

トレードシグナル - ストラテジーのパフォーマンス・レポート

レポート作成日時 2009/08/13 10:35:07

N225_Tunegi - N225_Tunegi LAST 日足のパフォーマンス

	すべてのトレード	買いトレード	売りトレード
累計損益	JPY 31656320.00	JPY 16011440.00	JPY 15644880.00
総利益	JPY 65787120.00	JPY 31823440.00	JPY 33963680.00
総損失	(JPY 34130800.00)	(JPY 15812000.00)	(JPY 18318800.00)
プロフィット・ファクター	1.93	2.01	1.85
未確定損益	(JPY 171680.00)	JPY 0.00	(JPY 171680.00)
総トレード回数	388	196	192
勝率	60.05%	61.73%	58.33%
勝ちトレードの回数	233	121	112
負けトレードの回数	155	75	80
イーブントレードの回数	0	0	0
勝ち期間	1050	538	512
負け期間	596	255	341
イーブン期間	0	0	0
平均損益	JPY 81588.45	JPY 81691.02	JPY 81483.75
平均利益	JPY 282348.15	JPY 263003.64	JPY 303247.14
平均損失	(JPY 220198.71)	(JPY 210826.67)	(JPY 228985.00)
平均損益率	1.28	1.25	1.32
最大利益	JPY 1956640.00	JPY 1866640.00	JPY 1956640.00
最大損失	(JPY 2023360.00)	(JPY 2023360.00)	(JPY 783360.00)
勝ちトレードの最大連続数	10	8	11
負けトレードの最大連続数	7	4	4
すべてのトレードの平均ポジション保有期間	n/a	4.05	4.44
総ポジション保有期間	n/a	793	853
勝ちトレードの平均ポジション保有期間	4.51	4.45	4.57
負けトレードの平均ポジション保有期間	3.85	3.40	4.26
イーブントレードの平均ポジション保有期間	0.00	0.00	0.00
負けトレードの連続回数	3	4	2
勝ちトレードの連続回数	2	2	1
最大保持株/枚数	1	1	1
累計株/枚数	389	196	193
総手数料	JPY 1305360.00	JPY 658560.00	JPY 646800.00
スリッページ累計	JPY 7770000.00	JPY 3920000.00	JPY 3850000.00
必要資金	JPY 3242480.00	JPY 3035360.00	JPY 2835760.00
口座収益率	976.30%	527.50%	551.70%
シャープレシオ	0.58	0.68	0.47
シャープレシオ平均	1.60	1.68	1.02
ハッピーファクター	8.45		
開始日	2004/02/03		
最終日	2009/08/13		
立会期間	2018 日		
ポジション保有期間	1884 日		
ポジション保有期間(%)	93.36%		

最大ドロダウ	(JPY 3242480.00)	(JPY 3035360.00)	(JPY 2835760.00)
最大ドロダウ 日付	2007/05/01	2008/10/28	2007/05/09
最大日中ドロダウ	(JPY 3637920.00)	(JPY 3220320.00)	(JPY 3347440.00)
総ポジション数	389	196	193
ポジションの変更回数	777	392	385
総ポジション数 確定	388	196	192

月次集計

期間	評価損益	# 取引回数	% 利益率
2月 2004	179840.00	6	50.00%
3月 2004	294800.00	7	57.14%
4月 2004	(80160.00)	6	66.67%
5月 2004	1473200.00	5	60.00%
6月 2004	263200.00	5	40.00%
7月 2004	(330160.00)	6	33.33%
8月 2004	596480.00	7	85.71%
9月 2004	(100160.00)	6	33.33%
10月 2004	49840.00	6	50.00%
11月 2004	(93520.00)	7	42.86%
12月 2004	589840.00	6	83.33%
1月 2005	183200.00	5	60.00%
2月 2005	33200.00	5	40.00%
3月 2005	(246800.00)	5	40.00%
4月 2005	459840.00	6	50.00%
5月 2005	506480.00	7	85.71%
6月 2005	(70160.00)	6	33.33%
7月 2005	(13440.00)	4	50.00%
8月 2005	(593520.00)	7	28.57%
9月 2005	(10160.00)	6	66.67%
10月 2005	943200.00	5	80.00%
11月 2005	383200.00	5	60.00%
12月 2005	609840.00	6	83.33%
1月 2006	1256480.00	7	57.14%
2月 2006	1689840.00	6	83.33%
3月 2006	(1030160.00)	6	33.33%
4月 2006	513200.00	5	80.00%
5月 2006	159840.00	6	66.67%
6月 2006	2079840.00	6	50.00%
7月 2006	783200.00	5	60.00%
8月 2006	(136800.00)	5	80.00%
9月 2006	936560.00	4	100.00%
10月 2006	(313520.00)	7	71.43%
11月 2006	819840.00	6	50.00%
12月 2006	(920160.00)	6	33.33%
1月 2007	(140160.00)	6	50.00%
2月 2007	(70160.00)	6	50.00%
3月 2007	(1510160.00)	6	33.33%
4月 2007	(671840.00)	7	28.57%
5月 2007	591520.00	5	80.00%
6月 2007	139840.00	6	50.00%
7月 2007	(356800.00)	5	60.00%
8月 2007	1429840.00	6	50.00%
9月 2007	1323200.00	5	100.00%

10月 2007	889840.00	6	50.00%
11月 2007	1639840.00	6	83.33%
12月 2007	1333200.00	5	100.00%
1月 2008	893200.00	5	80.00%
2月 2008	819840.00	6	83.33%
3月 2008	1803200.00	5	80.00%
4月 2008	1333200.00	5	60.00%
5月 2008	659840.00	6	50.00%
6月 2008	486480.00	7	71.43%
7月 2008	603200.00	5	60.00%
8月 2008	(30160.00)	6	50.00%
9月 2008	296480.00	7	71.43%
10月 2008	1639840.00	6	50.00%
11月 2008	2863200.00	5	80.00%
12月 2008	(293520.00)	7	57.14%
1月 2009	2299840.00	6	100.00%
2月 2009	968160.00	7	71.43%
3月 2009	(705200.00)	7	42.86%
4月 2009	1269840.00	6	83.33%
5月 2009	1249840.00	6	83.33%
6月 2009	(283520.00)	7	14.29%
7月 2009	339840.00	6	33.33%
8月 2009	(193360.00)	1	100.00%

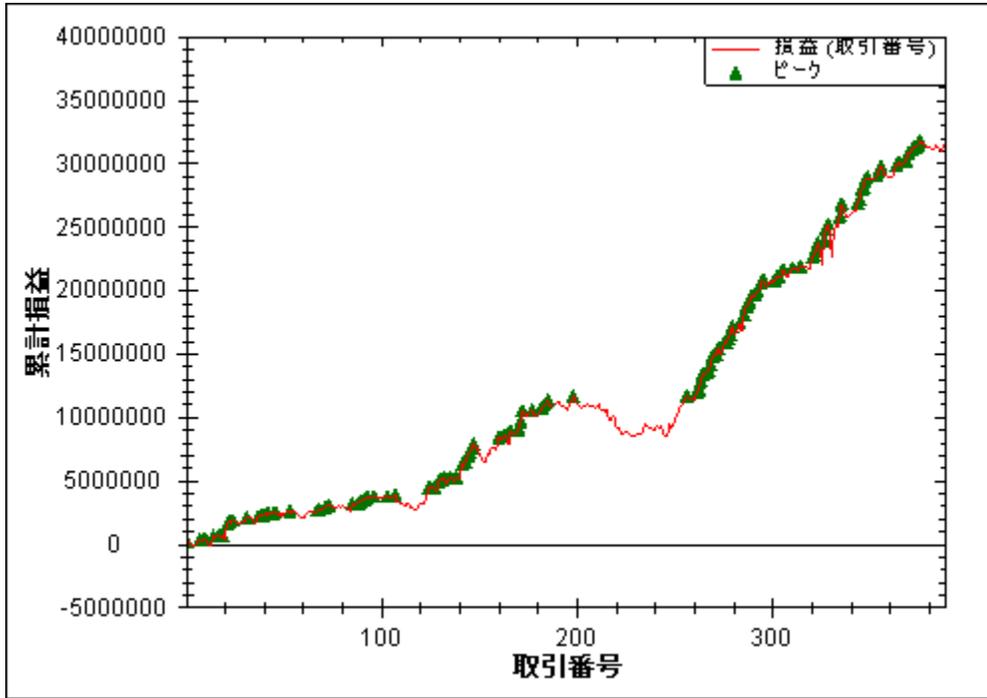
四半期次集計

期間	評価損益	# 取引回数	% 利益率
2004 第1四半期	474640.00	13	53.85%
2004 第2四半期	1656240.00	16	56.25%
2004 第3四半期	166160.00	19	52.63%
2004 第4四半期	546160.00	19	57.89%
2005 第1四半期	(30400.00)	15	46.67%
2005 第2四半期	896160.00	19	57.89%
2005 第3四半期	(617120.00)	17	47.06%
2005 第4四半期	1936240.00	16	75.00%
2006 第1四半期	1916160.00	19	57.89%
2006 第2四半期	2752880.00	17	64.71%
2006 第3四半期	1582960.00	14	78.57%
2006 第4四半期	(413840.00)	19	52.63%
2007 第1四半期	(1720480.00)	18	44.44%
2007 第2四半期	59520.00	18	50.00%
2007 第3四半期	2396240.00	16	68.75%
2007 第4四半期	3862880.00	17	76.47%
2008 第1四半期	3516240.00	16	81.25%
2008 第2四半期	2479520.00	18	61.11%
2008 第3四半期	869520.00	18	61.11%
2008 第4四半期	4209520.00	18	61.11%
2009 第1四半期	2562800.00	20	70.00%
2009 第2四半期	2236160.00	19	57.89%
2009 第3四半期	146480.00	7	42.86%

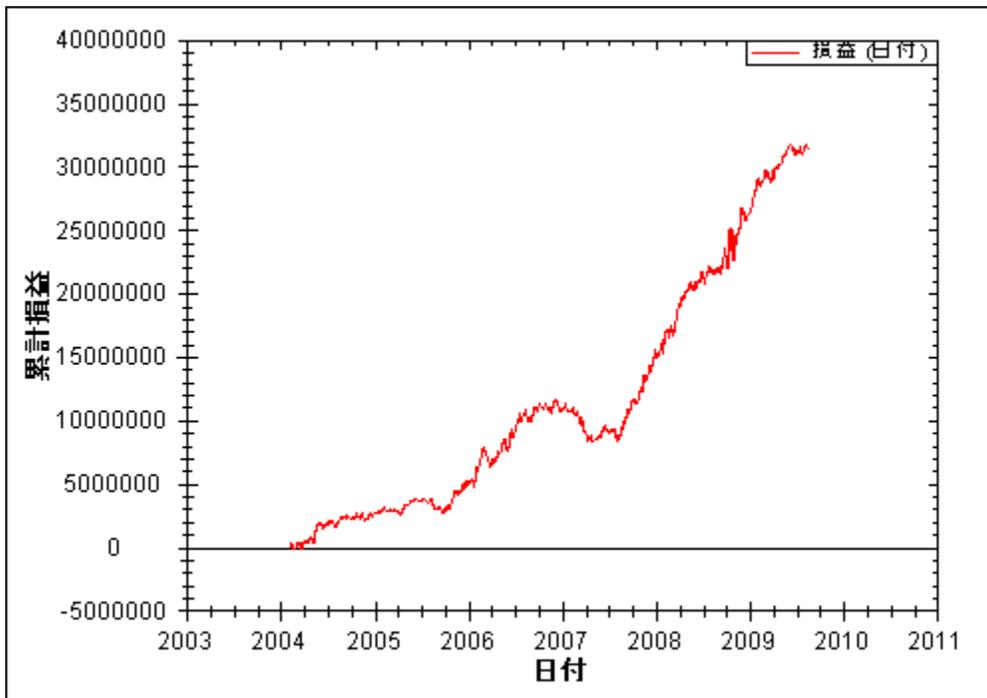
年次集計

期間	評価損益	# 取引回数	% 利益率
2004	2843200.00	67	55.22%
2005	2184880.00	67	56.72%
2006	5838160.00	69	62.32%
2007	4598160.00	69	59.42%
2008	11074800.00	70	65.71%
2009	4945440.00	46	60.87%

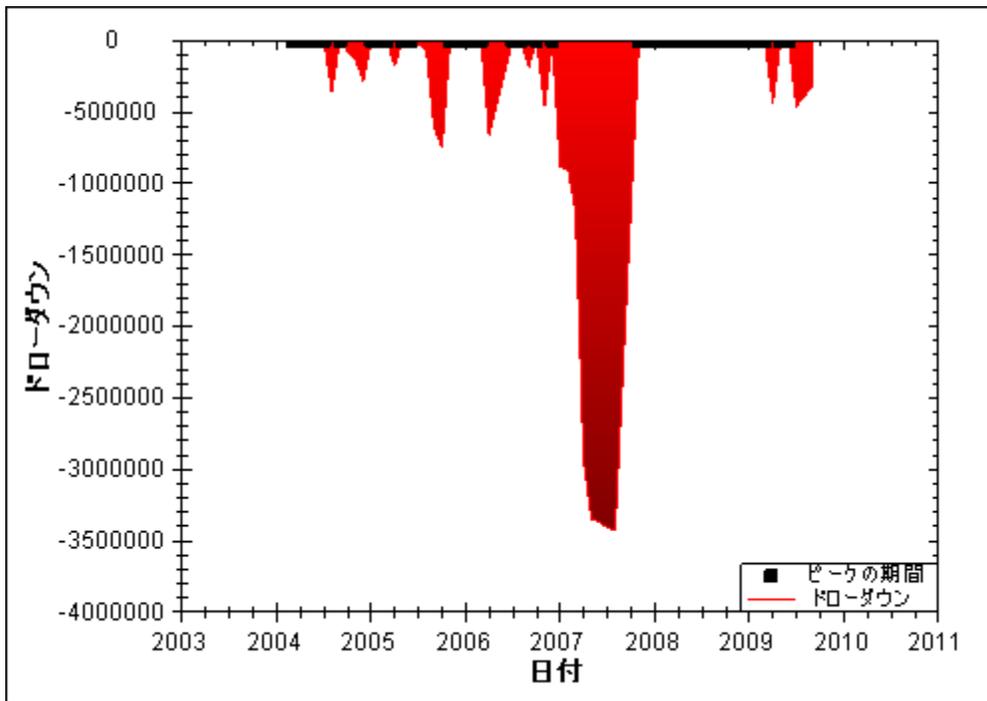
グラフ: 損益曲線(取引番号)



グラフ: 損益曲線(日付)



グラフ: ドローダウン(額)



グラフ: ドロウダウン(パーセント)

