

## ストラテジーの運用成績サマリー

USDJPY 5分足 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 : AfterHoursTrader

	全取引	ロング取引	ショート取引
純利益	58970	35540	23430
総利益	95060	52500	42560
総損失	-36090	-16960	-19130
調整純利益	38785.27181	21577.97098	8693.039215
調整総利益	82242.11221	43070.72164	33872.47638
調整総損失	-43456.8404	-21492.75066	-25179.43716
選択した純利益	36180	19940	16240
選択した総利益	55370	32370	23000
選択した総損失	-19190	-12430	-6760
必要金額	8740	4530	8740
口座のリターン	67471.39588	78454.74614	26807.78032
初期資金に対するリターン	58.97	35.54	23.43
ストラテジーにおける最大ドローダウン	-30860	-30860	-21670
ストラテジーにおける最大ドローダウン(%)	-18.49454633	-22.07439199	-20.52472059
決済ベースの最大ドローダウン	-8740	-4530	-8740
決済ベースの最大ドローダウン(%)	-7.313807531	-3.662974044	-8.473097431
ストラテジーの最大ドローダウンにおけるリターン	1.910887881	1.151652625	1.081218274
利益要因	2.633970629	3.095518868	2.224777836
調整利益要因	1.892500961	2.003965073	1.345243587
選択した利益要因	2.885356957	2.604183427	3.402366864
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	n/a	n/a	n/a
年間リターン率	19.85930233	11.96879099	8.360720922
月間リターン率	1.654941861	0.99739925	0.696726744
バイ&ホールドのリターン	-17954.5679	-17954.5679	-22132.13101
平均月次リターン	1638.055556		
月次リターン標準偏差	3699.088551		

## 運用成績比率

アップサイド潜在レシオ	n/a
シャープレシオ	0.40624351
ソルティノレシオ	1.434687154
フォースレシオ	0.013145123
カルマーレシオ	0.00625298
スターリングレシオ	0.001960059
純利益 / 最大損失	-674.7139588
純利益 / 取引の最大ドローダウン	-202.7854195
純利益 / ストラテジーの最大ドローダウン	-191.0887881
選択した純利益 / 最大損失	-413.9588101
選択した純利益 / 取引の最大ドローダウン	-124.4154058
選択した純利益 / ストラテジーの最大ドローダウン	-117.2391445
調整純利益 / 最大損失	-443.7674121
調整純利益 / 取引の最大ドローダウン	-133.3743873
調整純利益 / ストラテジーの最大ドローダウン	-125.6813733

3年の期間  
でおよそ  
58%  
のプラス

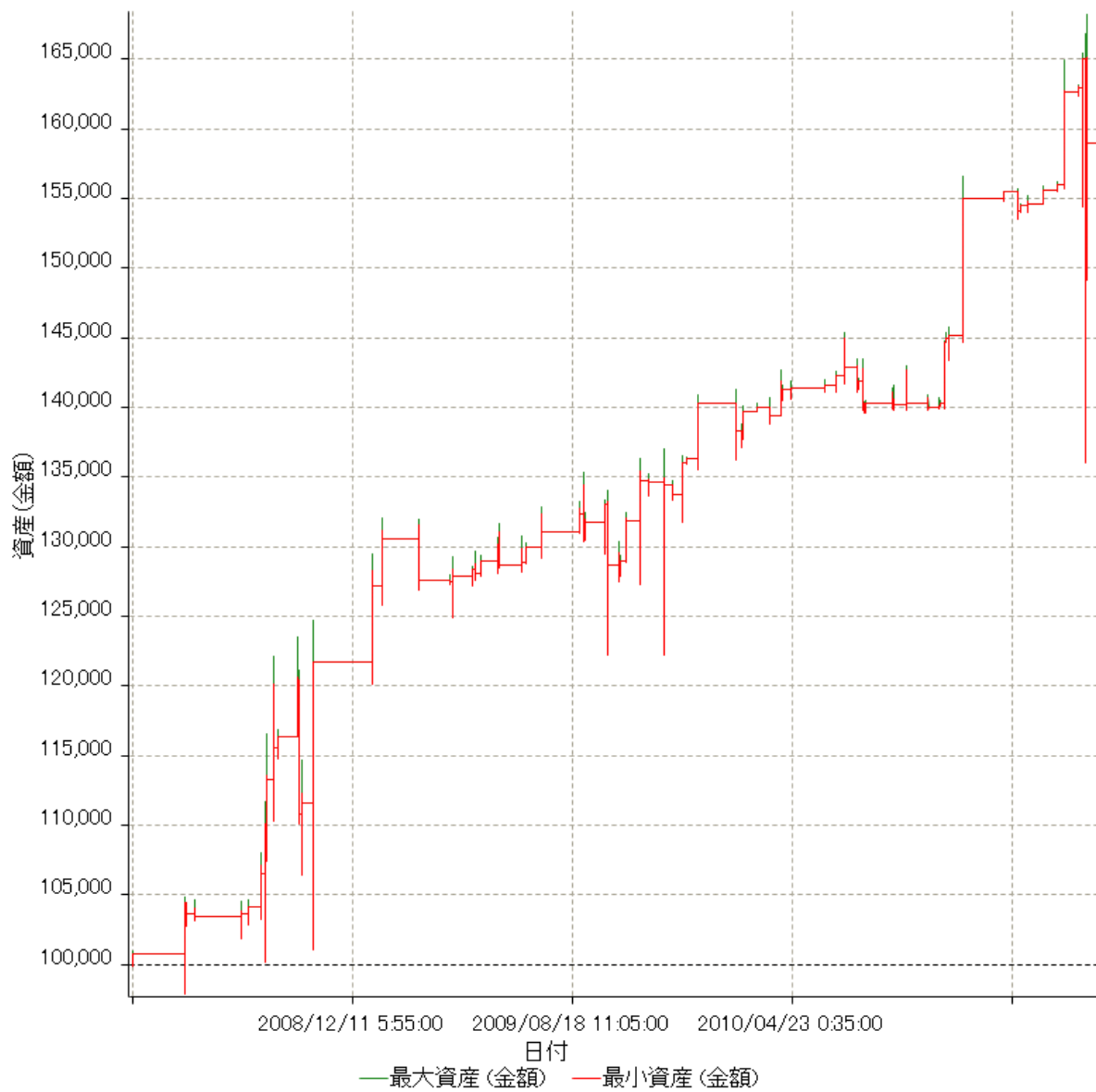
推奨資金  
100,000円  
以上

## 時間解析

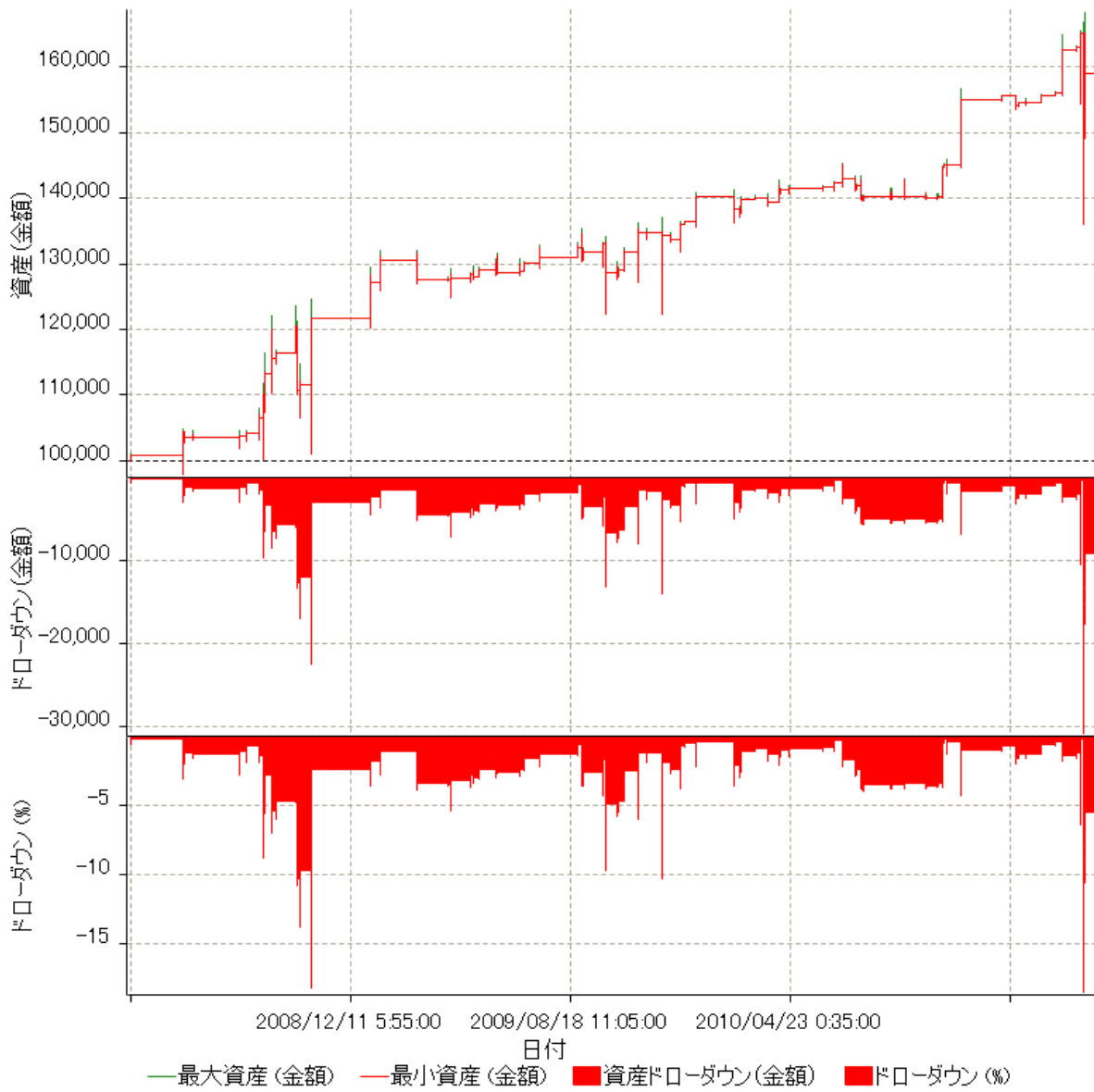
取引期間	2 Yrs, 11 Mths, 26 Dys, 13 Hrs, 40 Mins
市場における(実行)時間	4 Dys, 18 Hrs, 40 Mins
市場における比率	0.440522993
最長のポジションなし期間	2 Mths, 9 Dys, 21 Hrs, 20 Mins
最大含み益の日付	2008/10/28
最大ドローダウンの日付	2011/3/16
ストラテジー中の最大ドローダウンの日付	2011/3/16 17:25
決済ベースの最大ドローダウンの日付	2008/10/13 20:35

100,000円  
スタートで計算すると、  
158,970円  
になる計算

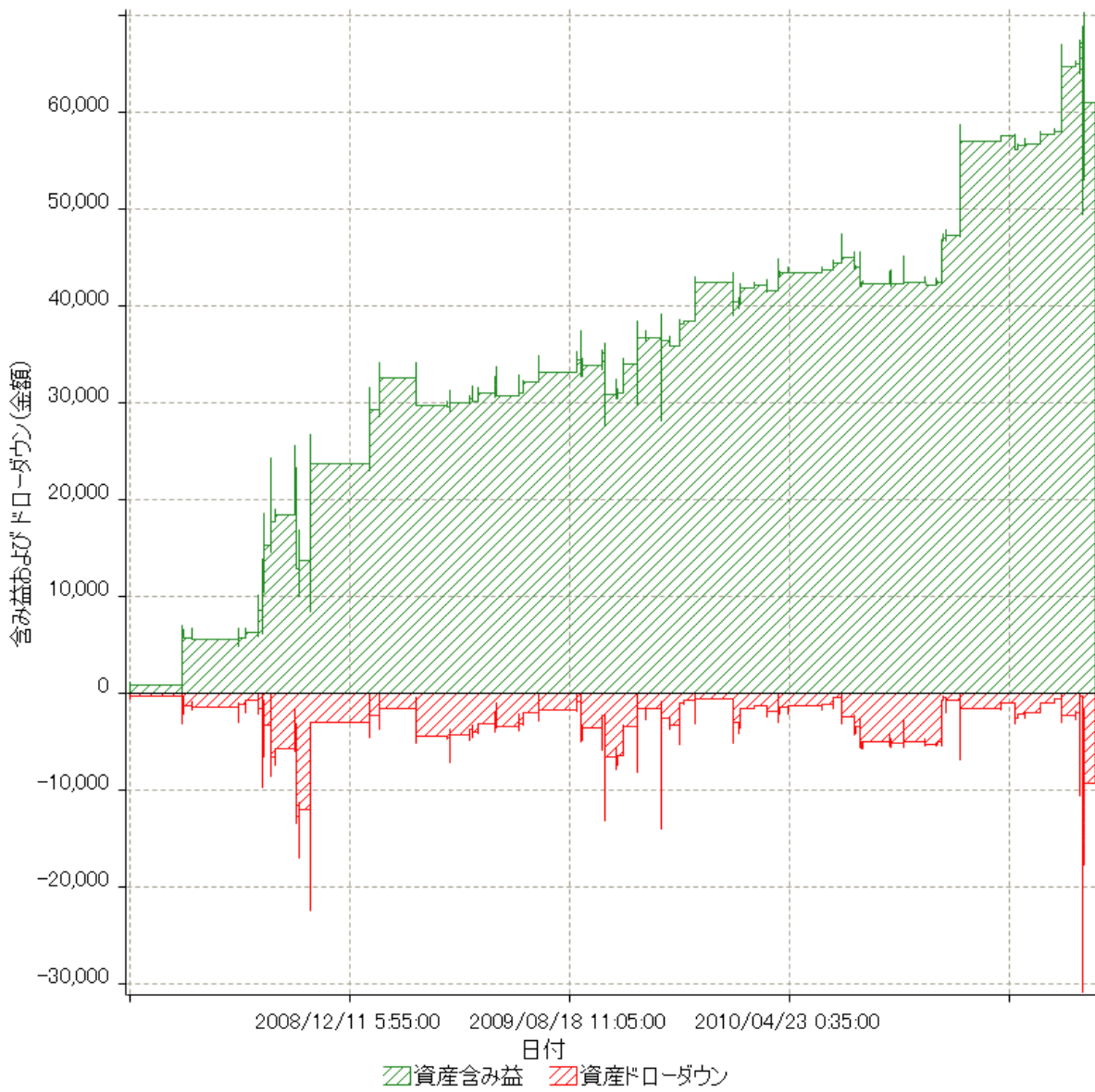
## 詳細にわたる資産曲線



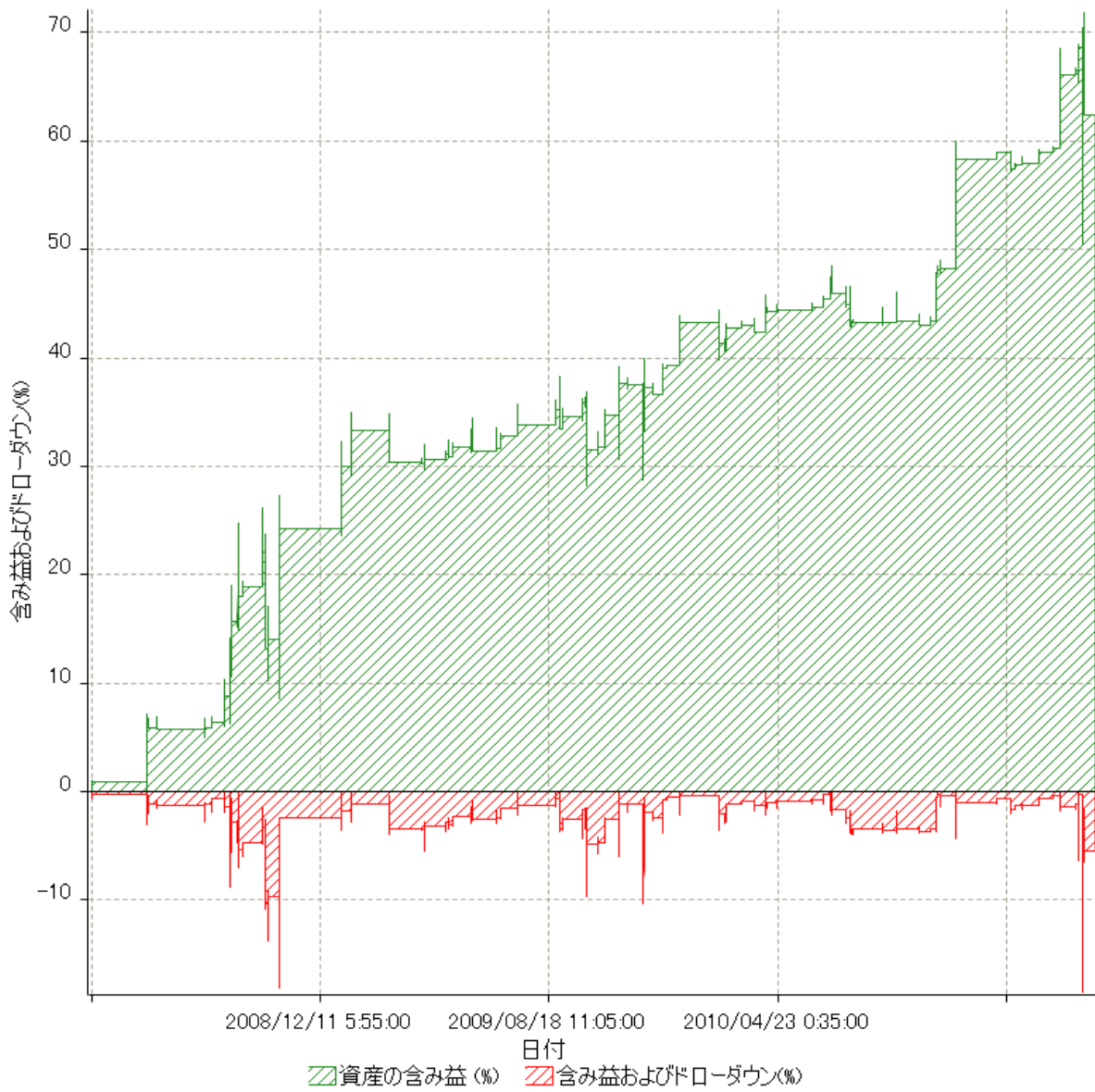
### ドローダウンの詳細入り資産曲線



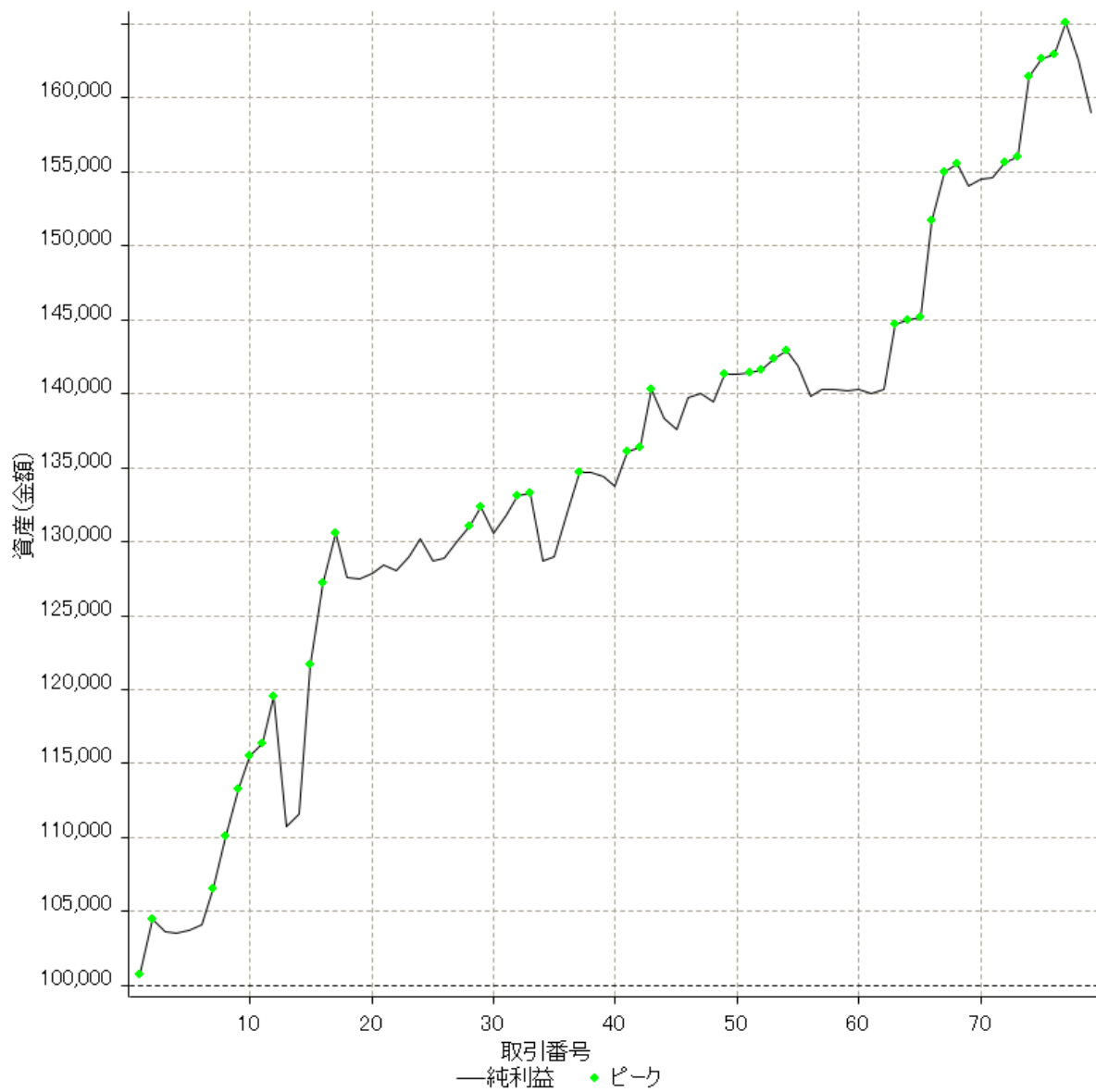
# 資産の含み益とドローダウン



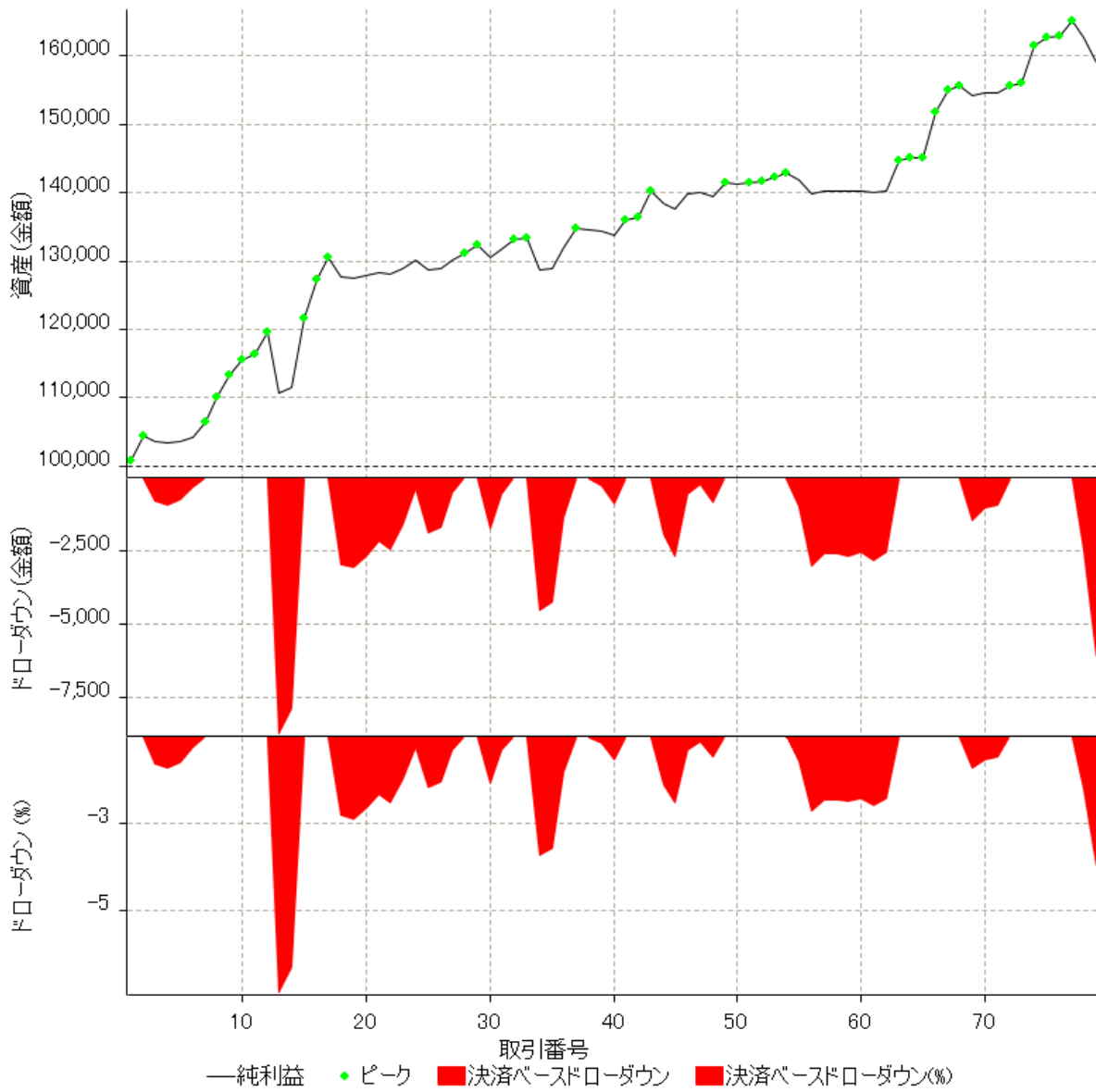
# 資産の含み益とドロウダウン(%)



# 決済ベースの資産曲線



# 決済ベースの資産曲線とドロウダウン



## 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	79	45	34
オープントレードの合計数	0	0	0
勝ち取引数	55	31	24
負け取引数	24	14	10
% 利益	69.62025316	68.88888889	70.58823529
平均取引(勝ち及び負け)	746.4556962	789.7777778	689.1176471
平均勝ち取引	1728.363636	1693.548387	1773.333333
平均負け取引	-1503.75	-1211.428571	-1913
平均勝ち/負け比率	1.149369002	1.397976263	-0.926990765
最大勝ち取引	10110	6560	10110
最大負け取引	-8740	-4530	-8740
取引における平均バー数	18.4	18.8	17.9
勝ち取引の平均バー数	18.5	19.5	17.3
負け取引の平均バー数	18.1	17.3	19.3
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	4034.1	7170.5	9270
負け取引間の平均バー数	9269.1	15903.6	22270

## 異常値

	全て	プラス	マイナス
1 Std. Deviation of Avg. Trade	2454.576071	1953.446872	1970.808293
平均取引+1標準偏差	3201.031767	3681.810508	467.0582926
平均取引-1標準偏差	-1708.120375	-225.0832352	-3474.558293
異常値の数	10	7	3
異常値の損益	22790	39690	-16900

## 含み益/ドローダウン

	含み益	ドローダウン
最大値	13110	-29080
最大値の日付	2008/10/28	2011/3/16
平均値	2359.873418	-2135.56962
最大値 (%)	1.424497877	-3.663899003
最大値 (%) の日付	2010/10/31	2011/3/16
平均値 (%)	0.255728593	-0.237244525
1標準偏差	2507.250764	4033.634471
平均取引+1標準偏差	4867.124182	1898.06485
平均取引-1標準偏差	-147.3773464	-6169.204091

## 取引の連続解析

Z値	-0.51458033
信頼度	0.393154142
ストラテジーME	746.4556962
最大連続勝ち取引	8
最大連続負け取引	3
最大連続利益	19800
最大連続損失	-8740
最大連続利益(%)	17.87648971
最大連続損失(%)	-7.313807531

3年間の  
取引回数  
は80回  
未満

勝ち取引  
>  
負け  
取引数

## 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	3	820	-113.3333333
	2	4	1235	-810
	3	3	1682.222222	-2163.333333
	4	3	2091.666667	-1913.333333
	7	1	2214.285714	-1450
	8	2	1686.25	-5610
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	9	-2135.555556	675.5555556
	2	6	-1329.166667	538.3333333
	3	1	-306.6666667	2290

### ◆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。