

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 : STBreakout

	全取引	ロング取引	ショート取引
純利益	802190	53340	748850
総利益	4627420	1858690	2768730
総損失	-3825230	-1805350	-2019880
調整純利益	350492.0219	-222238.2705	386661.9902
調整総利益	4348882.048	1697521.137	2537197.166
調整総損失	-3998390.026	-1919759.408	-2150535.176
選択した純利益	162600	7760	154840
選択した総利益	2795920	1311080	1484840
選択した総損失	-2633320	-1303320	-1330000
必要金額	370690	384220	207490
口座のリターン	21640.45429	1388.267139	36090.89595
初期資金に対するリターン	802.19	53.34	748.85
ストラテジーにおける最大ドローダウン	-422840	-394670	-259990
ストラテジーにおける最大ドローダウン(%)	-64.98032948	-188.0813953	-76.63148337
決済ベースの最大ドローダウン	-370690	-384220	-207490
決済ベースの最大ドローダウン(%)	-61.92926475	-191.8701623	-72.03341561
ストラテジーの最大ドローダウンにおけるリターン	1.897147857	0.135150886	2.880303089
利益要因	1.209710266	1.029545517	1.370739846
調整利益要因	1.087658287	-0.884236395	1.179798031
選択した利益要因	1.061747148	1.005954025	1.116421053
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	18860 n/a		18860
年間リターン率	270.9408006	18.0330302	252.9251406
月間リターン率	22.57840005	1.502752516	21.07709505
バイ&ホールドのリターン	-35370.45473	-35486.40594	-35370.45473
平均月次リターン	22806.94444		
月次リターン標準偏差	113094.1627		

運用成績比率

アップサイド潜在レシオ	9.372239039
シャープレシオ	0.249586478
ソルティノレシオ	0.758892433
フォースレシオ	0.040818595
カルマーレシオ	0.000591302
スターリングレシオ	0.001756581
純利益 / 最大損失	-1442.528322
純利益 / 取引の最大ドローダウン	-1442.528322
純利益 / ストラテジーの最大ドローダウン	-189.7147857
選択した純利益 / 最大損失	-292.3934544
選択した純利益 / 取引の最大ドローダウン	-292.3934544
選択した純利益 / ストラテジーの最大ドローダウン	-38.45426166
調整純利益 / 最大損失	-630.2679769
調整純利益 / 取引の最大ドローダウン	-630.2679769
調整純利益 / ストラテジーの最大ドローダウン	-82.88998721

3年の期間
でおよそ
800%
のプラス

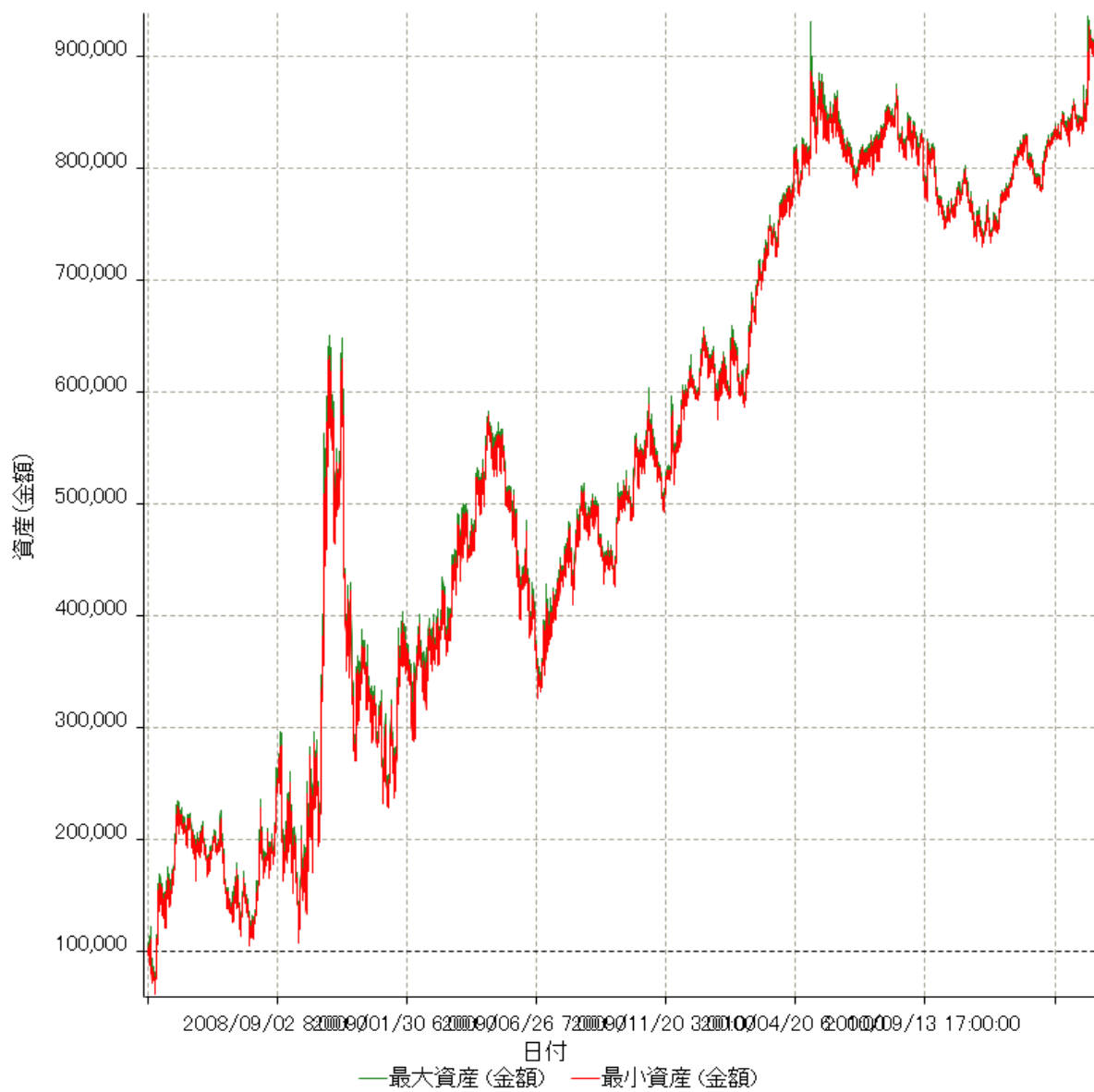
推奨資金
200,000円
以上

時間解析

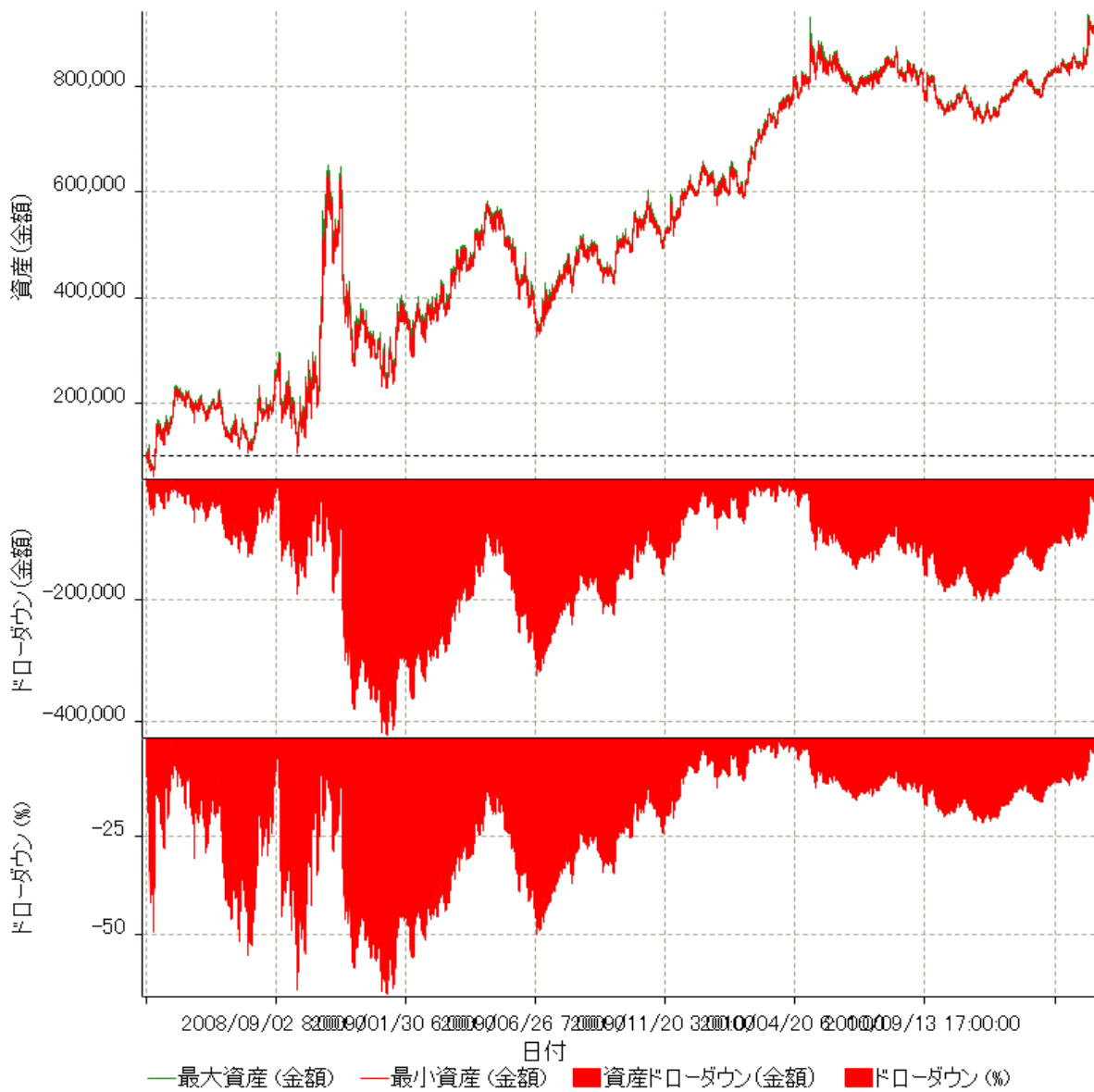
取引期間	2 Yrs, 11 Mths, 23 Dys, 10 Hrs
市場における(実行)時間	2 Yrs, 11 Mths, 20 Dys, 18 Hrs
市場における比率	99.75340988
最長のポジションなし期間	14 Dys, 11 Hrs
最大含み益の日付	2008/10/24
最大ドローダウンの日付	2008/11/17
ストラテジー中の最大ドローダウンの日付	2009/1/9 10:00
決済ベースの最大ドローダウンの日付	2009/1/9 10:00

100,000円
スタートで計算すると、
902,190円
になる計算

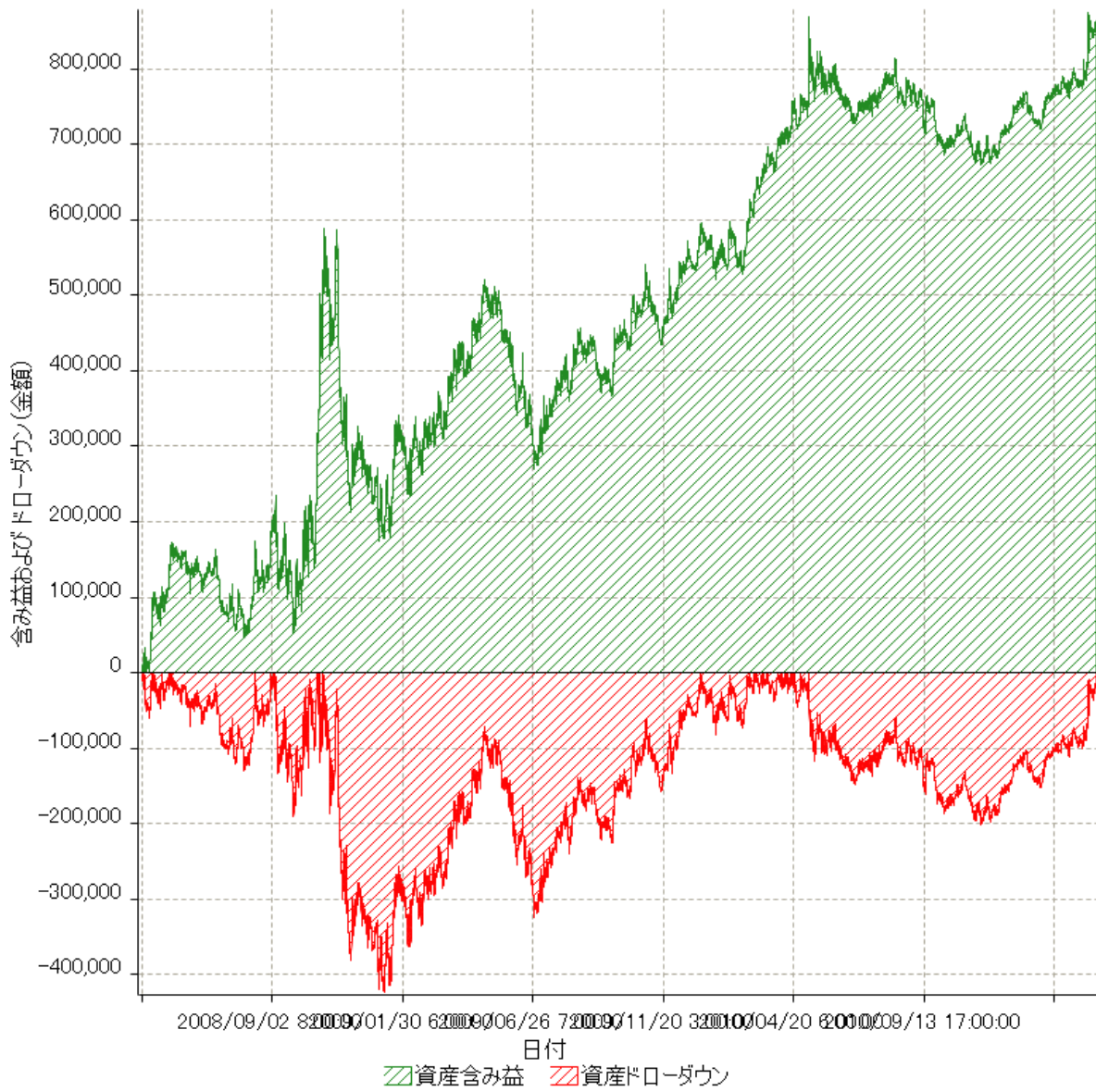
詳細にわたる資産曲線



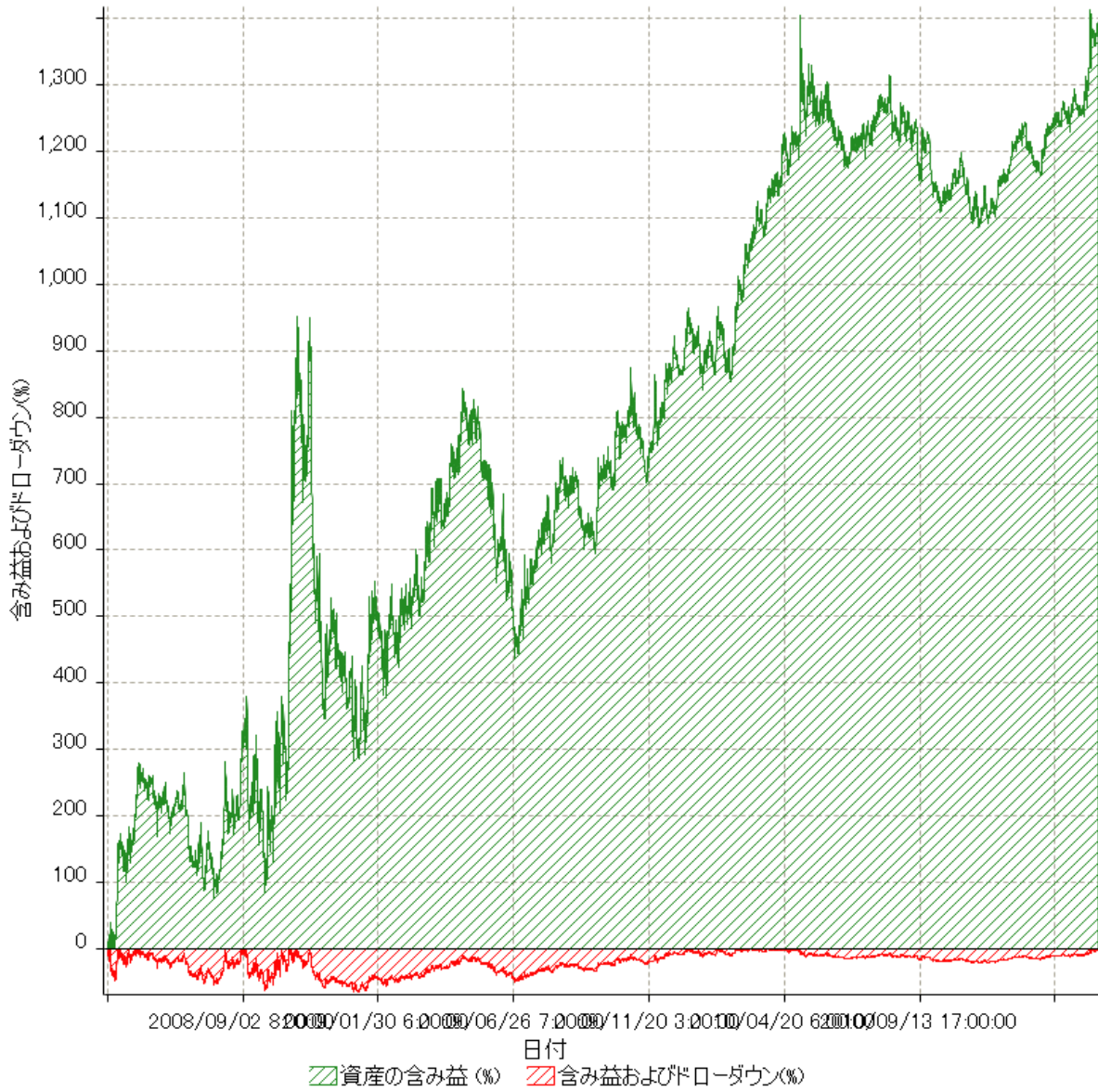
ドロダウの詳細入り資産曲線



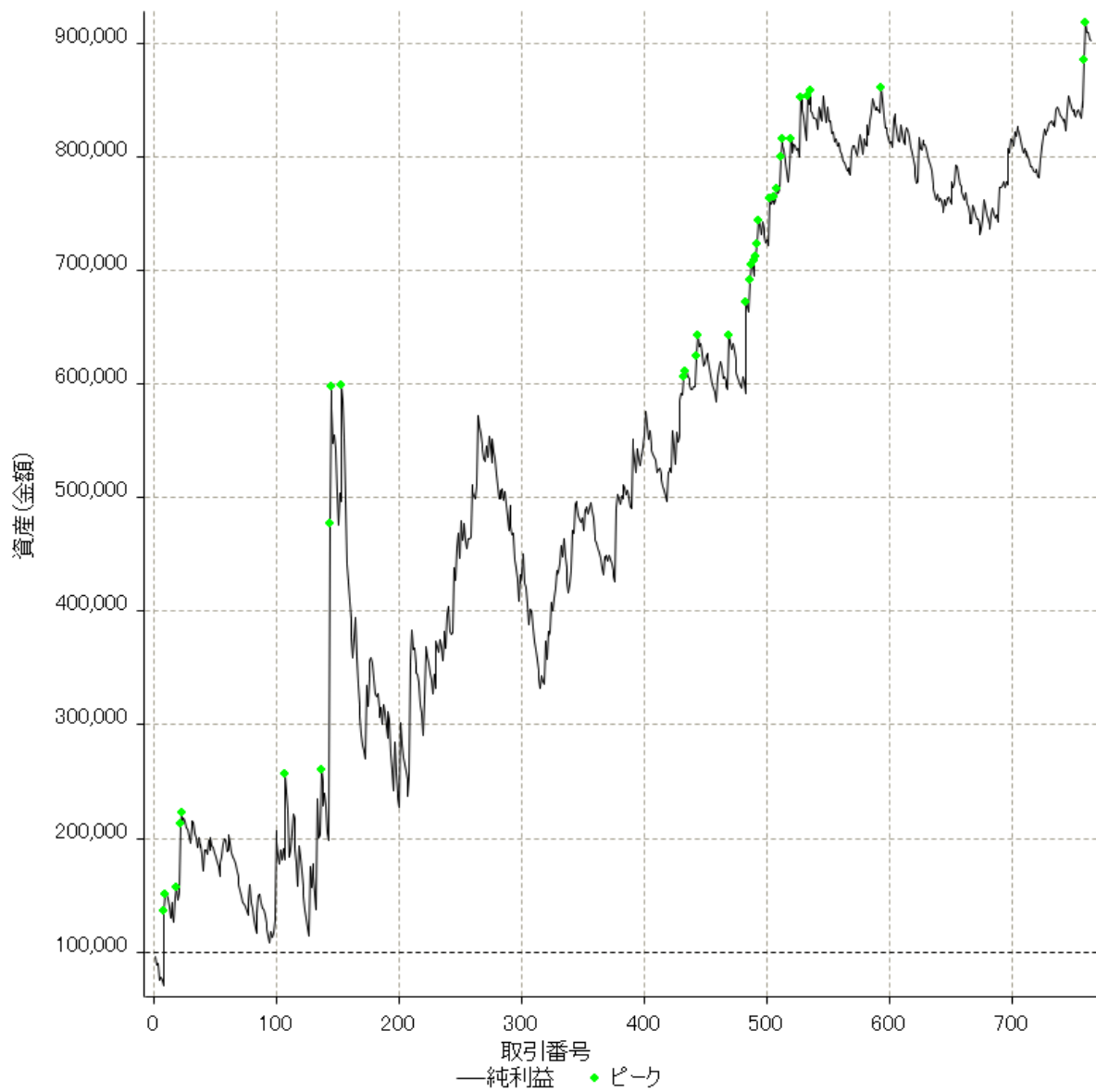
資産の含み益とドロウダウン



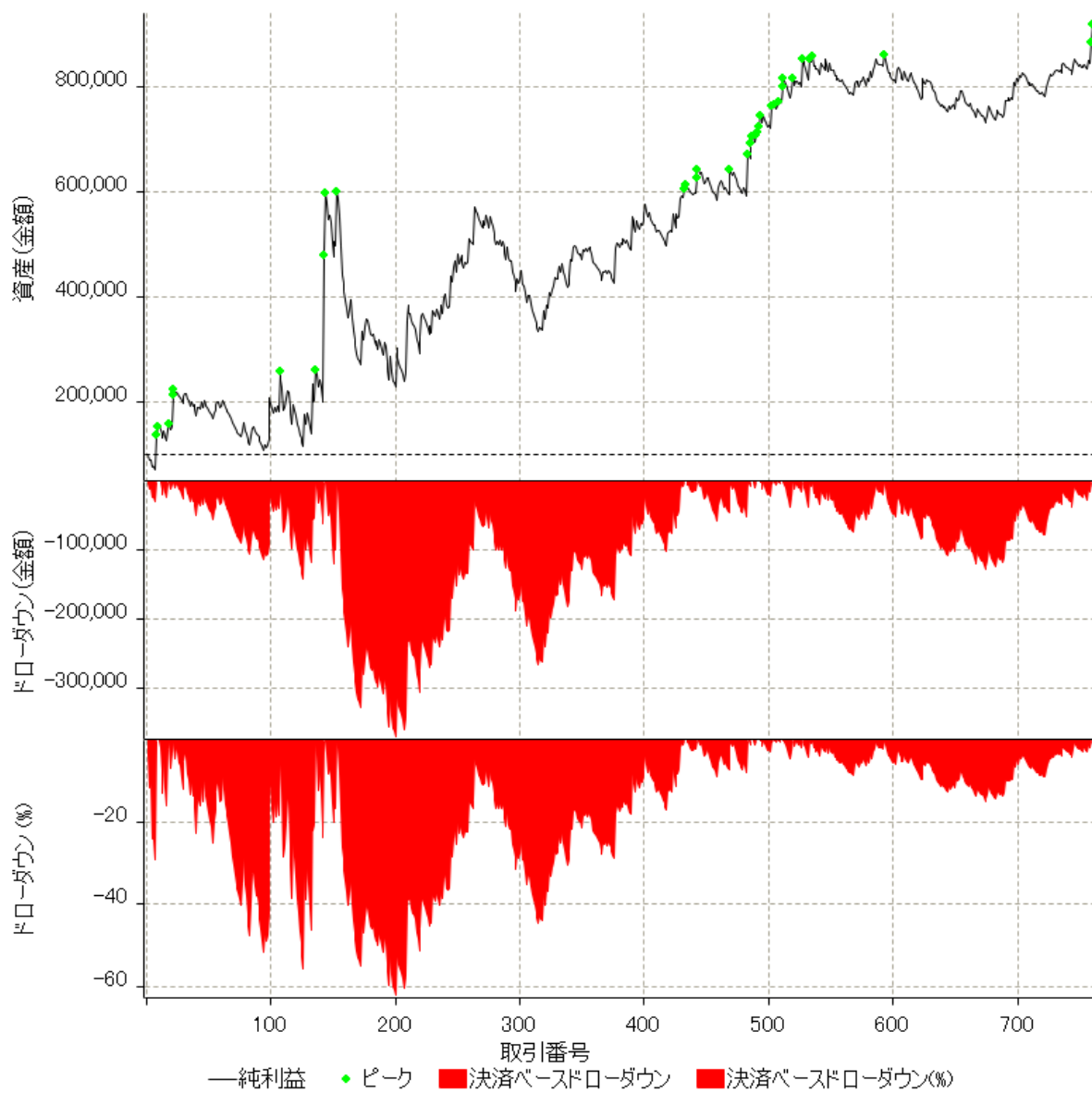
資産の含み益とドロダウン(%)



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	764	382	382
オープントレードの合計数	1	0	1
勝ち取引数	276	133	143
負け取引数	488	249	239
% 利益	36.12565445	34.81675393	37.43455497
平均取引(勝ち及び負け)	1049.986911	139.6335079	1960.340314
平均勝ち取引	16766.01449	13975.11278	19361.74825
平均負け取引	-7838.586066	-7250.401606	-8451.380753
平均勝ち/負け比率	2.138908006	1.927494991	2.290956805
最大勝ち取引	279620	119660	279620
最大負け取引	-55610	-54930	-55610
取引における平均バー数	24.9	19.2	30.5
勝ち取引の平均バー数	44.2	34.8	53
負け取引の平均バー数	13.9	10.9	17.1
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	23	104.7	76.8
負け取引間の平均バー数	24.1	63.6	60.5

異常値

	全て	プラス	マイナス
1 Std. Deviation of Avg. Trade	19714.81447	24726.40082	6675.078528
平均取引+1標準偏差	20764.80138	41492.41531	-1163.507537
平均取引-1標準偏差	-18664.82756	-7960.386327	-14513.66459
異常値の数	78	24	54
異常値の損益	639590	1831500	-1191910

含み益/ドロウダウン

	含み益	ドロウダウン
最大値	365330	-55610
最大値の日付	2008/10/24	2008/11/17
平均値	16142.23529	-7201.555556
最大値 (%)	20.77946454	-3.955895429
最大値 (%) の日付	2008/10/20	2008/11/16
平均値 (%)	1.069897552	-0.478699118
1標準偏差	24227.72671	6467.363601
平均取引+1標準偏差	40369.96201	-734.1919545
平均取引-1標準偏差	-8085.49142	-13668.91916

取引の連続解析

Z値	0.620852246
信頼度	0.465303652
ストラテジーME	1049.986911
最大連続勝ち取引	5
最大連続負け取引	15
最大連続利益	399280
最大連続損失	-239780
最大連続利益(%)	201.6260163
最大連続損失(%)	-41.02272727

3年の期間
でおよそ
760回もの
取引

損小利大の
パターン

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	116	17003.87931
	2	40	19051.5
	3	18	16909.81481
	4	4	10696.875
	5	2	4657
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	71	-7508.873239
	2	47	-7121.489362
	3	19	-8947.192982
	4	11	-10817.72727
	5	11	-6344.545455
	6	7	-5421.428571
	7	6	-6481.428571
	8	5	-9120.5
	9	2	-16079.44444
	10	1	-6343
	15	1	-4677.333333

◆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。