

## ストラテジーの運用成績サマリー

GBPJPY 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 : Model1

	全取引	ロング取引	ショート取引
純利益	1131380	290380	841000
総利益	4080180	1829420	2250760
総損失	-2948800	-1539040	-1409760
調整純利益	712937.3466	8399.903831	530961.106
調整総利益	3820037.225	1665133.234	2046985.764
調整総損失	-3107099.878	-1656733.33	-1516024.658
選択した純利益	464190	229360	234830
選択した総利益	2330200	1135150	1195050
選択した総損失	-1866010	-905790	-960220
必要金額	256620	239820	110750
口座のリターン	44087.75622	12108.24785	75936.79458
初期資金に対するリターン	1131.38	290.38	841
ストラテジーにおける最大ドローダウン	-318470	-258890	-159920
ストラテジーにおける最大ドローダウン(%)	-96.72490679	-100.242747	-95.99362804
決済ベースの最大ドローダウン	-256620	-239820	-110750
決済ベースの最大ドローダウン(%)	-93.83483668	-94.00823701	-91.52
ストラテジーの最大ドローダウンにおけるリターン	3.552548121	1.121634671	5.25887944
利益要因	1.383674715	1.188676058	1.596555442
調整利益要因	1.229454274	1.00507016	1.3502325
選択した利益要因	1.248760725	1.253215425	1.244558539
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	-190 n/a		-190
年間リターン率	382.1399098	98.29971346	284.0598775
月間リターン率	31.84499249	8.191642788	23.67165646
バイ&ホールドのリターン	-35242.52241	-35039.81288	-35242.52241
平均月次リターン	31421.94444		
月次リターン標準偏差	104334.6646		

## 運用成績比率

アップサイド潜在レシオ	19.51352715
シャープレシオ	0.196901436
ソルティノレシオ	1.770914862
フォースレシオ	0.230266902
カルマーレシオ	0.000497141
スターリングレシオ	0.001774077
純利益 / 最大損失	-2021.04323
純利益 / 取引の最大ドローダウン	-1917.59322
純利益 / ストラテジーの最大ドローダウン	-355.2548121
選択した純利益 / 最大損失	-829.2068596
選択した純利益 / 取引の最大ドローダウン	-786.7627119
選択した純利益 / ストラテジーの最大ドローダウン	-145.7562722
調整純利益 / 最大損失	-1273.557246
調整純利益 / 取引の最大ドローダウン	-1208.368384
調整純利益 / ストラテジーの最大ドローダウン	-223.863267

3年間  
でなんと  
1,100%  
もプラス

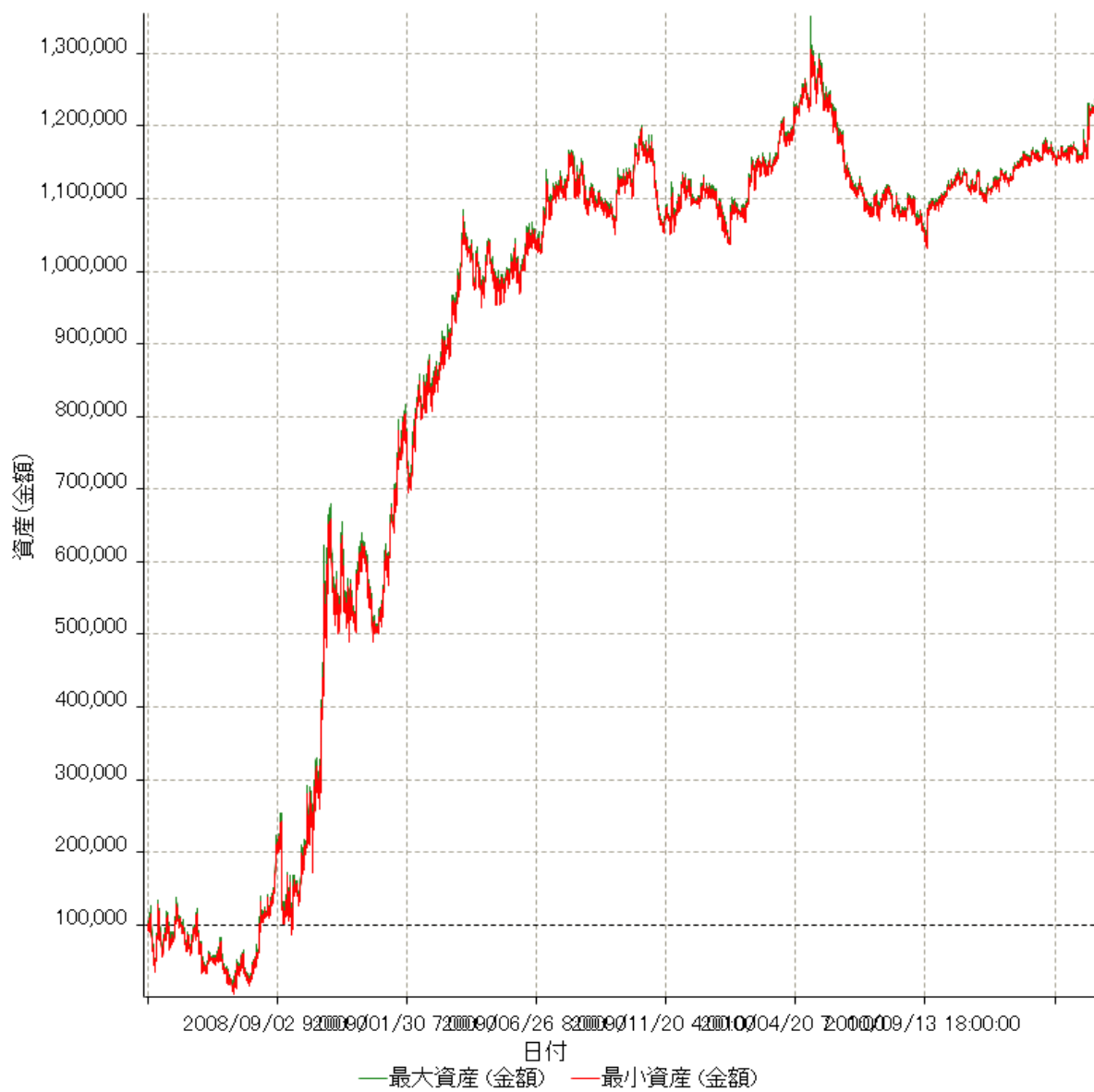
一目均衡表を利用した  
弊社オリジナル!!  
推奨資金  
300,000円  
以上

## 時間解析

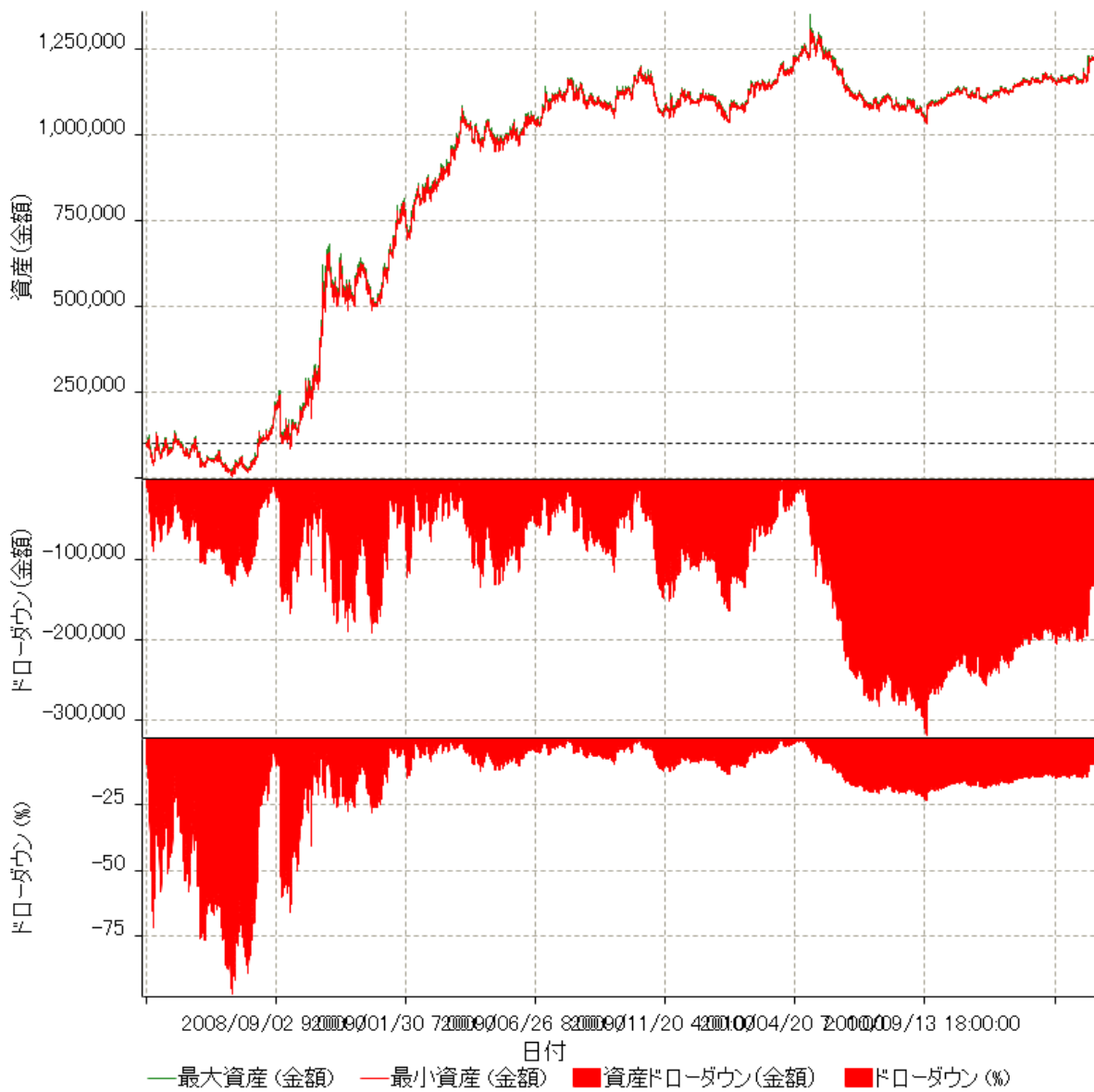
取引期間	2 Yrs, 11 Mths, 23 Dys, 9 Hrs
市場における(実行)時間	2 Yrs, 6 Mths, 21 Dys, 17 Hrs
市場における比率	85.97464648
最長のポジションなし期間	14 Dys, 12 Hrs
最大含み益の日付	2008/10/24
最大ドローダウンの日付	2008/11/3
ストラテジー中の最大ドローダウンの日付	2010/9/14 22:00
決済ベースの最大ドローダウンの日付	2010/9/14 13:00

100,000円  
スタートで  
計算すると、  
1,231,380円になる  
計算

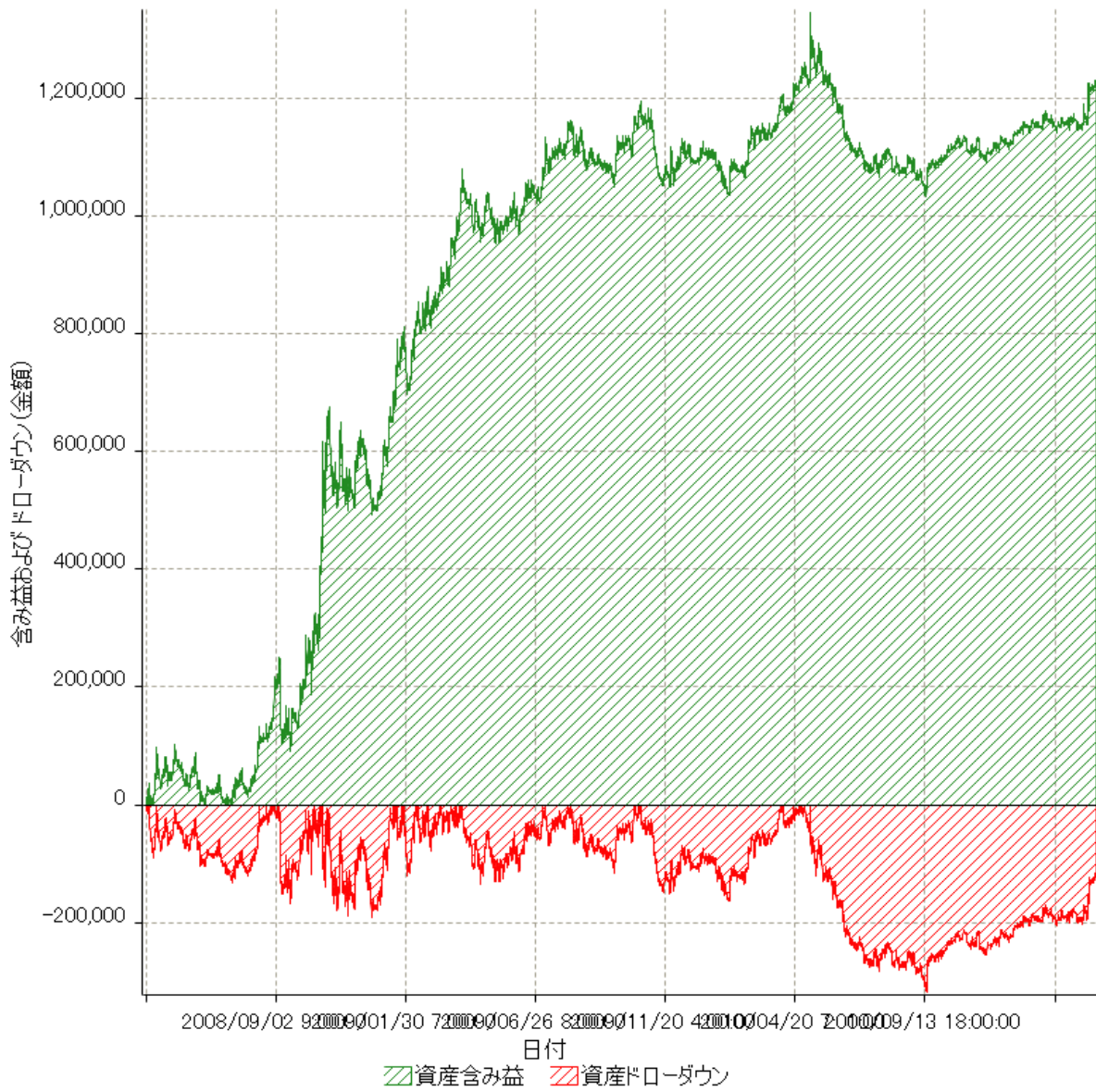
## 詳細にわたる資産曲線



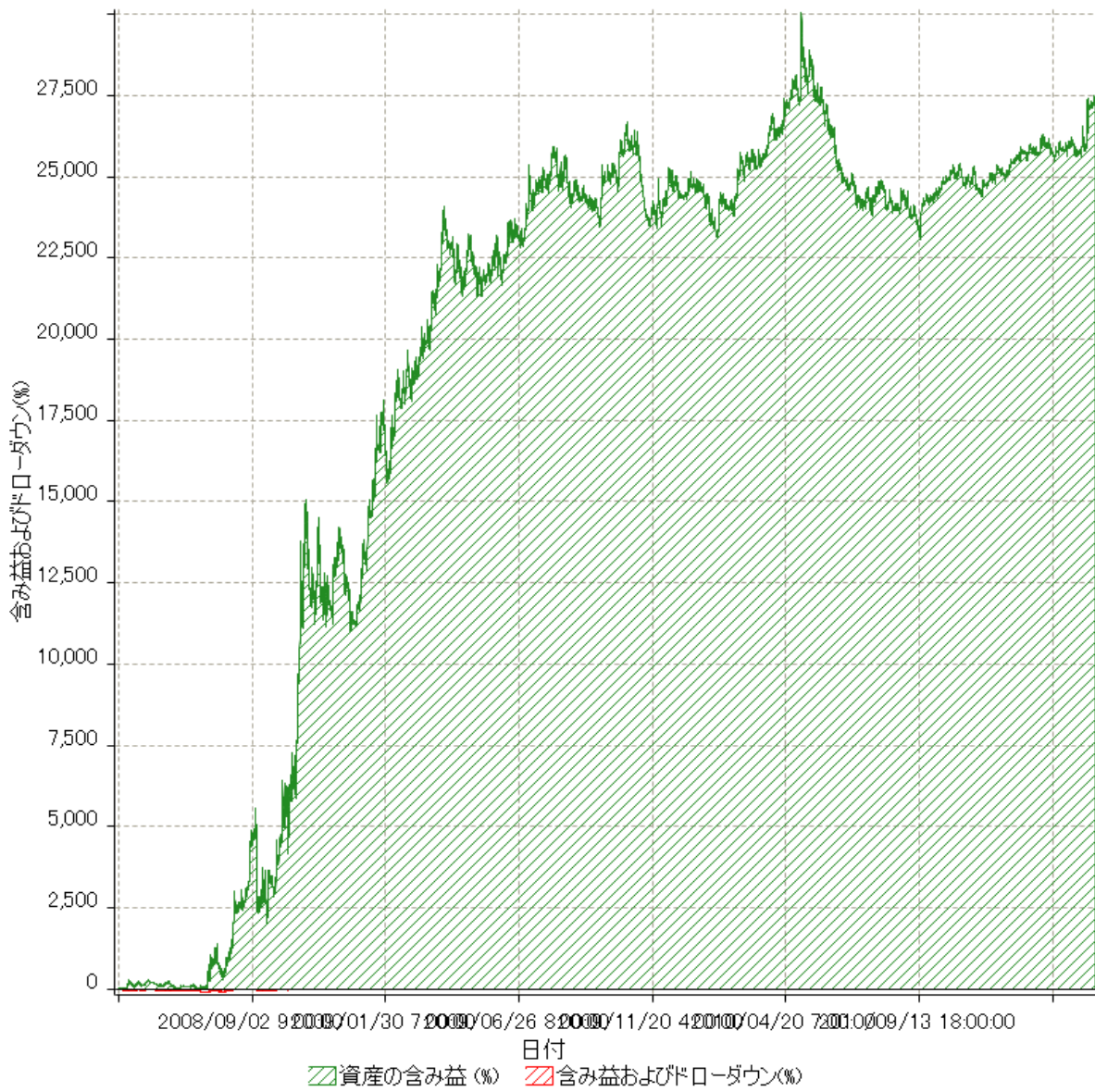
### ドロダウンの詳細入り資産曲線



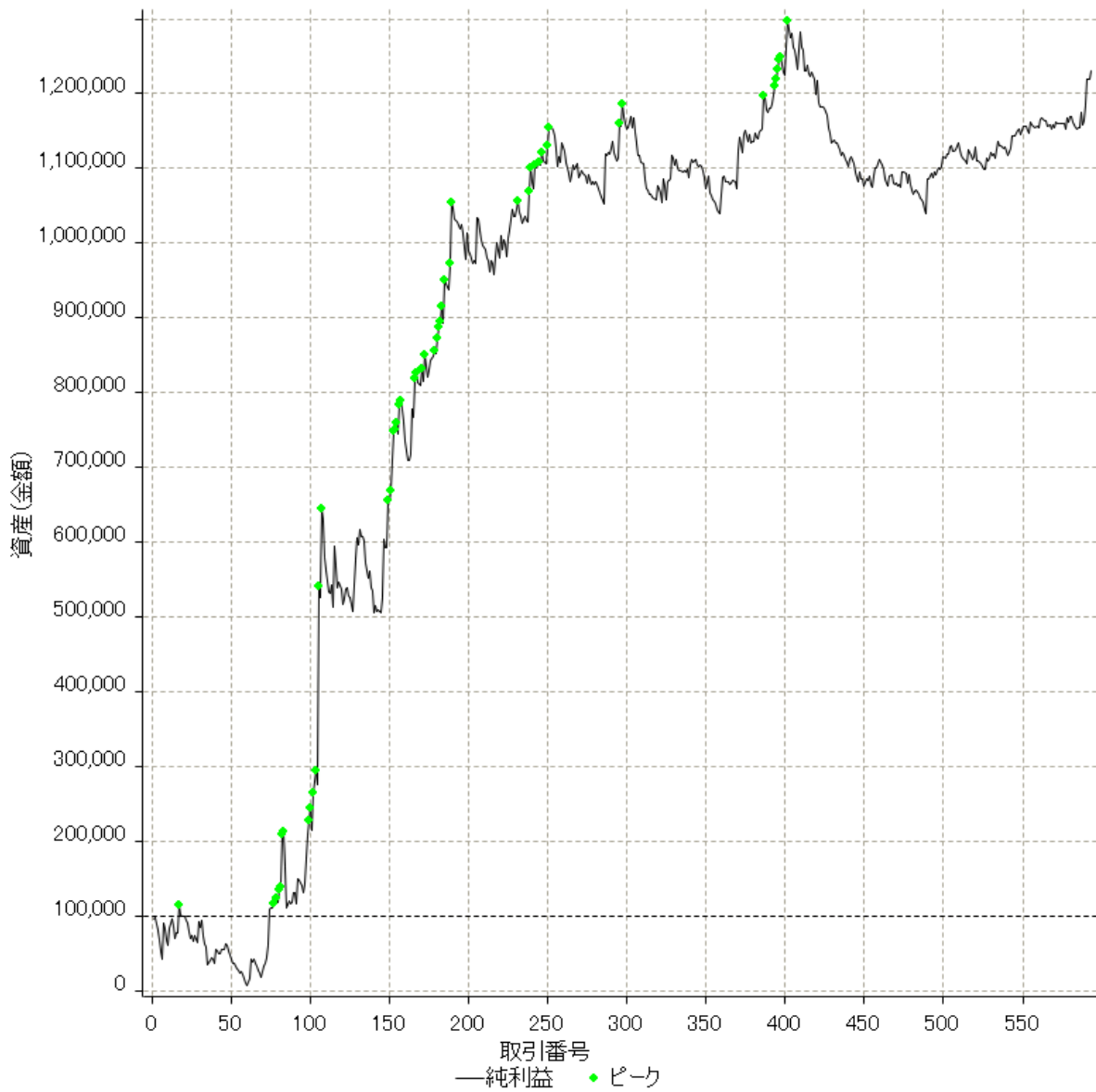
# 資産の含み益とドロウダウン



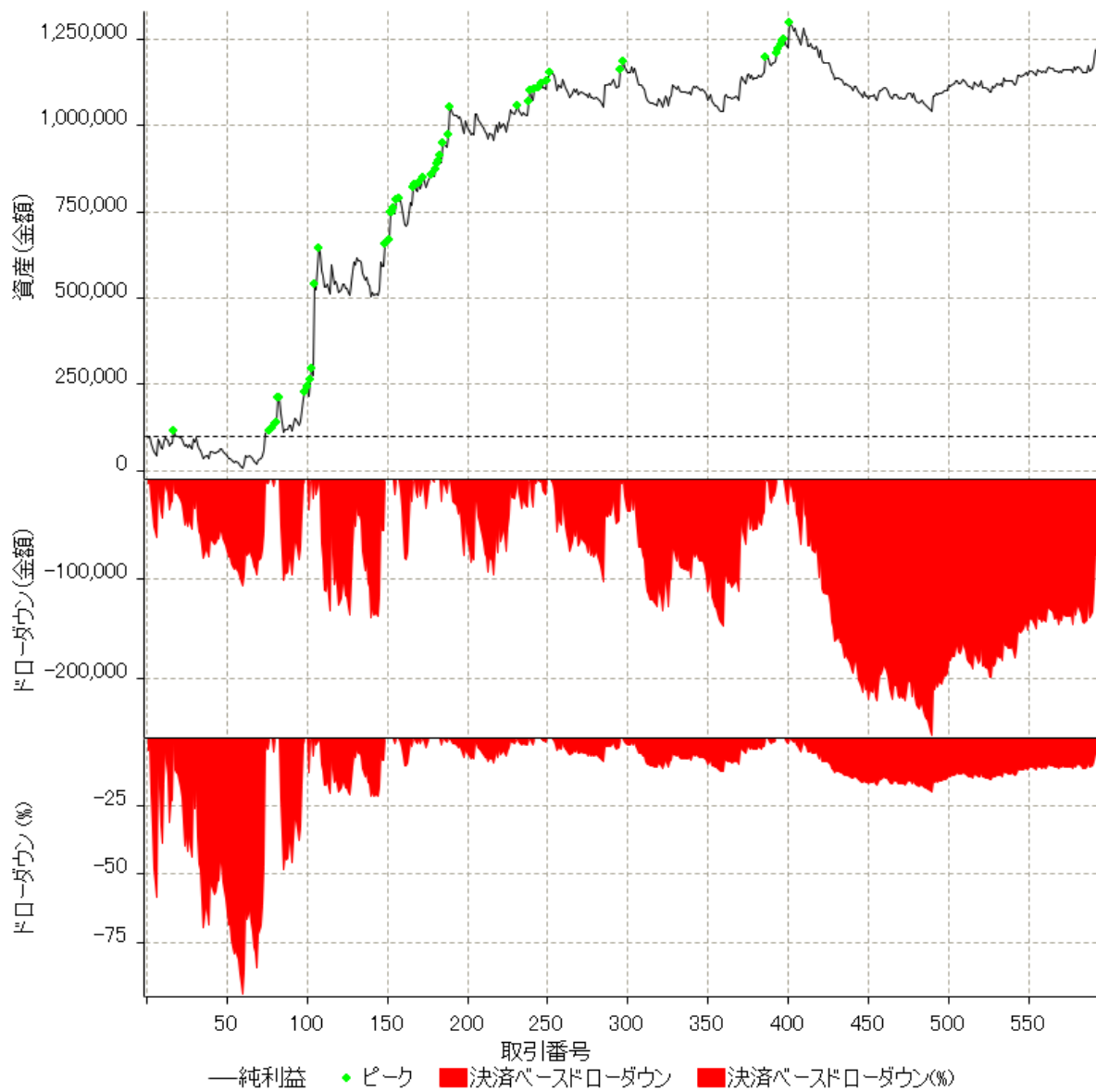
# 資産の含み益とドロールドウン(%)



# 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	593	295	298
オープントレードの合計数	1	0	1
勝ち取引数	246	124	122
負け取引数	347	171	176
% 利益	41.48397976	42.03389831	40.93959732
平均取引(勝ち及び負け)	1907.892074	984.3389831	2822.147651
平均勝ち取引	16586.09756	14753.3871	18448.85246
平均負け取引	-8497.982709	-9000.233918	-8010
平均勝ち/負け比率	1.951768806	1.639222628	2.303227523
最大勝ち取引	265200	118690	265200
最大負け取引	-55980	-55980	-45780
取引における平均バー数	27.3	27.6	27
勝ち取引の平均バー数	40.9	41.2	40.5
負け取引の平均バー数	17.7	17.8	17.7
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	34.6	108.4	111.6
負け取引間の平均バー数	35.8	90.7	87.8

## 異常値

	全て	プラス	マイナス
1 Std. Deviation of Avg. Trade	20825.73028	24369.44248	7731.829265
平均取引+1標準偏差	22733.62235	40955.54004	-766.1534441
平均取引-1標準偏差	-18917.83821	-7783.344918	-16229.81197
異常値の数	71	25	46
異常値の損益	667190	1749980	-1082790

## 含み益/ドロウダウン

	含み益	ドロウダウン
最大値	347680	-59000
最大値の日付	2008/10/24	2008/11/3
平均値	17175.72391	-9355.37037
最大値 (%)	19.97609855	-3.714127795
最大値 (%) の日付	2008/10/20	2008/12/11
平均値 (%)	1.143726965	-0.626649729
1標準偏差	24800.86432	8563.571595
平均取引+1標準偏差	41976.58823	-791.7987754
平均取引-1標準偏差	-7625.140415	-17918.94197

## 取引の連続解析

Z値	0.643513367
信頼度	0.480109454
ストラテジーME	1907.892074
最大連続勝ち取引	8
最大連続負け取引	14
最大連続利益	265200
最大連続損失	-112390
最大連続利益(%)	519.5299384
最大連続損失(%)	-71.73825773

1日あたり  
0.8回と  
堅実な  
取引

一目均衡表  
の三役での  
シグナルを狙った  
戦略を採用!!

## 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	88	19090
	2	41	16985.73171
	3	8	12132.08333
	4	7	12934.64286
	5	2	18675
	6	1	15473.33333
	8	1	9312.5
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	66	-8013.333333
	2	36	-9241.805556
	3	16	-8606.041667
	4	13	-7929.038462
	5	9	-10620
	6	3	-5159.444444
	7	1	-6470
	8	2	-7656.875
	9	1	-9091.111111
	14	1	-7765.714286

### ◆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。