

『宝船』短期SPAN 収益率・売買分析

08/08/19 12:18:59

収益率一覧表

開始日	終了日	ポートフォリオ名	システム名	証拠金比率	委託手数料
2007/1/1	2007/12/31	traffic02	traffic02	20%	0円(往復)

銘柄名	取引スパン	今月	直近3ヶ月	直近6ヶ月	月間平均	3ヶ月平均	6ヶ月平均	07年	年収益率	標準偏差	シャープレシオ
		-17.42%	58.94%	159.87%	22.70%	84.54%	157.16%	272.41%	272.41%	127.15%	2.14%
1. カナダドル/円	短期	-0.19%	230.64%	202.61%	34.73%	108.96%	157.07%	416.82%	416.82%	274.97%	1.52%
2. NZドル/円	短期	-44.03%	-69.88%	261.36%	28.97%	126.63%	277.12%	347.62%	347.62%	237.80%	1.46%
3. ユーロ/ドル	短期	-8.03%	16.06%	15.65%	4.40%	18.03%	37.29%	52.80%	52.80%	61.11%	0.86%

売買分析一覧表

開始日	終了日	ポートフォリオ名	システム名	証拠金比率	委託手数料
2007/1/1	2007/12/31	traffic02	traffic02	20%	0円(往復)

銘柄名	取引スパン	今月	前日比	現建玉	値洗い	経過日数	前月	前々月	最大月間収益	最大月間損失
		-17.42%	-6.08%		0円	0日	44.82%	31.54%	86.19%	-29.11%
		買取引	益回数	買勝率	売取引	益回数	売勝率			
		35回	12回	34.29%	34回	8回	23.53%			
1. カナダドル/円	短期	今月	前日比	現建玉	値洗い	経過日数	前月	前々月	最大月間収益	最大月間損失
		-0.19%	0.00%	売り	0円	0日	156.60%	74.24%	156.60%	-81.20%
		買取引	益回数	買勝率	売取引	益回数	売勝率			
		12回	5回	41.67%	12回	2回	16.67%			
2. NZドル/円	短期	今月	前日比	現建玉	値洗い	経過日数	前月	前々月	最大月間収益	最大月間損失
		-44.03%	0.00%	売り	0円	0日	-17.92%	-7.94%	135.41%	-44.03%
		買取引	益回数	買勝率	売取引	益回数	売勝率			
		10回	2回	20.00%	9回	2回	22.22%			
3. ユーロ/ドル	短期	今月	前日比	現建玉	値洗い	経過日数	前月	前々月	最大月間収益	最大月間損失
		-8.03%	-18.24%	買い	-0.0023円	4日	-4.22%	28.31%	40.55%	-21.23%
		買取引	益回数	買勝率	売取引	益回数	売勝率			
		13回	5回	38.46%	13回	4回	30.77%			

「シャープレシオとは」 シャープレシオとは、リスクに対してどれだけのリターンを得られるかを示す指標であり、シャープレシオが大きいほどリスクに比して大きなリターンを実現していることを示します。逆に、超過収益を上げるために、どれだけリスクをとっているかを表しているといえます。分子が超過収益を示し、分母がリスクの大きさを示します。

「ボリンジャーバンドとは」 ボリンジャーバンドとは、市場動向のテクニカル分析を行うためのチャートの一つで、統計学上の標準偏差をチャートにプロットするものです。通常、第一標準偏差、第二標準偏差を上下に取り、移動平均性をプロットします。結果、第一標準偏差及び第二標準偏差の上値と下値が2本ずつ＋移動平均線と5本の線で構成されます。第一標準偏差の範囲内に終値が収まる確率は68%、第二標準偏差の範囲内に終値が収まる確率は、95%とされ、バンドの広さや移動平均線と補助線の位置関係で売買のタイミングを図ります。

『宝船』短期SPAN 純資産推移

株式会社トラフィック

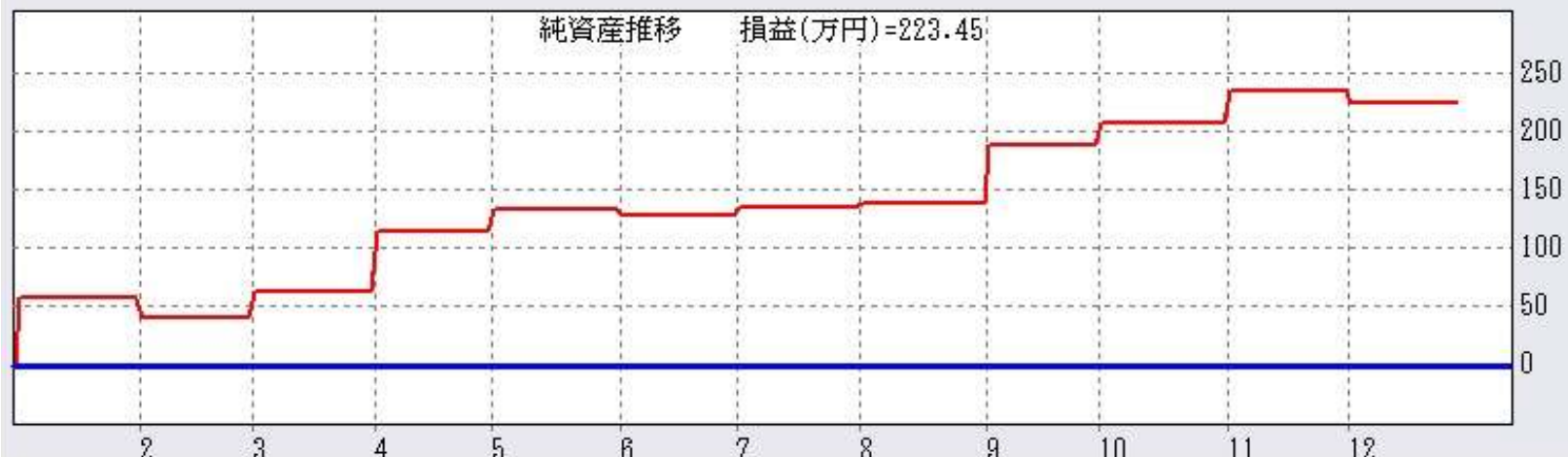
ポートフォリオ名 : traffic02

開始日 20070101 - 終了日 20071231

証拠金比率 : 20.0 %

初期投資資金 : 600000
 最終純資産 : 2234484
 年単利収益率 : 272.41 %
 月単利収益率 : 22.70 %
 最大月間利益 : 86.19 %
 最大月間損失 : -29.11 %
 勝月率 : 66.67 %
 シャープレシオ : 2.14

NO.	ポートフォリオ名	システム名	今月	前日比	現建玉	値洗い	経過日数	前月	前々月
0.	traffic02	traffic02	-17.42 %	-6.08		0 円	0 日	44.82 %	31.54 %
1.	カナドル/円	短期	-0.19 %	0.00	売り	0 円	0 日	156.60 %	74.24 %
2.	NZドル/円	短期	-44.03 %	0.00	売り	0 円	0 日	-17.92 %	-7.94 %
3.	ユーロ/ドル	短期	-8.03 %	-18.24	買い	-0.0023 円	4 日	-4.22 %	28.31 %



『宝船』短期SPANサマリー 08/08/19

System ポートフォリオサマリー

開始日	終了日	ポートフォリオ	銘柄名	システム数
2007/1/1	2007/12/31	traffic02	カナダドル/円・NZドル/円・ユーロ/ドル	3回

テスト日数	364日
トータル月数	12ヶ月
再投資処理(複利運用)	0ヶ月毎
テストパラメータ	
初期投資資金	600,000
帳尻損益金	1,640,744
最高純資産	2,495,134
支払手数料合計	0
年単利利益率	272.41%
最大月間利益	86.19%
勝月率	66.67%
MARレシオ	3.07
シャープレシオ	2.14
スターリングレシオ	0.00
買い取引	35回
利益	12回
損失	23回
勝率	34.29%
買い利益合計	1,945,117
最大利益	539,391
1回平均	162,093
買い損失合計	-652,272
最大損失	-105,945
1回平均	-28,360
リスク・リワード・レシオ	6
買い利益取引期間平均	34.3日
最大取引期間	85日
最小取引期間	9日
買い損失取引期間平均	3.2日
最大取引期間	13日
最小取引期間	1日
年度別取引回数(2007)	69回

営業日数	260日
委託手数料	0円
証拠金比率	20.00%
最終純資産	2,234,484
現建玉値洗い	-6,260
最低純資産	345,107
平均証拠金使用率	13.28%
月単利利益率	22.70%
最大月間損失	-29.11%
年標準偏差	127.15%
リワード/リスク インデックス	86.55%
プロフィット/ロス インデックス	57.11%
売り取引	34回
利益	8回
損失	26回
勝率	23.53%
売り利益合計	934,200
最大利益	467,419
1回平均	116,775
売り損失合計	-586,301
最大損失	-53,756
1回平均	-22,550
売り利益取引期間平均	18.4日
最大取引期間	29日
最小取引期間	9日
売り損失取引期間平均	3.3日
最大取引期間	15日
最小取引期間	1日
年度別取引勝率(2007)	28.99%

月間利益率

開始日	終了日	ポートフォリオ	証拠金比率	手数料	再投資(複利運用)
2007/1/1	2007/12/31	traffic02	20.00%	0円	0ヶ月毎

年/月	純資産	月間損益	利益率/初期投資金	手数料	消費税
2007/01	572,843	-27,157	-4.53%	0	0
2007/02	398,181	-174,662	-29.11%	0	0
2007/03	618,860	220,679	36.78%	0	0
2007/04	1,135,992	517,132	86.19%	0	0
2007/05	1,322,376	186,384	31.06%	0	0
2007/06	1,275,253	-47,123	-7.85%	0	0
2007/07	1,340,255	65,001	10.83%	0	0
2007/08	1,384,211	43,956	7.33%	0	0
2007/09	1,880,847	496,636	82.77%	0	0
2007/10	2,070,066	189,219	31.54%	0	0
2007/11	2,338,986	268,920	44.82%	0	0
2007/12	2,234,484	-104,502	-17.42%	0	0

～ご使用にあたっての注意事項～

- ※相場に適したリスクマネジメントを行わず、高いレバレッジによって取引を行った場合、大きな利益と同様に大きな損失を被る可能性があります。
- ※本ソフトウェア『宝船』は必ずしも資産の増加を保証するものではありません。掲載しております実績などは、『宝船』のシステム理論によるバックテスト結果であり、実際の取引記録ではありません。
- ※自動売買機能のご利用はお客様の任意によるものです。完全な勝率をお約束するものではありません。
- ※ご購入のお申し込みの際は、本ソフトウェアの使用許諾の同意が必要です。

