	73940
最大連続損失	-95680
最大連続利益(%)	12280.76923
最大連続損失(%)	-1231.944444

3年の期間で
2800回を超える
短期売買型

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	439	5300.569476	-2658.610478
	2	164	5184.695122	-2649.695122
	3	47	5253.617021	-2042.553191
	4	16	4902.5	-2755.625
	5	5	3443.2	-2290
	6	3	5541.111111	-2316.666667
連続損失	連続数	連続数あたりの平均損失	次のトレードの平均利益	
	1	237	-2709.662447	4920.675105
	2	172	-2498.982558	5024.94186
	3	98	-2691.122449	4637.040816
	4	64	-2791.09375	5168.75
	5	40	-3933.65	8901
	6	24	-2686.111111	5070.416667
	7	13	-2897.912088	8326.153846
	8	9	-4831.944444	12291.11111
	9	9	-2104.567901	2688.888889
	10	2	-1693	365
	11	2	-4554.090909	8015
	12	1	-1680.833333	5080
	13	2	-4449.615385	9065
	16	1	-1880.625	1520
	19	1	-1709.473684	2460

◆ディスクレームー◆

※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。