

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 10:31:44

TOPIX_Tunagi - TOPIX_Tunagi 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 36266400.00	JPY 18269800.00	JPY 17996600.00
総利益	JPY 67728840.00	JPY 33646800.00	JPY 34082040.00
総損失	(JPY 31462440.00)	(JPY 15377000.00)	(JPY 16085440.00)
プロフィット・ファクター	2.15	2.19	2.12
未確定損益	(JPY 126680.00)	JPY 0.00	(JPY 126680.00)
総トレード回数	385	195	190
勝率	60.00%	61.54%	58.42%
勝ちトレードの回数	231	120	111
負けトレードの回数	154	75	79
イーブントレードの回数	0	0	0
勝ち期間	1024	517	507
負け期間	604	269	335
イーブン期間	0	0	0
平均損益	JPY 94198.44	JPY 93691.28	JPY 94718.95
平均利益	JPY 293198.44	JPY 280390.00	JPY 307045.41
平均損失	(JPY 204301.56)	(JPY 205026.67)	(JPY 203613.16)
平均損益率	1.44	1.37	1.51
最大利益	JPY 1851640.00	JPY 1741640.00	JPY 1851640.00
最大損失	(JPY 1258360.00)	(JPY 1258360.00)	(JPY 723360.00)
勝ちトレードの最大連続数	12	9	16
負けトレードの最大連続数	7	4	6
すべてのトレードの平均ポジション保有期間	n/a	4.03	4.43
総ポジション保有期間	n/a	786	842
勝ちトレードの平均ポジション保有期間	4.43	4.31	4.57
負けトレードの平均ポジション保有期間	3.92	3.59	4.24
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	386	195	191
総手数料	JPY 1295280.00	JPY 655200.00	JPY 640080.00
スリッページ累計	JPY 3855000.00	JPY 1950000.00	JPY 1905000.00
必要資金	JPY 2899200.00	JPY 3042080.00	JPY 2400440.00
口座収益率	1250.91%	600.57%	749.72%
シャープレシオ	0.61	0.72	0.50
シャープレシオ平均	1.29	1.38	0.91
ハッピーファクター	12.99		
開始日	2004/01/06		
最終日	2009/08/13		
立会期間	2046 日		
ポジション保有期間	1915 日		
ポジション保有期間(%)	93.60%		

最大ドロダウ	(JPY 2899200.00)	(JPY 3042080.00)	(JPY 2400440.00)
最大ドロダウ 日付	2007/05/09	2008/10/28	2007/05/09
最大日中ドロダウ	(JPY 3280880.00)	(JPY 3285160.00)	(JPY 2777440.00)
総ポジション数	386	195	191
ポジションの変更回数	771	390	381
総ポジション数 確定	385	195	190

月次集計

期間	評価損益	# 取引回数	% 利益率
1月 2004	(6680.00)	0	
2月 2004	41000.00	0	
3月 2004	(36880.00)	8	50.00%
4月 2004	(170160.00)	6	66.67%
5月 2004	1643200.00	5	60.00%
6月 2004	73200.00	5	40.00%
7月 2004	(375160.00)	6	16.67%
8月 2004	441480.00	7	85.71%
9月 2004	144840.00	6	50.00%
10月 2004	219840.00	6	50.00%
11月 2004	166480.00	7	42.86%
12月 2004	549840.00	6	83.33%
1月 2005	188200.00	5	60.00%
2月 2005	108200.00	5	40.00%
3月 2005	(236800.00)	5	40.00%
4月 2005	564840.00	6	50.00%
5月 2005	546480.00	7	71.43%
6月 2005	24840.00	6	33.33%
7月 2005	51560.00	4	50.00%
8月 2005	(493520.00)	7	28.57%
9月 2005	29840.00	6	66.67%
10月 2005	1063200.00	5	80.00%
11月 2005	603200.00	5	80.00%
12月 2005	514840.00	6	66.67%
1月 2006	1001480.00	7	42.86%
2月 2006	1879840.00	6	83.33%
3月 2006	(1070160.00)	6	33.33%
4月 2006	698200.00	5	80.00%
5月 2006	114840.00	6	66.67%
6月 2006	1909840.00	6	50.00%
7月 2006	618200.00	5	60.00%
8月 2006	(236800.00)	5	80.00%
9月 2006	1126560.00	4	100.00%
10月 2006	36480.00	7	85.71%
11月 2006	1094840.00	6	50.00%
12月 2006	(750160.00)	6	33.33%
1月 2007	(155160.00)	6	33.33%
2月 2007	(70160.00)	6	50.00%
3月 2007	(1410160.00)	6	16.67%
4月 2007	(561840.00)	7	28.57%
5月 2007	661520.00	5	80.00%
6月 2007	299840.00	6	50.00%
7月 2007	(171800.00)	5	60.00%
8月 2007	1589840.00	6	50.00%

9月 2007	1773200.00	5	100.00%
10月 2007	1394840.00	6	66.67%
11月 2007	1829840.00	6	100.00%
12月 2007	1738200.00	5	100.00%
1月 2008	1603200.00	5	80.00%
2月 2008	1109840.00	6	83.33%
3月 2008	1953200.00	5	80.00%
4月 2008	1753200.00	5	80.00%
5月 2008	784840.00	6	50.00%
6月 2008	906480.00	7	71.43%
7月 2008	518200.00	5	60.00%
8月 2008	204840.00	6	50.00%
9月 2008	(1880.00)	8	62.50%
10月 2008	996480.00	7	57.14%
11月 2008	2828200.00	5	80.00%
12月 2008	(163520.00)	7	57.14%
1月 2009	1789840.00	6	100.00%
2月 2009	848160.00	7	71.43%
3月 2009	(160200.00)	7	57.14%
4月 2009	1009840.00	6	66.67%
5月 2009	979840.00	6	83.33%
6月 2009	(383520.00)	7	14.29%
7月 2009	329840.00	6	33.33%
8月 2009	(133360.00)	1	100.00%

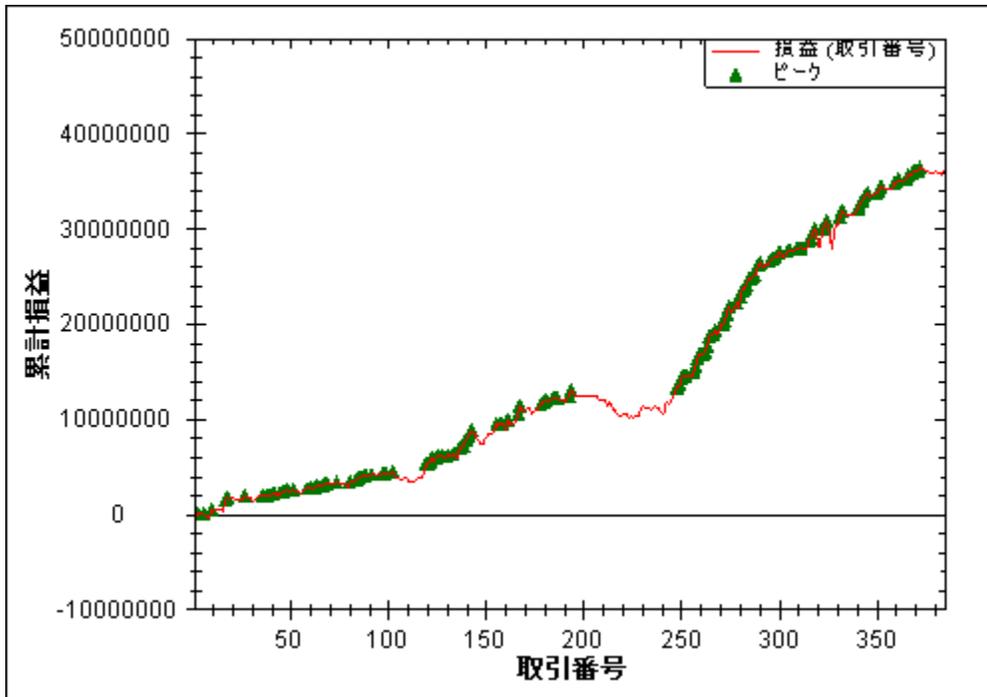
四半期次集計

期間	評価損益	# 取引回数	% 利益率
2004 第1四半期	366440.00	8	50.00%
2004 第2四半期	1546240.00	16	56.25%
2004 第3四半期	211160.00	19	52.63%
2004 第4四半期	936160.00	19	57.89%
2005 第1四半期	59600.00	15	46.67%
2005 第2四半期	1136160.00	19	52.63%
2005 第3四半期	(412120.00)	17	47.06%
2005 第4四半期	2181240.00	16	75.00%
2006 第1四半期	1811160.00	19	52.63%
2006 第2四半期	2722880.00	17	64.71%
2006 第3四半期	1507960.00	14	78.57%
2006 第4四半期	381160.00	19	57.89%
2007 第1四半期	(1635480.00)	18	33.33%
2007 第2四半期	399520.00	18	50.00%
2007 第3四半期	3191240.00	16	68.75%
2007 第4四半期	4962880.00	17	88.24%
2008 第1四半期	4666240.00	16	81.25%
2008 第2四半期	3444520.00	18	66.67%
2008 第3四半期	721160.00	19	57.89%
2008 第4四半期	3661160.00	19	63.16%
2009 第1四半期	2477800.00	20	75.00%
2009 第2四半期	1606160.00	19	52.63%
2009 第3四半期	196480.00	7	42.86%

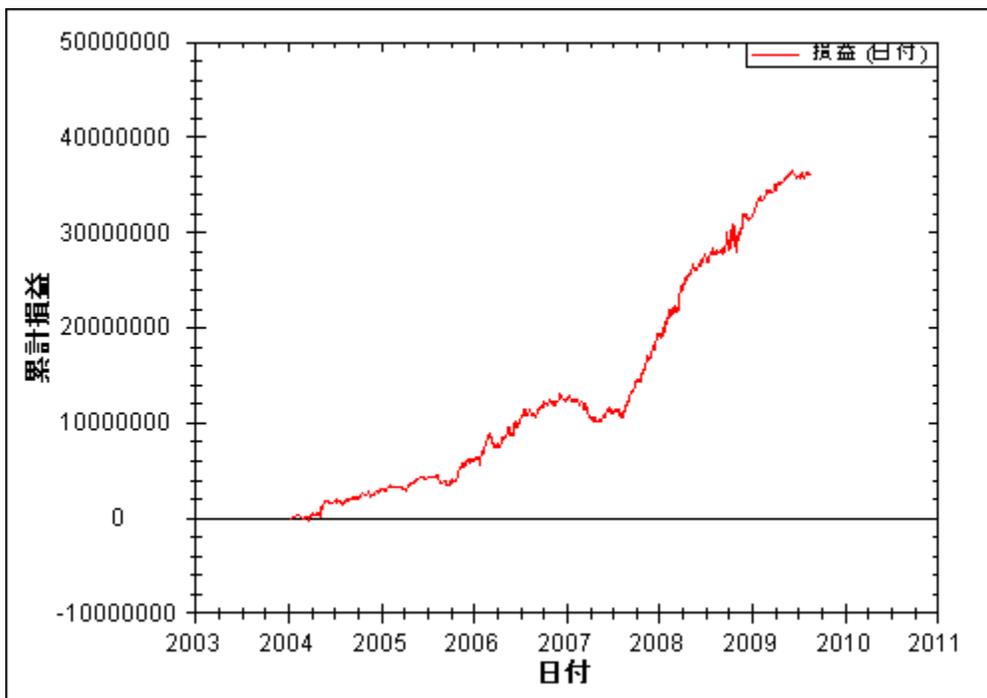
年次集計

期間	評価損益	# 取引回数	% 利益率
2004	3060000.00	62	54.84%
2005	2964880.00	67	55.22%
2006	6423160.00	69	62.32%
2007	6918160.00	69	59.42%
2008	12493080.00	72	66.67%
2009	4280440.00	46	60.87%

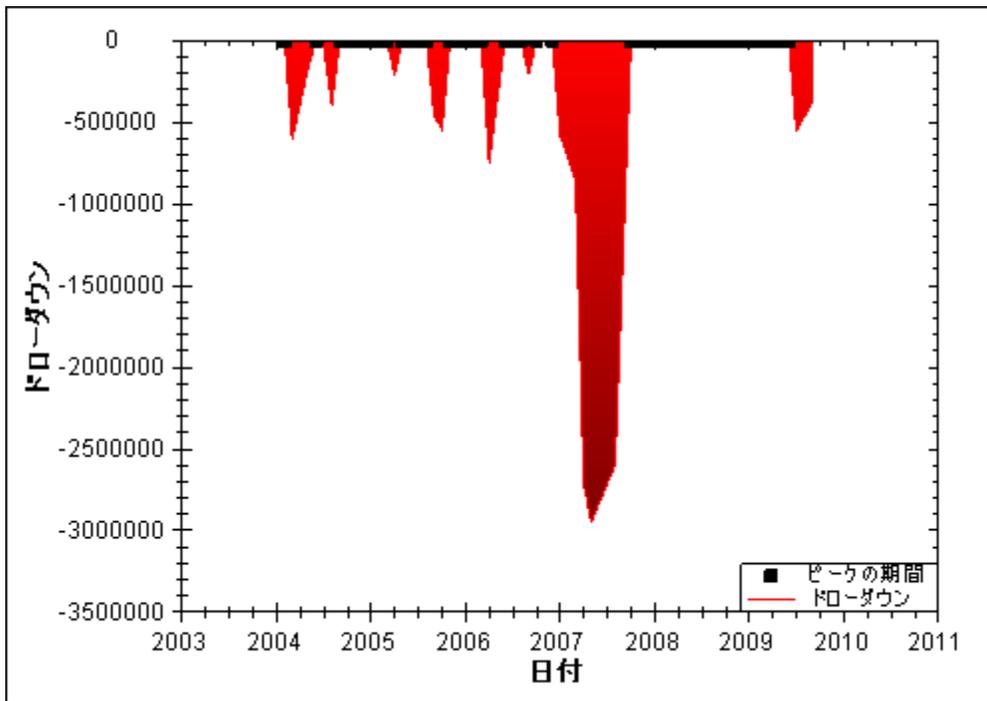
グラフ: 損益曲線(取引番号)



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)

