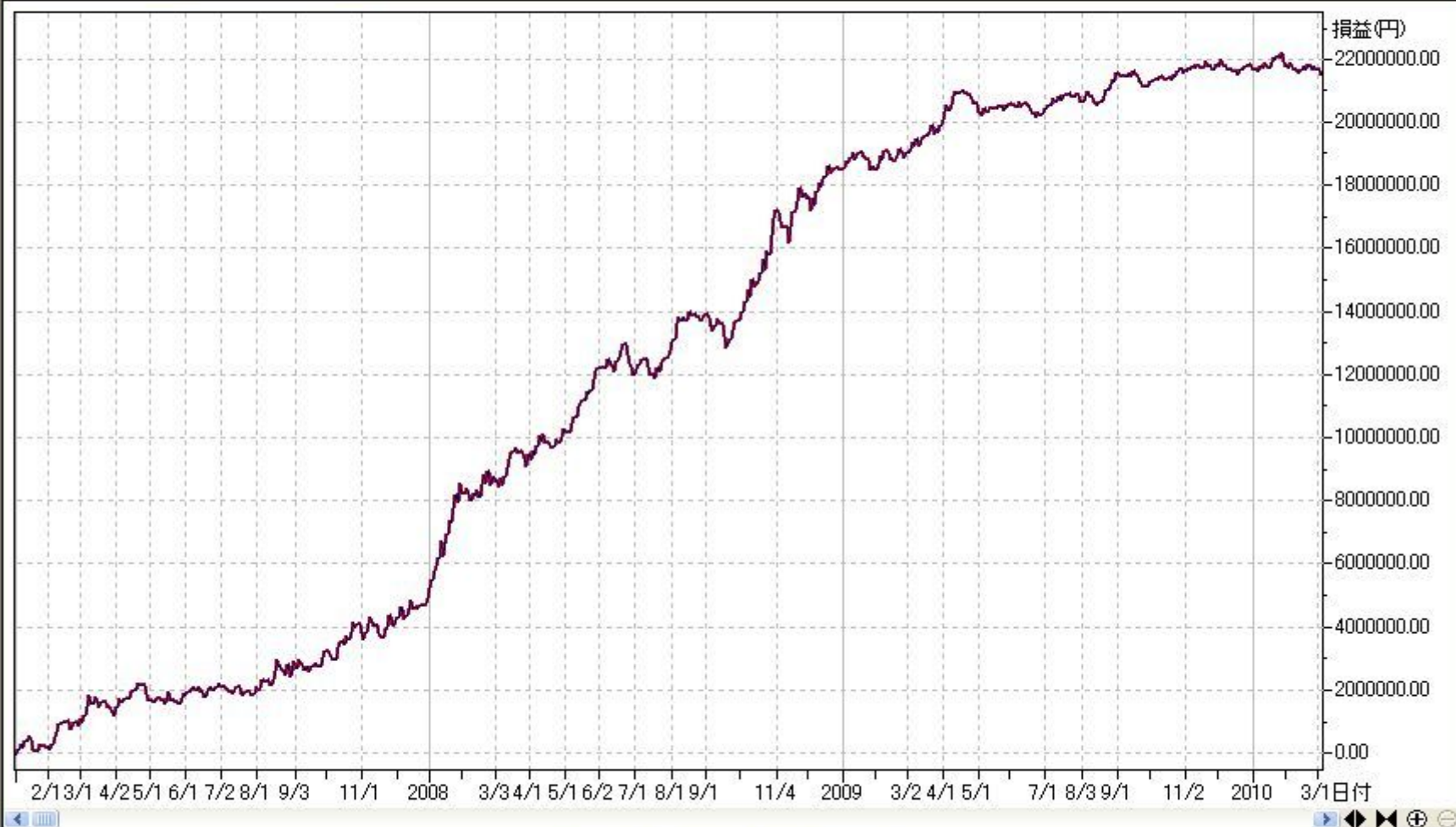


戦略ポートフォリオ分析

戦略選択

累積損益

日別 累積損益



225先物 期近つなぎ足

総合分析 戦略分析 期間分析 グラフ

戦略ポートフォリオ分析

戦略選択

銘柄名	総合	225先物 期近つなぎ足
戦略名		!TripleCrossCounter(1)
周期		5分
開始日	2006/12/29	2006/12/29
終了日	2010/03/04	2010/03/04
総損益(円)	21,620,000.00	21,620,000.00
未決済含み総損益(円)	21,620,000.00	21,620,000.00
総収益(円)	61,580,000.00	61,580,000.00
総損失(円)	-39,960,000.00	-39,960,000.00
年平均損益(円)	6,791,135.97	6,791,135.97
総売買回数	780	780
収益売買回数	368	368
損失売買回数	380	380
勝率(%)	49.20	49.20
平均損益(円)	27,717.95	27.72
平均損益比	1.59	1.59
最大収益(円)	840,000.00	840,000.00
平均収益(円)	167,336.96	167,336.96
最大連続収益の売買回数	11	11
収益売買の平均足個数	25.96	25.96
最大損失(円)	-380,000.00	-380,000.00
平均損失(円)	-105,157.89	-105,157.89
最大連続損失の売買回数	7	7
損失売買の平均足個数	17.12	17.12
最大損失幅(円)	-1,140,000.00	-1,160,000.00
補償割合	18.96	18.64
総収益/総損失	1.54	1.54
投資要求金額(円)	18,510,000.00	18,530,000.00
収益率(%)	116.80	116.68

総合分析 戦略分析 期間分析 グラフ

戦略ポートフォリオ分析

戦略選択

周期 月間分析 方法 単位分析

銘柄名	合計	平均	先物 期近つなぎ
戦略名			LossCounter(1)
平均(円)	540,500.00	540,500.00	540,500.00
標準偏差(円)	838,277.85	838,277.85	838,277.85
Sharpe Ratio	0.64	838,277.85	0.64
年/月	合計(円)	平均(円)	先物 期近つなぎ
2006/12	0	0	0
2007/01	160,000.00	160,000.00	160,000.00
2007/02	700,000.00	700,000.00	700,000.00
2007/03	340,000.00	340,000.00	340,000.00
2007/04	480,000.00	480,000.00	480,000.00
2007/05	200,000.00	200,000.00	200,000.00
2007/06	320,000.00	320,000.00	320,000.00
2007/07	-320,000.00	-320,000.00	-320,000.00
2007/08	1,040,000.00	1,040,000.00	1,040,000.00
2007/09	300,000.00	300,000.00	300,000.00
2007/10	860,000.00	860,000.00	860,000.00
2007/11	100,000.00	100,000.00	100,000.00
2007/12	740,000.00	740,000.00	740,000.00
2008/01	3,640,000.00	3,640,000.00	3,640,000.00
2008/02	180,000.00	180,000.00	180,000.00
2008/03	700,000.00	700,000.00	700,000.00
2008/04	820,000.00	820,000.00	820,000.00
2008/05	1,920,000.00	1,920,000.00	1,920,000.00
2008/06	-200,000.00	-200,000.00	-200,000.00
2008/07	760,000.00	760,000.00	760,000.00
2008/08	1,120,000.00	1,120,000.00	1,120,000.00
2008/09	-160,000.00	-160,000.00	-160,000.00
2008/10	3,520,000.00	3,520,000.00	3,520,000.00
2008/11	520,000.00	520,000.00	520,000.00
2008/12	720,000.00	720,000.00	720,000.00
2009/01	120,000.00	120,000.00	120,000.00
2009/02	460,000.00	460,000.00	460,000.00
2009/03	860,000.00	860,000.00	860,000.00
2009/04	680,000.00	680,000.00	680,000.00
2009/05	-120,000.00	-120,000.00	-120,000.00
2009/06	-180,000.00	-180,000.00	-180,000.00
2009/07	260,000.00	260,000.00	260,000.00

総合分析 戦略分析 期間分析 グラフ

戦略ポートフォリオ分析

戦略選択

周期 月間分析 方法 単位分析

銘柄名	合計	平均	先物 期近つなぎ
戦略名			LossCounter(1)
平均(円)	540,500.00	540,500.00	540,500.00
標準偏差(円)	838,277.85	838,277.85	838,277.85
Sharpe Ratio	0.64	838,277.85	0.64
年/月	合計(円)	平均(円)	先物 期近つなぎ
2007/09	300,000.00	300,000.00	300,000.00
2007/10	860,000.00	860,000.00	860,000.00
2007/11	100,000.00	100,000.00	100,000.00
2007/12	740,000.00	740,000.00	740,000.00
2008/01	3,640,000.00	3,640,000.00	3,640,000.00
2008/02	180,000.00	180,000.00	180,000.00
2008/03	700,000.00	700,000.00	700,000.00
2008/04	820,000.00	820,000.00	820,000.00
2008/05	1,920,000.00	1,920,000.00	1,920,000.00
2008/06	-200,000.00	-200,000.00	-200,000.00
2008/07	760,000.00	760,000.00	760,000.00
2008/08	1,120,000.00	1,120,000.00	1,120,000.00
2008/09	-160,000.00	-160,000.00	-160,000.00
2008/10	3,520,000.00	3,520,000.00	3,520,000.00
2008/11	520,000.00	520,000.00	520,000.00
2008/12	720,000.00	720,000.00	720,000.00
2009/01	120,000.00	120,000.00	120,000.00
2009/02	460,000.00	460,000.00	460,000.00
2009/03	860,000.00	860,000.00	860,000.00
2009/04	680,000.00	680,000.00	680,000.00
2009/05	-120,000.00	-120,000.00	-120,000.00
2009/06	-180,000.00	-180,000.00	-180,000.00
2009/07	360,000.00	360,000.00	360,000.00
2009/08	920,000.00	920,000.00	920,000.00
2009/09	-420,000.00	-420,000.00	-420,000.00
2009/10	420,000.00	420,000.00	420,000.00
2009/11	280,000.00	280,000.00	280,000.00
2009/12	-80,000.00	-80,000.00	-80,000.00
2010/01	180,000.00	180,000.00	180,000.00
2010/02	-300,000.00	-300,000.00	-300,000.00
2010/03	-20,000.00	-20,000.00	-20,000.00

総合分析 戦略分析 期間分析 グラフ

先日お伝えした成績はこの中のシステムの一つ
カウンタートレードが抜けたものでした。

カウンターをプラスすると今回のものになります。
失礼しました。

くれぐれもこれが最高のシステム等ではありません。

いくつものシステムが必要です。

これは 3つのシステムを一つにしているので3つ分の価値はありますが、それだけでOKではないです。

プログラマーに特別に依頼して作ったMAXZ...

他の方が作られたD...等、

いくつものシステムを使うことで収益が安定できます。

それに、裁量のポジションを持つ選択も良いのではないのでしょうか。