

第5回 TrendTiger_EAの バックテスト手順と分析



MT4を使ったバックテスト手順①

ヒストリカルデータをダウンロードして、MT4を再起動して、
ストラテジーテスターを起動するところまでは
“Indicatorのバックテスト手順⑥”の(12)と同じ手順

(1) TrendTiger_EAを選ぶ

The screenshot shows the MT4 Strategy Tester window. A red rectangular box highlights the main configuration area. Inside this box, the 'Expert Advisor' dropdown is set to 'TrendTiger_USDJPY_20170303.ex4'. The 'Currency Pair' is 'USDJPY, US Dollar vs Japanese Yen', the 'Period' is 'M1', and the 'Model' is 'Start value only (fastest method. Only works for EAs that start at the beginning of the bar)'. The 'Specify period' checkbox is checked. The 'Start date' is '2010.01.01' and the 'End date' is '2017.03.19'. The 'Spread' is set to '12'. There are buttons for 'Visual mode', 'Start', 'Pause', 'Skip', and 'Optimize'. To the right of the red box, there are buttons for 'Expert Advisor settings', 'Currency pair properties', 'Open chart', and 'Edit expert advisor'. Below the red box is a 'Start' button. At the bottom of the window, there is a status bar with 'F1 key for help', 'Default', and '14/2 kb'.

エキスパートアドバイザー	TrendTiger_USDJPY_20170303.ex4	エキスパート設定
通貨ペア	USDJPY, US Dollar vs Japanese Yen	通貨ペアのプロパティ
期間	M1	チャートを開く
モデル	始値のみ (最も早い方法。バーの始めにしか動かないEA向け)	エキスパート編集
スプレッド	12	
期間を指定	☒	
開始日	2010.01.01	
終了日	2017.03.19	最適化 ☐
ビジュアルモード	☐	
スタート		

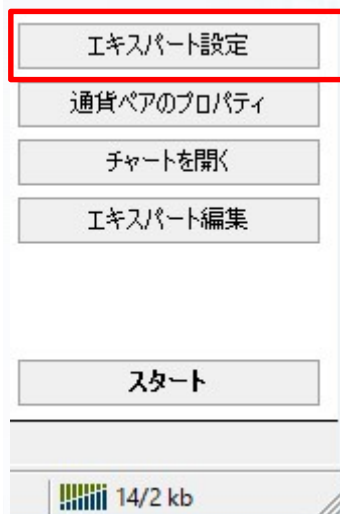
デスター

セッティング | 操作履歴 |

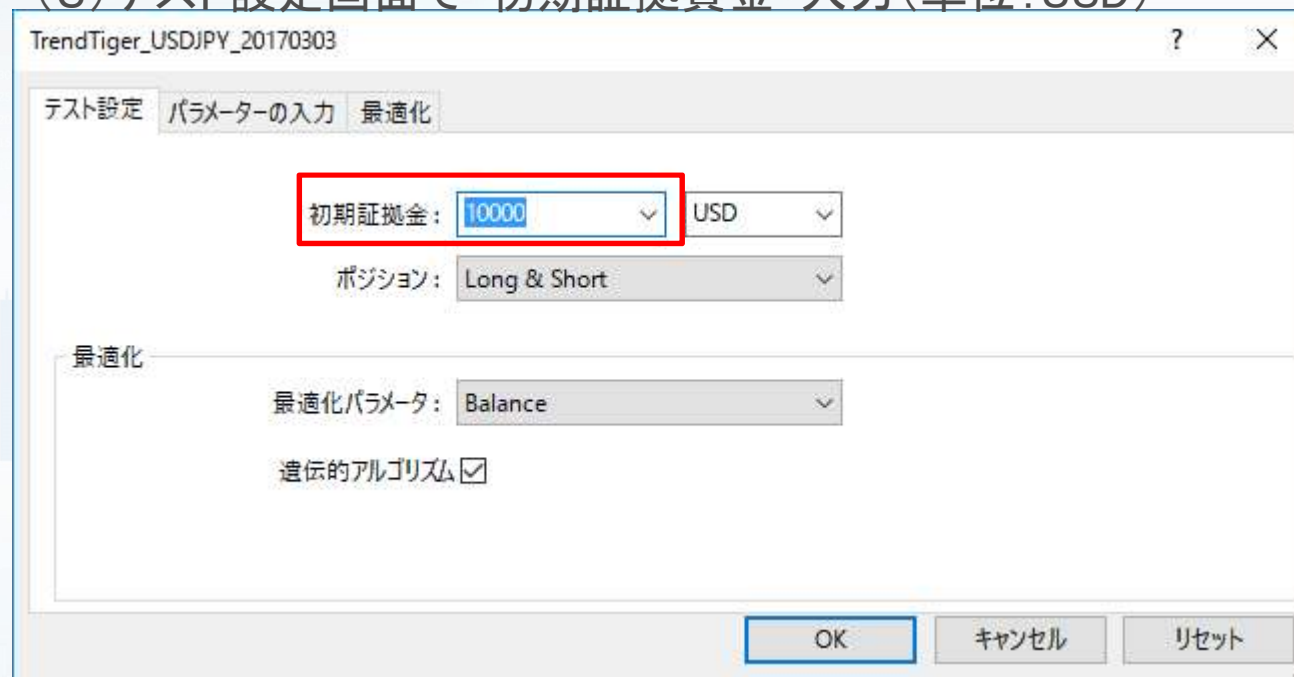
F1キーでヘルプが表示されます Default 14/2 kb

MT4を使ったバックテスト手順②

(2) “エキスパート設定”をクリック



(3) テスト設定画面で“初期証拠資金”入力(単位:USD)



MT4を使ったバックテスト手順③

(4) “パラメーター設定”のロット数を設定

TrendTiger_USDJPY_20170303

テスト設定 パラメーターの入力 最適化

変数	値	スタート	ステップ	ストップ
☒ lots	0.1	0.1	0.0	0.0
☐ MagicNumber	777	777	0	0
☐ itemCount_time1	39	39	0	0
☐ itemCount_time2	10	10	0	0
☐ itemCount_time3	1	1	0	0
☐ itemCount_time4	39	39	0	0
☐ itemCount_time6	44	44	0	0
☐ itemCount_time7	1	1	0	0

読み込み (L) 保存 (S)

OK キャンセル リセット

(5) スタートを押す

エキスパート設定

通貨ペアのプロパティ

チャートを開く

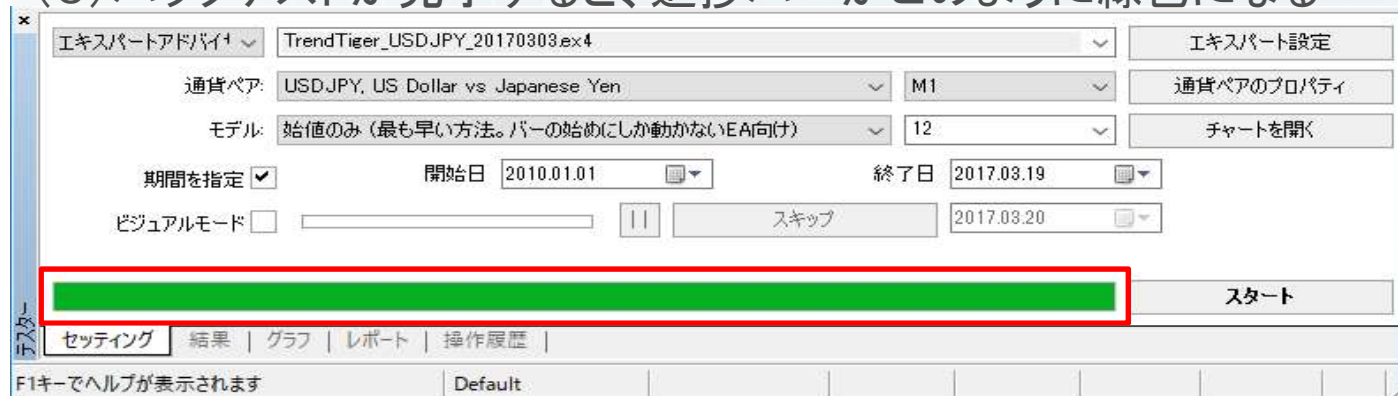
エキスパート編集

スタート

14/2 kb

MT4を使ったバックテスト手順④

(6) バックテストが完了すると、進捗バーがこのように緑色になる



The screenshot shows the MT4 Backtest window. At the top, there's a dropdown menu for the expert advisor, set to 'TrendTiger_USDJPY_20170303.ex4'. Below it, the currency pair is 'USDJPY, US Dollar vs Japanese Yen', the timeframe is 'M1', and the model is '始値のみ (最も早い方法。バーの始めにしか動かないEA向け)'. The start date is '2010.01.01' and the end date is '2017.03.19'. A green progress bar is visible at the bottom of the window, indicating that the backtest is complete. The 'スタート' (Start) button is also visible.

(7) “グラフ”のタブを押すと、損益グラフが確認出来る



MT4を使ったバックテスト手順⑤

(8)“結果”のタブを押すと、取引利益が確認出来る

#	時間	取引種別	注文番号	数量	価格	決済逆指値...	決済指値(T...	損益	残高
226	2010.01.05 05:30	modify	16	0.10	92.579	92.808	90.728		
227	2010.01.05 05:30	modify	17	0.10	92.656	92.808	90.728		
228	2010.01.05 05:30	modify	18	0.10	92.684	92.808	90.728		
229	2010.01.05 05:30	modify	19	0.10	92.623	92.808	90.728		
230	2010.01.05 05:34	s/l	1	0.10	91.907	91.907	94.987	-110.11	9889.89
231	2010.01.05 05:34	s/l	2	0.10	91.907	91.907	94.987	-117.18	9772.70
232	2010.01.05 05:34	s/l	3	0.10	91.907	91.907	94.987	-107.72	9664.98
233	2010.01.05 05:34	s/l	4	0.10	91.907	91.907	94.987	-126.64	9538.34
234	2010.01.05 05:34	s/l	5	0.10	91.907	91.907	94.987	-128.06	9410.28
235	2010.01.05 05:35	modify	10	0.10	92.636	92.727	90.647		
236	2010.01.05 05:35	modify	11	0.10	92.537	92.727	90.647		
237	2010.01.05 05:35	modify	12	0.10	92.596	92.727	90.647		
238	2010.01.05 05:35	modify	13	0.10	92.359	92.727	90.647		

テスト

セッティング **結果** グラフ | レポート | 操作履歴 |

項目（用語）	説明
① #	注文を行った順番
②時間	約定（やくじょう）時間
③取引種別	注文の種類
④注文番号	約定したポジションのNO（順番）
⑤数量	ロット数（1万通貨＝0.1、1000通貨＝0.01と表示）
⑥価格	約定（約定）したレート
⑦S/L決済逆指値	ストップ（決済逆指値）注文の価格
⑧T/P決済指値	リミット（決済指値）注文の価格
⑨損益	保有ポジション毎の決済、確定損益
⑩残高	現金残高

MT4を使ったバックテスト手順⑥

(9)“レポート”のタブを押すと、成績が確認出来る

×	テストバー数	2678142	モデルティック数	5347801	モデリング品質	n/a
	不整合チャートエラー	0				
	初期証拠金	10000.00			スプレッド	12
	純益	72775.15	総利益	282168.85	総損失	-209393.70
	プロフィットファクタ	1.35	期待利得	7.11		
	絶対ドローダウン	843.83	最大ドローダウン	6159.09 (23.07%)	相対ドローダウン	23.07% (6159.09)
	総取引数	10232	売りポジション(勝率%)	5565 (59.89%)	買いポジション(勝率%)	4667 (70.69%)
			勝率(%)	6632 (64.82%)	負率(%)	3600 (35.18%)
		最大	勝トレード	585.33	敗トレード	-247.03
		平均	勝トレード	42.55	敗トレード	-58.16
		最大	連勝(金額)	66 (3810.25)	連敗(金額)	27 (-1677.17)
		最大	連勝(トレード数)	5244.24 (33)	連敗(トレード数)	-2024.84 (18)
		平均	連勝	6	連敗	3
テストター	セッティング	結果	グラフ	レポート	操作履歴	https://www.mql5.com/ja/articles/1486 詳しい計算式は左記載のURLへ

MT4を使ったバックテスト手順⑦

項目	説明	項目	説明
通貨ペア	通貨ペア	相対ドローダウン	全取引中の最大損失
期間	検証した時間軸	総取引数	取引回数の合計
テストバー数	バックテストに使用したロウソク足の本数	売りポジション(勝率%)	売りポジションの取引回数(勝率)
モデルティック数	バックテストに使用したティック数	買いポジション(勝率%)	買いポジションの取引回数(勝率)
モデリング品質	時間軸が短いほど高い数値	勝率(%)	利益が出た取引回数(割合)
不整合チャートエラー	エラーのあったバーの数	負率(%)	損失が出た取引回数(割合)
初期証拠金	初期の証拠金額	最大勝トレード	全取引中の最大利益
スプレッド	買値と売値の差	最大敗トレード	全取引中の最大損失
純益	総利益 - 総損失	平均勝トレード	全取引中の平均利益
総利益	バックテスト中に確定した利益の合計	平均敗トレード	全取引中の平均利益
総損失	バックテスト中に確定した損失の合計	最大連勝(金額)	連勝取引の金額合計
プロフィットファクタ	期間中の利益を損失で割った値	最大連敗(金額)	連敗取引の金額合計
期待利得	総純損益／取引回数	最大連勝(トレード数)	最大連勝取引回数
絶対ドローダウン	初期投資額からの下落幅	最大連敗(トレード数)	最大連敗取引回数
最大ドローダウン	最大資産からの下落幅	平均連勝	平均連勝取引回数
		平均連敗	平均連敗取引回数

バックテスト結果の分析①(MT4編)

(1) “レポート”のタブにて、右クリック
⇒ “レポートの保存”

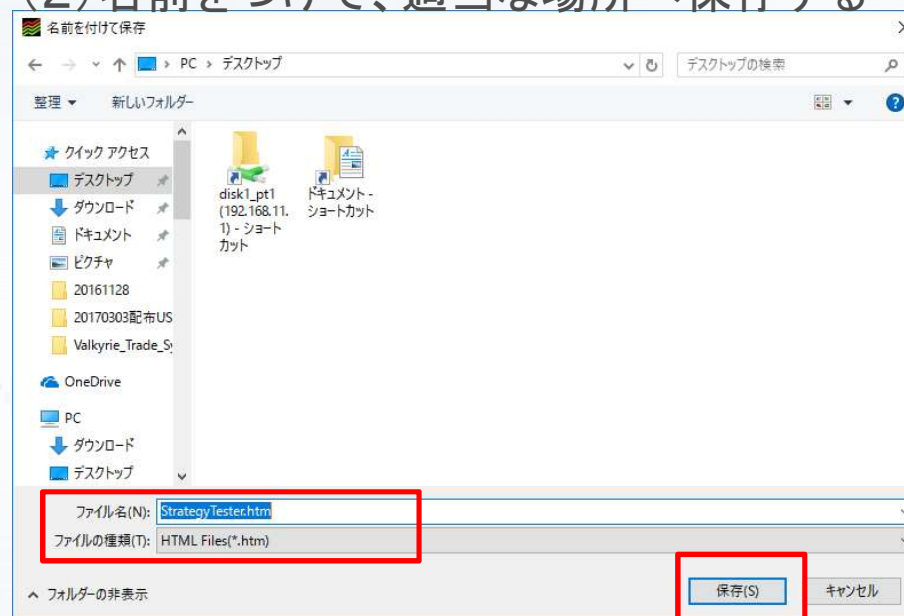
テストバー数	2678142	モデルティック数
不整合チャートエラー	0	
初期証拠金	10000.00	
純益	72775.15	総利益
プロフィットファクタ	1.35	期待利得
絶対ドローダウン	843.83	最大ドローダウン
総取引数	10232	売りポジション(勝)
		勝率(%)
	最大	勝トレード
	平均	勝トレード
	最大	連勝(金額)
	最大	連勝(トレード数)
	平均	連勝

コピー (C) Ctrl+C

レポートの保存 (S)

テストバー | セッティング | 結果 | グラフ | レポート | 操作履歴

(2) 名前をつけて、適当な場所へ保存する



バックテスト結果の分析②(MT4編)

(3) 保存されると、自動的に成績が表示される

Strategy Tester Report
TrendTiger_USDJPY_20170303
Alpari-Demo (Build 1045)

通貨ペア USDJPY (US Dollar vs Japanese Yen)
期間 1分足(M1) 2010.01.04 00:00 - 2017.03.17 22:59 (2010.01.01 - 2017.03.19)
モデル 始値のみ (バーの始めにしか動かないEA向け)

パラメータ

lots=0.1; MagicNumber=777; itemCount_time1=39; itemCount_time2=10; itemCount_time3=1; itemCount_time4=39; itemCount_time6=44;
itemCount_time7=1; itemCount_time8=48; AO11=1; AO12=15; AO13=2; AO14=8; AO16=50; AO17=49; AO18=1; time1=15; time2=15; time3=30;
time4=30; time6=15; time7=15; time8=5; time5=15; ADX_period_time5=1; time25=30; AAA=4; ma_period_time25=36; Const_Buy_time25=1.1375;
Const_Sell_time25=0.118; time26=30; BBB=4; ma_period_time26=34; Const_Buy_time26=0.5568; Const_Sell_time26=0.6144; time27=60; time28=5;
ma_period_time27=32; Const_Buy_time27=0.0247; Const_Sell_time27=1.8884; time28=60; DDD=2; ma_period_time28=25;
Const_Buy_time28=0.3786; Const_Sell_time28=1.8106; time31=60; FFF=10; ma_period_time31=50; Const_Buy_time31=0.4816;
Const_Sell_time31=1.9072; time32=60; GGG=5; ma_period_time32=39; Const_Buy_time32=3.2768; Const_Sell_time32=1.0519; time33=60; HHH=9;
ma_period_time33=14; Const_Buy_time33=0.0304; Const_Sell_time33=2.945; time34=60; III=6; ma_period_time34=32; Const_Buy_time34=3.1438;
Const_Sell_time34=0; time29=5; wpr_period_time29=1; wpr_conts_buy_time29=-70; wpr_conts_sell_time29=-30; time30=5; wpr_period_time30=1;
wpr_conts_buy_time30=-70; wpr_conts_sell_time30=-30; force_period_time1=24; force_period_time2=40; force_period_time3=40;
force_period_time4=29; force_period_time6=30; force_period_time7=19; force_period_time8=19; Const_sell_time1=0.0327; Const_sell_time2=0.1536;
Const_sell_time3=3.3536; Const_sell_time4=2.4165; Const_sell_time6=1.6385; Const_sell_time7=0; Const_sell_time8=0; Const_buy_time1=0.0752;
Const_buy_time2=0.2048; Const_buy_time3=0.6333; Const_buy_time4=0.5263; Const_buy_time6=3.1368; Const_buy_time7=0.5263;
Const_buy_time8=0.4096; spread=3; sl_sell1=38; sl_sell2=24; sl_sell3=159; sl_sell4=93; sl_sell5=159; sl_sell6=58; sl_sell7=179; sl_sell8=168;
sl_sell9=183; sl_sell10=136; sl_sell11=199; sl_sell12=82; sl_sell13=78; sl_buy1=1; sl_buy2=20; sl_buy3=187; sl_buy4=126; sl_buy5=65; sl_buy6=186;
sl_buy7=131; sl_buy8=180; sl_buy9=78; sl_buy10=27; sl_buy11=27; sl_buy12=36; sl_buy13=129; tp_buy1=129; tp_buy2=112; tp_buy3=130;
tp_buy4=75; tp_buy5=136; tp_buy6=10; tp_buy7=32; tp_buy8=164; tp_buy9=163; tp_buy10=196; tp_buy11=179; tp_sell1=197; tp_sell2=16;
tp_sell3=193; tp_sell4=166; tp_sell5=136; tp_sell6=158; tp_sell7=24; tp_sell8=181; tp_sell9=97; tp_sell10=44; tp_sell11=130; time11=5;
waite_BUY1=1000; waite_SELL1=1000; waite_BUY3=1000; waite_SELL3=1000; waite_BUY4=1000; waite_SELL4=1000; waite_BUY5=1000;
waite_SELL5=1000; waite_BUY6=15; waite_SELL6=15; time12=60; band_period_time12=100; sigma_time12=10; time13=60;
band_period_time13=100; sigma_time13=10; time14=60; band_period_time14=100; sigma_time14=10; time15=60; band_period_time15=100;
sigma_time15=10; time16=30; band_period_time16=100; sigma_time16=10; time17=30; band_period_time17=100; sigma_time17=10; time20=15;
band_period_time20=100; sigma_time20=10; time21=15; band_period_time21=100; sigma_time21=10; time22=5; band_period_time22=100;
sigma_time22=10; time18=5; time19=15; ADX_time5_Const1=10; ADX_time5_Const2=20; ADX_time5_Const3=30; ADX_time5_Const4=40;
ADX_time5_Const5=50; ADX_time5_Const6=60; ADX_time5_Const7=70; ADX_time5_Const8=80; ADX_time5_Const9=90; ADX_time5_Const10=100;
BuyEntryMaxNumber=10; SellEntryMaxNumber=10;

テストバ
数
不
チャ
エ
リ
初
証
金
純
益
損
ハ
ロ
ン
グ

2678142	モデルティック数	5347801	モデリング品質	n/a
0				
10000.00	スプレッド			12
72775.15	総利益	282168.85	総損失	-209393.70

EA名 TrendTiger_USDJPY_20170303

Alpari-Demo (Build 1045)

通貨名

通貨ペア USDJPY (US Dollar vs Japanese Yen)

テストした時間軸
とその期間

期間 1分足(M1) 2010.01.04 00:00 - 2017.03.17 22:59 (2010.01.01 - 2017.03.19)

モデル 始値のみ (バーの始めにしか動かないEA向け) テストのモデル名



バックテスト結果の分析③(MT4編)

(4)MT4の“レポート”タブで見た数値

テストバー	2678142	モデルティック数	5347801	モデリング品質	n/a
不整合チャートエラー	0				
初期証拠金	10000.00			スプレッド	12
純益	72775.15	総利益	282168.85	総損失	-209393.70
期待利得	1.35		7.11		
絶対ドロウダウン	843.83	最大ドロウダウン	6159.09 (23.07%)	相対ドロウダウン	23.07% (6159.09)
総取引数	10232	売りポジション(勝率%)	5565 (59.89%)	買いポジション(勝率%)	4667 (70.69%)
	勝率(%)		6632 (64.82%)	負率(%)	3600 (35.18%)
最大 勝トレード			585.33	敗トレード	-247.03
平均 勝トレード			42.55	敗トレード	-58.16
最大 連勝(金額)			66 (3810.25)	連敗(金額)	27 (-1677.17)
最大 連勝(トレード数)			5244.24 (33)	連敗(トレード数)	-2024.84 (18)
平均 連勝			6	連敗	3

バックテスト結果の分析④(myfxbook編)

【Step1】myfxbookへログインする

【Step2】MT4から出力したバックテスト結果をmyfxbookへアップロードする

【Step3】myfxbookでバックテスト結果が分析され、さらに詳細に分析可能となる

(5)「最適ロット数目安表」の中のURLをクリックして、myfxbookへログインする

資金	Lot数	Name	Gain	Drawdown	Pips	URL
▼	▼	▼	▼	▼	▼	
¥500,000	0.30	TT500000_0.30Lot	3905.94%	54.19	74034.8	http://www.myfxbook.com/strategies/tt500000-030lot/116016
¥400,000	0.30	TT400000_0.30Lot	5599.78%	66.53	82388	http://www.myfxbook.com/strategies/tt400000-030lot/116015
¥400,000	0.15	TT400000_0.15Lot	2695.82%	41.18	79383	http://www.myfxbook.com/strategies/tt400000-015lot/116013

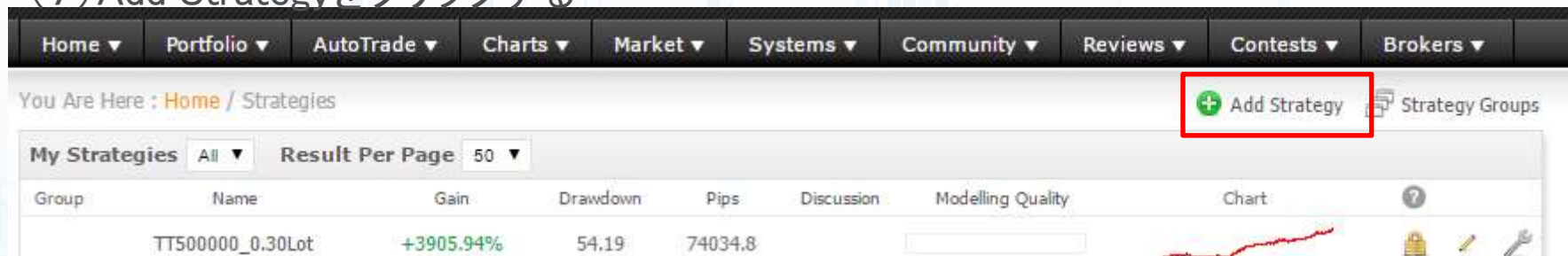
ここをクリックする

バックテスト結果の分析⑤(myfxbook編)

(6)ログイン後、メニューのSystem→Strategiesをクリックする



(7)Add Strategyをクリックする



FXの学校なりのバックテスト結果の分析⑥(myfxbook編)

あおのり学校

(8) Strategy Reportの“Browse”をクリック

Home ▼ Portfolio ▼ AutoTrade ▼ Charts ▼ Market ▼ Systems ▼ Community ▼ Reviews ▼ Contests ▼ Brokers ▼

You Are Here : Home / Strategies + Add Strategy 📁 Strategy Groups

Add Strategy

Please choose the strategy tester report file (back-test; *.htm) - you may zip the file for faster data upload (*.zip). Additional relevant files such as the expert advisors, images and notes can be added to the strategy later. Strategies are private by default - use the settings shortcut to make it public.
The statement should be processed within 60 seconds - if it doesn't, [please contact us](#).
In order to make the strategy public, you must link a public forward test (a fully verified, public system from your portfolio).

Strategy Report *:

Strategy files (mq4, ex4, dll, etc.):

開く

PC > デスクトップ >

整理 ▼ 新しいフォルダー

- ★ クイック アクセス
- デスクトップ
- ダウンロード
- ドキュメント
- ピクチャ

AlpacaAlgo -ポジションサイジング仕様 -日本語.pdf

Alparimt4setup.exe

avafinancia l4setup.exe

Bridgewater Associates-Ray-Dalio-Principle...

disk1_pt1 (192.168.11.1) - ショートカット

FFCal.mq4

FFCal_minij Rzip

Lhaplus

LINE

NoEditor

notepad++.exe - ショートカット

PHOTOSCAPE

PictBear

ray_dalio_how_the_economic_machine_works.pdf

ray_dalio_how_the_economic_machine_works.pdf

StrategyTester.gif

StrategyTester.htm

wxMaxima (GUI for Maxima)

*Required Fields. Only MetaTrader 4 strategy reports are supported at the moment.

Add Cancel

(9) 開いた画面で、MT4から出力したバックテスト結果を選択する

バックテスト結果の分析⑦(myfxbook編)

(10)Nameを入力後、“Add”をクリック

Add Strategy

Please choose the strategy tester report file (back-test; *.htm) - you may zip the file for faster data upload (*.zip). Additional relevant files such as the expert advisors, images and notes can be added to the strategy later. Strategies are private by default - use the settings shortcut to make it public.
The statement should be processed within 60 seconds - if it doesn't, [please contact us](#).
In order to make the strategy public, you must link a public forward test (a fully verified, public system from your portfolio).

Strategy Report *: StrategyTester_xi.htm [Remove](#)

Strategy files (mq4, ex4, dll, etc'):

Name *:

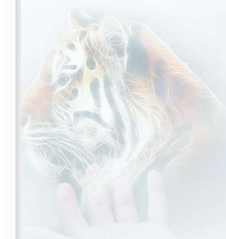
Broker:

Privacy:

Forward Test:

Comment:

*Required Fields. Only MetaTrader 4 strategy reports are supported at the moment.

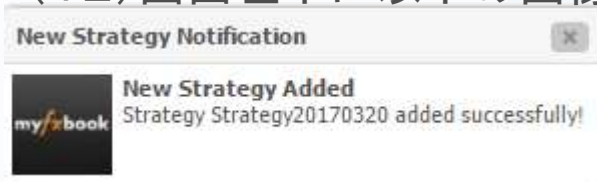


FXの学校な^らあおのり学校 バックテスト結果の分析⑦(myfxbook編)

(11)バックテスト結果の分析が開始

My Strategies All ▼ Result Per Page 10 ▼							
Group	Name	Gain	Drawdown	Pips	Discussion	Modelling Quality	Chart
	Strategy20170320	Strategy is being processed					

(12)画面左下に以下の画像が出ると分析終了



(13)再度、ブラウザーを更新して、Nameをクリックする

My Strategies All ▼ Result Per Page 50 ▼							
Group	Name	Gain	Drawdown	Pips	Discussion	Modelling Quality	Chart
	Strategy20170320	+727.75%	23.07	81223.9			

バックテスト結果の分析⑧(myfxbook編)

(14)分析結果を見ることが出来る

You Are Here : [Home](#) / [Strategies](#) / [aononritclub](#) / Strategy20170320

[CSV](#) [Discuss](#) [Custom Analysis](#)

Strategy Settings

lots	0.1	MagicNumber	777	itemCount_time1	39
itemCount_time2	10	itemCount_time3	1	itemCount_time4	39
itemCount_time5	44	itemCount_time7	1	itemCount_time8	48
AOI1	1	AOI2	15	AOI3	2
AOI4	8	AOI6	50	AOI7	49

[More](#)

Files:

Forward test is not available.

Info	Stats	General
Gain: +727.75%		
Daily:	0.08%	
Monthly:	2.44%	
Drawdown:	23.07%	
Balance:	\$82.8K	
Highest:	(Mar 09) \$82.9K	
Profit:	\$72775.15	
Deposits:	\$10000.00	
Test Started:	Jan 04, 2010	
Test Ended:	Mar 17, 2017	
Timeframe:	1 Minute	
Model Type:	n/a	
Added:	5 Minutes ago	

Chart



Advanced Statistics

Trades	Summary	Hourly	Daily	Risk Of Ruin	Duration
Trades:	10232	Longs Won:	(3299/4667) 70%	Profit Factor:	1.35
Profitability:		Shorts Won:	(3333/5565) 59%	Standard Deviation:	\$67.54
Pips:	81223.9	Best Trade(\$):	(May 06) \$85.33	Sharpe Ratio:	0.0000
Average Win:	42.53 pips / \$42.55	Worst Trade(\$):	(Nov 18) -247.03	Z-Score (Probability):	-50.45 (99.99%)
Average Loss:	-55.78 pips / -\$58.17	Best Trade (Pips):	(May 06) 517.9	Expectancy:	7.9 Pips / \$7.11
Lots:	1,023.2	Worst Trade (Pips):	(Feb 23) -188.2	AHPR:	0.02%
Commissions:	0	Avg. Trade Length:	1d	GHPR:	0.02%

Trading Activity (10232)

Open Date	Close date	Symbol	Action	Lots	SL	TP	Open Price	Close Price	Pips	Profit	Duration	Change
03.17.2017 16:30	03.17.2017 22:59	USDJPY	Sell	0.10	113.36700	111.28700	112.74400	112.67300	7.1	6.30	6h 29m	0.01%
03.15.2017 23:30	03.16.2017 16:49	USDJPY	Sell	0.10	113.78400	111.70400	113.38500	113.27500	11.0	7.37	17h 19m	0.01%
03.15.2017 22:05	03.16.2017 16:48	USDJPY	Sell	0.10	113.78400	111.70400	113.33600	113.26700	6.9	3.75	18h 43m	0.00%
03.15.2017 22:55	03.16.2017 16:47	USDJPY	Sell	0.10	113.78400	111.70400	113.43200	113.25600	17.6	13.20	17h 52m	0.02%
03.15.2017 21:05	03.16.2017 16:47	USDJPY	Sell	0.10	113.78400	111.70400	113.42900	113.25600	17.3	12.94	19h 42m	0.02%
03.16.2017 00:05	03.16.2017 16:47	USDJPY	Sell	0.10	113.78400	111.70400	113.47700	113.25600	22.1	19.51	16h 42m	0.02%
03.15.2017 20:50	03.16.2017 16:46	USDJPY	Sell	0.10	113.78400	111.70400	113.47200	113.24600	22.6	17.62	19h 56m	0.02%
03.15.2017 23:45	03.16.2017 16:46	USDJPY	Sell	0.10	113.78400	111.70400	113.44400	113.24600	19.8	15.14	17h 1m	0.02%
03.15.2017 23:15	03.16.2017 16:46	USDJPY	Sell	0.10	113.78400	111.70400	113.37800	113.24600	13.2	9.32	17h 31m	0.01%
03.15.2017 21:25	03.16.2017 16:46	USDJPY	Sell	0.10	113.78400	111.70400	113.55000	113.24600	30.4	24.50	19h 21m	0.03%
03.15.2017 22:30	03.16.2017 16:46	USDJPY	Sell	0.10	113.78400	111.70400	113.35600	113.24600	11.0	7.37	18h 16m	0.01%
03.15.2017 13:00	03.15.2017 20:47	USDJPY	Buy	0.10	113.50100	116.58100	114.66100	113.50100	-116.0	-102.26	7h 47m	-0.12%
03.15.2017 13:15	03.15.2017 20:47	USDJPY	Buy	0.10	113.50100	116.58100	114.63300	113.50100	-113.2	-99.79	7h 32m	-0.12%
03.15.2017 13:50	03.15.2017 20:47	USDJPY	Buy	0.10	113.50100	116.58100	114.60800	113.50100	-110.7	-97.58	6h 57m	-0.12%
03.15.2017 20:35	03.15.2017 20:44	USDJPY	Sell	0.10	114.79700	113.70700	113.95100	113.70700	24.4	21.45	9m	0.03%
03.14.2017 16:45	03.15.2017 10:50	USDJPY	Sell	0.10	115.33500	113.25500	114.61300	114.63100	-1.8	-2.35	18h 5m	0.00%
03.10.2017 01:25	03.14.2017 09:25	USDJPY	Buy	0.10	114.19600	117.27600	115.11200	115.14800	3.6	2.98	4d	0.00%
03.09.2017 16:00	03.14.2017 09:00	USDJPY	Buy	0.10	114.19600	117.27600	114.83900	115.02800	18.9	16.21	4d	0.02%
03.09.2017 11:00	03.14.2017 00:45	USDJPY	Buy	0.10	114.19600	117.27600	114.88500	114.93500	5.0	4.13	4d	0.00%
03.09.2017 17:25	03.14.2017 00:45	USDJPY	Buy	0.10	114.19600	117.27600	114.88100	114.93500	5.4	4.48	4d	0.01%

Previous **1** 2 3 4 5 .. 512 Next

Monthly Analytics



バックテスト結果の分析⑨(myfxbook編)

(15) 月利、日利

(16) 平均ポジション保有時間

Info	Stats	General
Gain: +727.75%		
Daily:	0.08%	
Monthly:	2.44%	
Drawdown:	23.07%	
Balance:	\$82.8K	
Highest:	(Mar 09) \$82.9K	
Profit:	\$72775.15	
Deposits:	\$10000.00	
Test Started:	Jan 04, 2010	
Test Ended:	Mar 17, 2017	
Timeframe:	1 Minute	
Model Type:	n/a	
Added:	5 Minutes ago	

Advanced Statistics	Trades	Summary	Hourly	Daily	Risk Of Ruin	Duration
Trades:	10232	Longs Won:	(3299/4667) 70%	Profit Factor:	1.35	
Profitability:		Shorts Won:	(3333/5565) 59%	Standard Deviation:	\$67.54	
Pips:	81223.9	Best Trade(\$):	(May 06) 585.33	Sharpe Ratio:	0.0000	
Average Win:	42.53 pips / \$42.55	Worst Trade(\$):	(Nov 18) -247.03	Z-Score (Probability):	-50.45 (99.99%)	
Average Loss:	-55.78 pips / -\$58.17	Best Trade (Pips):	(May 06) 517.9	Expectancy:	7.9 Pips / \$7.11	
Lots:	1,023.2	Worst Trade (Pips):	(Feb 23) -188.2	AHPR:	0.02%	
Commissions:	0	Avg. Trade Length:	1d	GHPR:	0.02%	

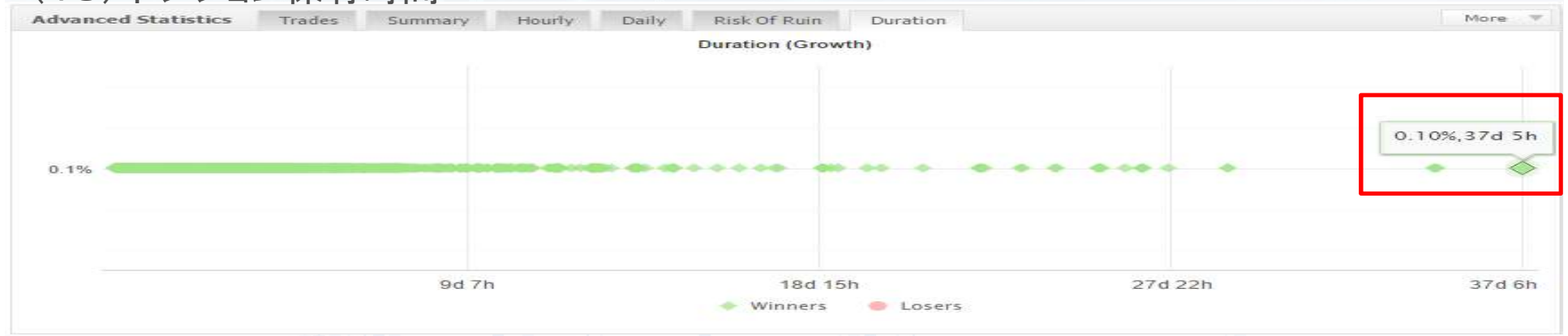
(17) 破産のリスク

Advanced Statistics	Trades	Summary	Hourly	Daily	Risk Of Ruin	Duration					
Loss Size		100%	90%	80%	70%	60%	50%	40%	30%	20%	10%
Probability of Loss		<0.01%	<0.01%	<0.01%	<0.01%	<0.01%	<0.01%	<0.01%	<0.01%	<0.01%	<0.01%
Consecutive Losing Trades		1422	1280	1138	996	853	711	569	427	284	142

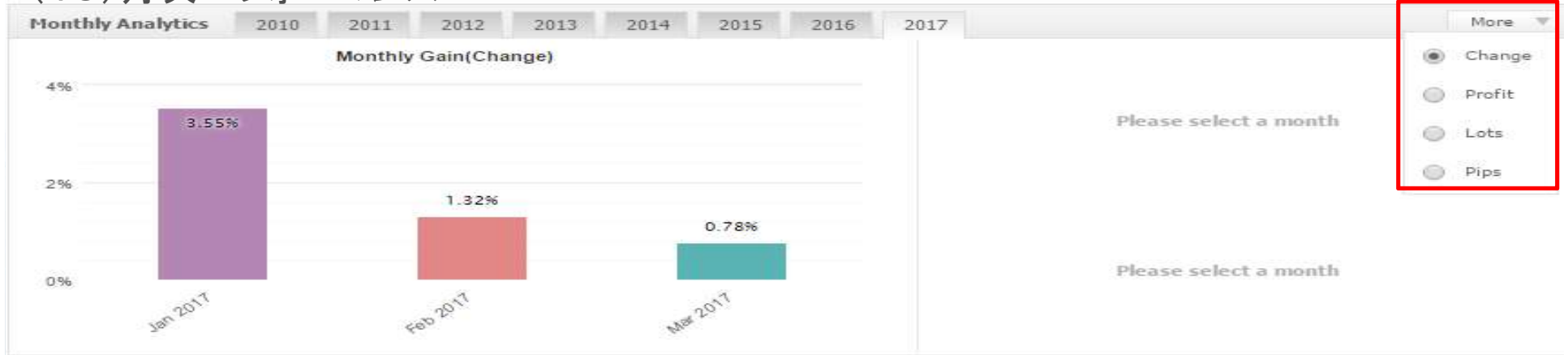
Hover over the desired column for a detailed explanation.

バックテスト結果の分析⑩(myfxbook編)

(18)ポジション保有時間



(19)月次パフォーマンス



バックテスト結果の分析⑪(myfxbook編)

(20)期間を区切った分析

①Custom Analysisを選択

You Are Here : [Home](#) / [Strategies](#) / [aonorittclub](#) / Strategy20170320

CSV

Discuss

Custom Analysis

1D 1W 1M 3M 6M 1Y ALL

Start:

01/04/2010 00:00

End:

03/17/2017 00:00

Analyze

②開示日時&終了日時を入力

③Analyzeをクリック

Timing

Trade

Day of Week (None)

- ☒ Sunday
- ☒ Monday
- ☒ Tuesday
- ☒ Wednesday
- ☒ Thursday
- ☒ Friday
- ☒ Saturday

Hour of Day (None)

- | | | | |
|---------------------------------------|--|--|--|
| ☒ 0 | ☒ 7 | ☒ 14 | ☒ 21 |
| ☒ 1 | ☒ 8 | ☒ 15 | ☒ 22 |
| ☒ 2 | ☒ 9 | ☒ 16 | ☒ 23 |
| ☒ 3 | ☒ 10 | ☒ 17 | |
| ☒ 4 | ☒ 11 | ☒ 18 | |
| ☒ 5 | ☒ 12 | ☒ 19 | |
| ☒ 6 | ☒ 13 | ☒ 20 | |

Analyze by

- ☐ Open time
- ☒ Close time

☒ Show actual growth

Monthly:	2.44%
Drawdown:	23.07%
Balance:	\$82.8K

1K%



バックテスト結果の分析⑫(myfxbook編)

(21)2010年1月から2012年3月の分析



Advanced Statistics

Trades

Summary

Hourly

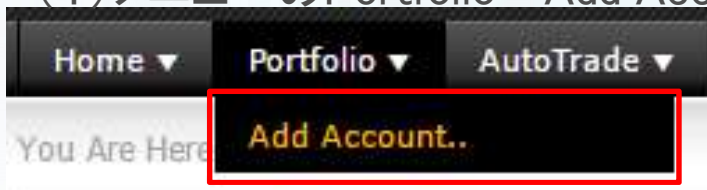
Daily

Risk Of Ruin

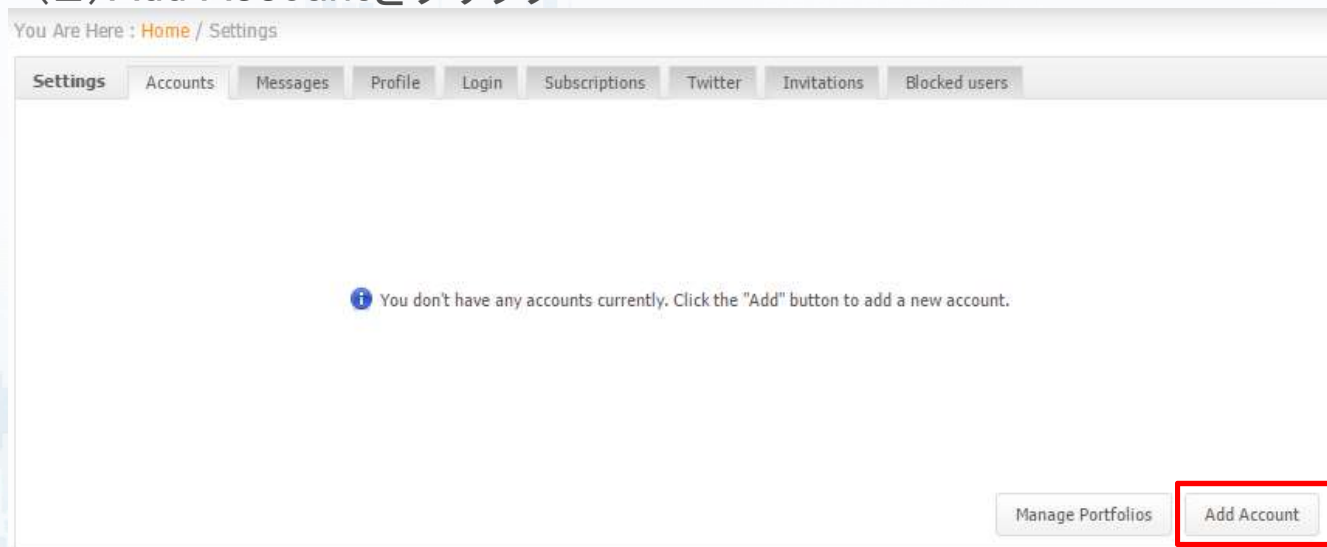
Duration

リアルタイム成績の計測①(myfxbook編)

(1)メニューのPortfolio→Add Accountをクリック

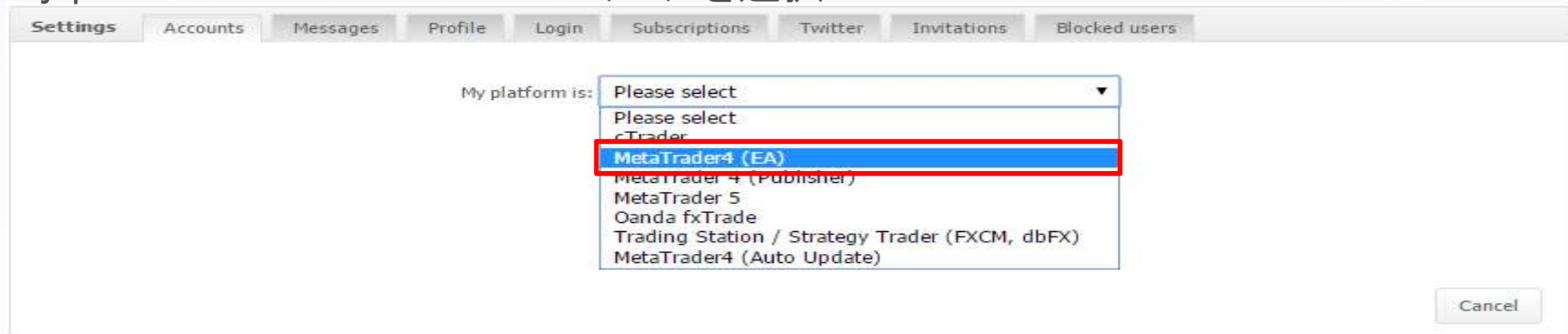


(2)Add Accountをクリック



リアルタイム成績の計測②(myfxbook編)

(3) My platform isにて“MetaTrader4(EA)”を選択



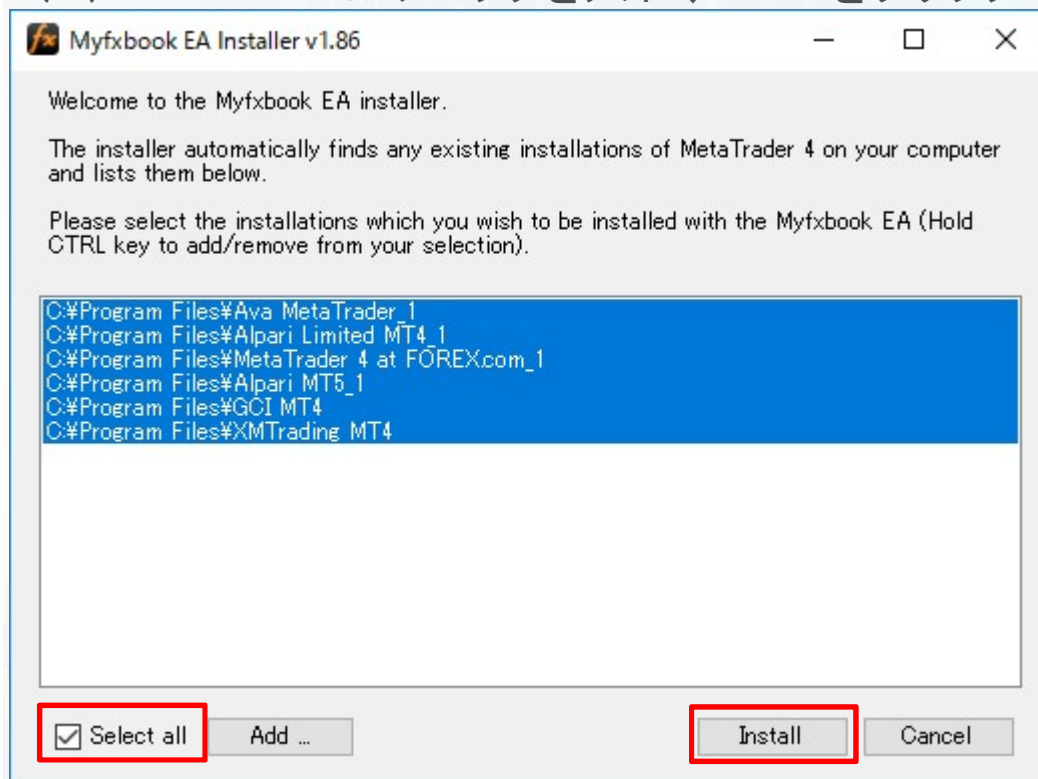
(4) インストールファイル“EaInstaller.exe”がダウンロードされるので、それを保存



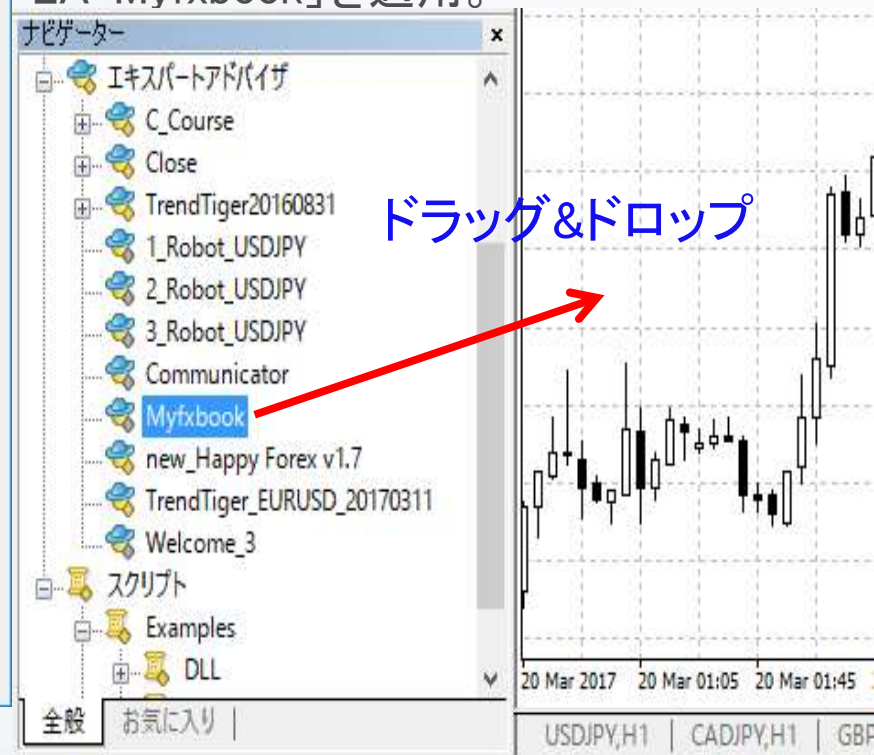
(5) “EaInstaller.exe”をダブルクリックし、インストールする
※この時、インストール対象のMT4を閉じる

リアルタイム成績の計測③(myfxbook編)

(6) “Select all”にチェックを入れ、Installをクリック

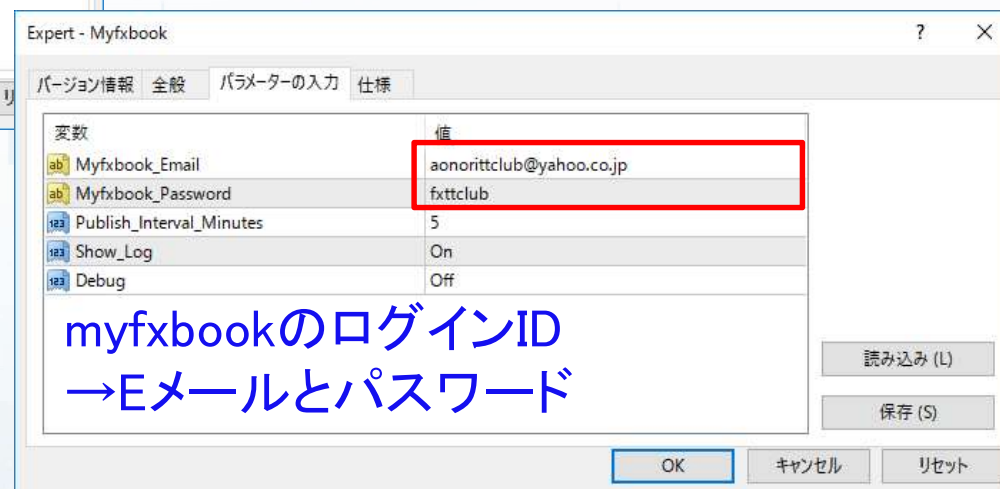
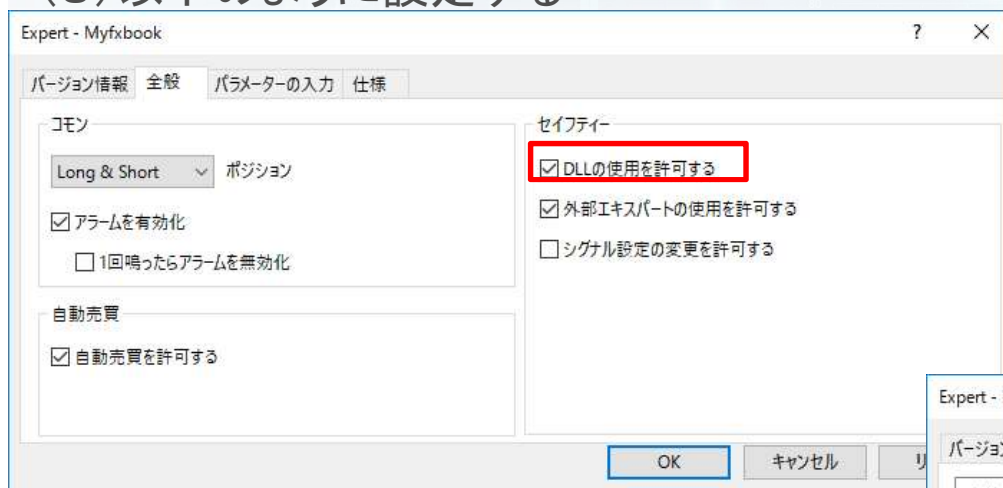


(7) MT4を起動し、新規チャートを開いて、EA「Myfxbook」を適用。



リアルタイム成績の計測④(myfxbook編)

(8) 以下のように設定する



myfxbookのログインID
→Eメールとパスワード

リアルタイム成績の計測⑤(myfxbook編)

(9)MT4 → Myfxbookへの送信間隔はデフォルト5分なので、5分程待つ

注文	自動売買	M1	M5	M15	M
▼ EURUSD,M5 1.07532 1.07536 1.07507 1.07521					
Myfxbook EA Version:1.86					
Last Publish: 2017.03.20 23:59					
Statement uploaded successfully					

(10)myfxbookのサイトを更新 → メニューのPortfolioの中、Mt-●●●をクリック



リアルタイム成績の計測⑥(myfxbook編)

FXの学校なら
あおのり学校

(11)以下のように、リアルタイム成績分析ページが完成

You Are Here : [Home](#) / [Portfolio](#) / Mt4-11665674 Custom Analysis

Mt4-11665674
Demo (USD), Other(MT4), MetaTrader 4

✖ Track Record Not Verified ⓘ
✖ Trading Privileges Not Verified ⓘ Discuss

Info Stats General

Gain: **+0.0%**
Abs. Gain: **+0.0%**

Daily: 0%
Monthly: 0.00%
Drawdown: 0.00%

Balance: \$2147483647.00
Equity: (100.00%) \$2147483647.00
Highest: (Mar 17) \$2147483647.00
Profit: \$0.00
Interest: \$0.00

Deposits: \$2147483647.00
Withdrawals: \$0.00

Updated: 1 minute ago
Tracking: 0

Chart Growth Balance Profit Drawdown More Export

You haven't made any trades yet apparently, so there are no statistics to show.

Trading Periods Goals Browser

	Gain (Difference)	Profit (Difference)	Pips (Difference)	Win % (Difference)	Trades (Difference)	Lots (Difference)
Today	+0.0% (-)	\$0.00 (-)	0.00 (-)	0% (-)	0 (-)	0.00 (-)
This Week	+0.0% (-)	\$0.00 (-)	0.00 (-)	0% (-)	0 (-)	0.00 (-)
This Month	+0.0% (-)	\$0.00 (-)	0.00 (-)	0% (-)	0 (-)	0.00 (-)
This Year	+0.0% (-)	\$0.00 (-)	0.00 (-)	0% (-)	0 (-)	0.00 (-)

Advanced Statistics Trades Summary Hourly Daily Risk Of Ruin Duration MAE/MFE

No data to display.

Trading Activity Open Trades (0) Open Orders (0) History (1) Exposure More

わからない人は <http://autofx-now.com/1910> を参照

リアルタイム成績の計測⑦(myfxbook編)

(12)リアルタイム計測中の自動売買例

<http://www.myfxbook.com/members/sybla/sybla-100m/1678565>

Info	
Gain:	+289.48%
Abs. Gain:	+289.48%
Daily:	0.35%
Monthly:	10.94%
Drawdown:	-42.04%
Balance:	¥3894816.00
Equity:	(91.37%) ¥3558590.00
Highest:	(Apr 05) ¥3894816.00
Profit:	¥2894816.00
Interest:	-¥73550.00
Deposits:	¥1000000.00
Withdrawals:	¥0.00
Updated:	6 Minutes ago
Tracking	4



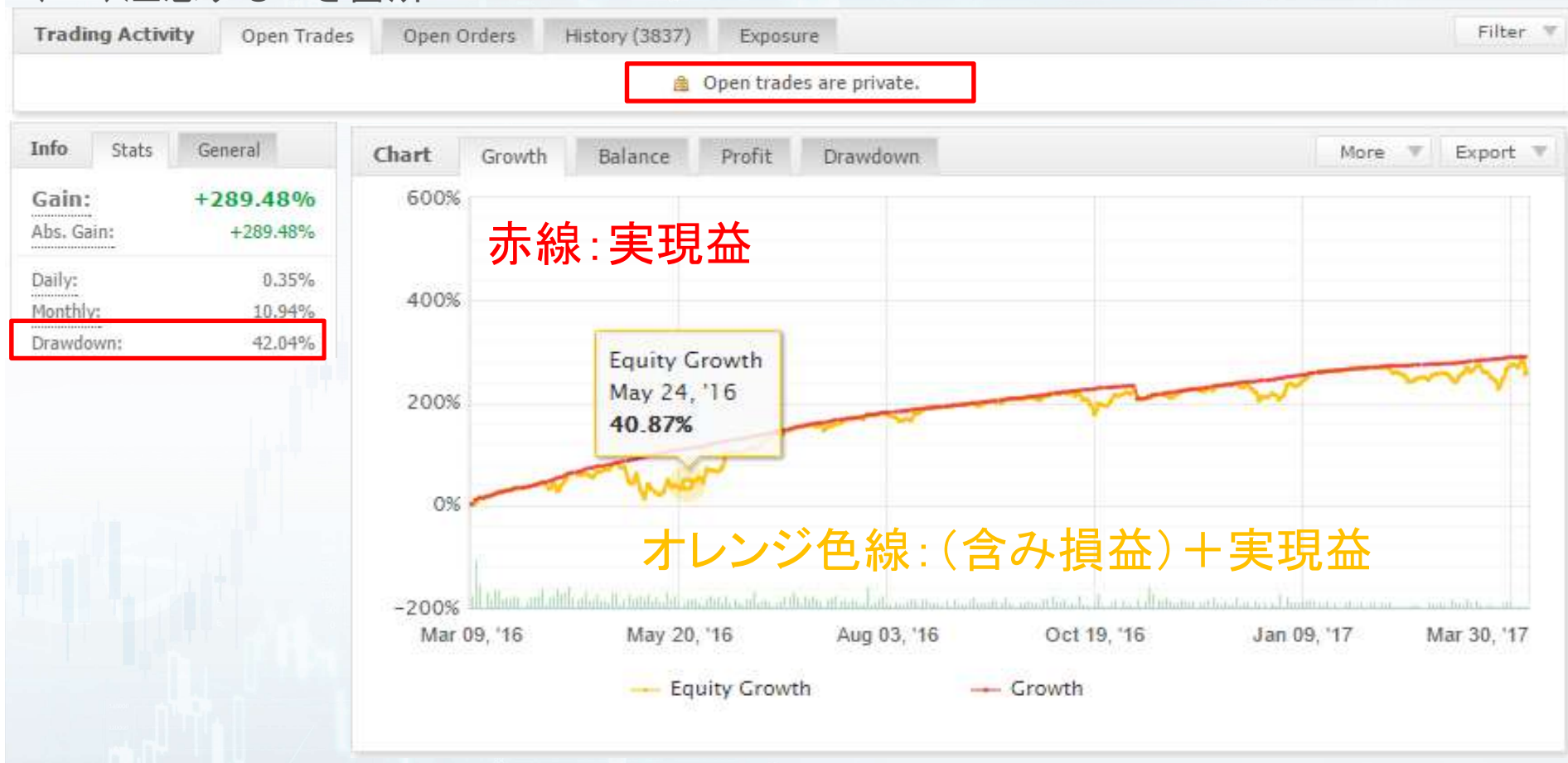
Trading	Periods	Goals	Browser			
	Gain (Difference)	Profit (Difference)	Pips (Difference)	Win % (Difference)	Trades (Difference)	Lots (Difference)
Today	+0.0% (-0.09%)	¥0.00 (-¥3389.00)	0.00 (-79.2)	0% (-100%)	0 (-4)	0.00 (-0.20)
This Week	+0.23% (-0.76%)	¥8904.00 (-¥29256.00)	210.00 (-749.7)	100% (0%)	12 (-31)	0.60 (-1.51)
This Month	+0.23% (-3.66%)	¥8904.00 (-¥136704.00)	210.00 (-4079.0)	100% (+11%)	12 (-197)	0.60 (-9.81)
This Year	+11.99% (-235.78%)	¥417078.00 (-¥2060660.00)	10486.70 (-51765.3)	95% (-3%)	524 (-2788)	25.80 (-140.58)

Advanced Statistics		Trades	Summary	Hourly	Daily	Risk Of Ruin	Duration	MAE/MFE	
Trades:		3836		Longs Won:		(1344/1410) 95%		Profit Factor:	11.54
Profitability:				Shorts Won:		(7424/2426) 99%		Standard Deviation:	¥1076.11
Pips:		72738.7		Best Trade(¥):		(Apr 18) 4243.00		Sharpe Ratio:	1.02
Average Win:		20.60 pips / ¥841.17		Worst Trade(¥):		(Nov 07) -19386.00		Z-Score (Probability):	-47.97 (99.99%)
Average Loss:		-71.95 pips / -¥4039.72		Best Trade (Pips):		(Dec 05) 231.3		Expectancy:	19.0 Pips / ¥754.64
Lots:		192.18		Worst Trade (Pips):		(Nov 07) -420.6		AHPR:	0.04%
Commissions:		¥0.00		Avg. Trade Length:		1d		GHPR:	0.04%

リアルタイム成績の計測⑧(myfxbook編)

(13) 注意すべき箇所

<http://www.myfxbook.com/members/sybla/sybla-100m/1678565>



リアルタイム成績の計測⑨(myfxbook編)

FXの学校なら
あおのり学校

(14) 注意するべき箇所

<http://www.myfxbook.com/members/sybla/sybla-100m/1678565>

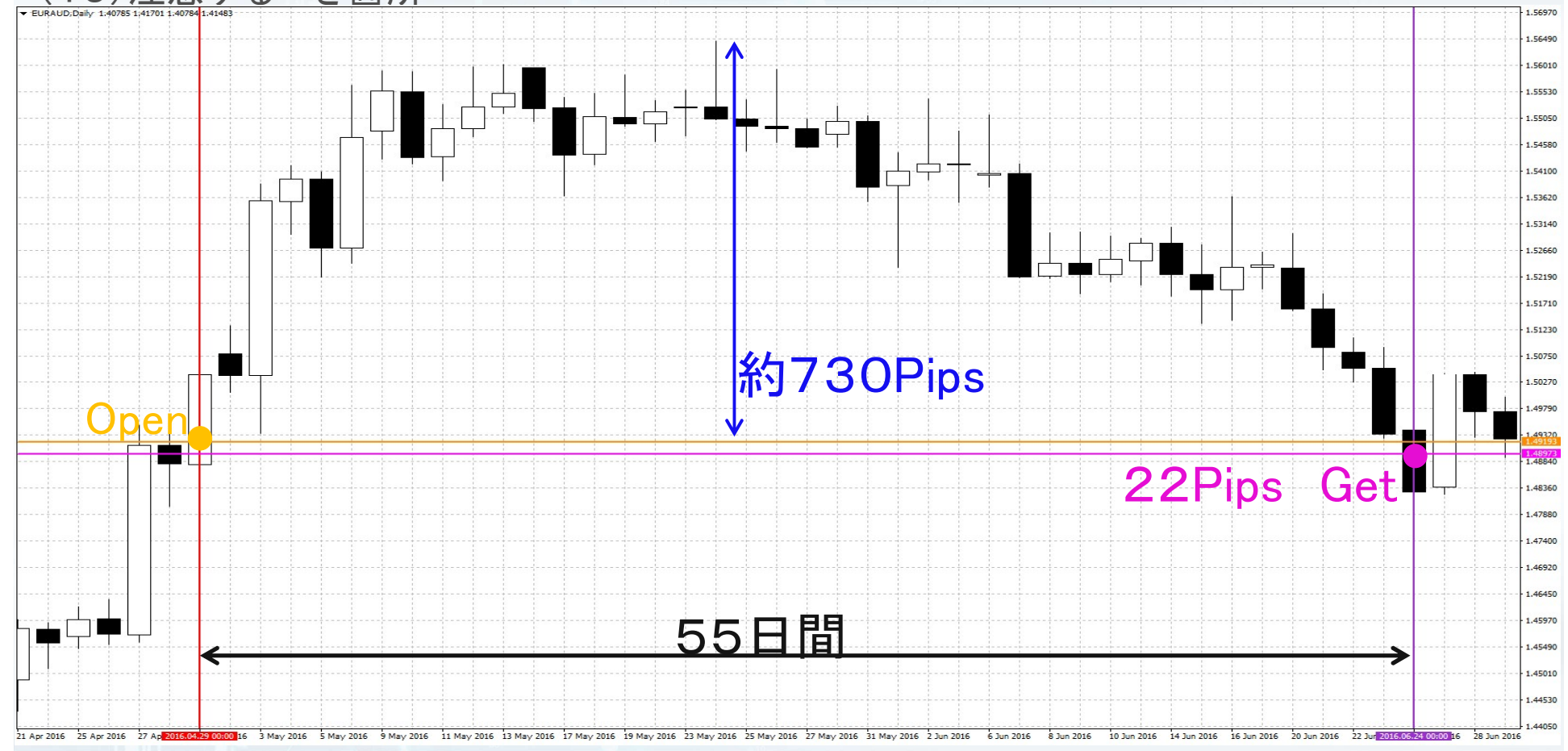
Trading Activity										
Open Trades		Open Orders		History (3837)		Exposure		Filter		
Open Date	Close date	Symbol	Action	Lots	Open Price	Close Price	Pips	Profit (JPY)	Duration	Gain
04.29.2016 13:07	06.24.2016 08:53	EURAUD	Sell	0.05	1.49193	1.48973	22.0	2122.00	55d	0.09%
04.28.2016 22:25	06.24.2016 15:50	EURAUD	Sell	0.05	1.48777	1.48579	19.8	2069.00	56d	0.09%
02.02.2017 10:04	03.10.2017 17:39	EURAUD	Buy	0.05	1.41056	1.41257	20.1	-1170.00	36d	-0.03%
02.02.2017 04:24	03.10.2017 17:40	EURAUD	Buy	0.05	1.41102	1.41300	19.8	-1182.00	36d	-0.03%
04.29.2016 15:06	06.23.2016 21:02	EURAUD	Sell	0.05	1.49578	1.49369	20.9	2109.00	55d	0.09%
04.29.2016 08:57	06.24.2016 15:06	EURAUD	Sell	0.05	1.48826	1.48623	20.3	2064.00	56d	0.09%
02.10.2017 05:10	03.29.2017 15:08	EURAUD	Buy	0.01	1.39350	1.40533	118.3	501.00	47d	0.01%
05.03.2016 11:20	06.08.2016 14:59	EURAUD	Sell	0.05	1.52428	1.52220	20.8	1664.00	36d	0.07%
05.03.2016 11:10	06.09.2016 00:01	EURAUD	Sell	0.05	1.52378	1.52178	20.0	1704.00	36d	0.08%
04.29.2016 10:01	06.24.2016 08:55	EURAUD	Sell	0.05	1.49047	1.48821	22.6	2146.00	55d	0.09%
05.03.2016 11:02	06.09.2016 00:01	EURAUD	Sell	0.05	1.52221	1.52017	20.4	1721.00	36d	0.08%
04.29.2016 10:01	06.24.2016 08:55	EURAUD	Sell	0.05	1.49013	1.48805	20.8	2078.00	55d	0.09%
05.03.2016 11:01	06.09.2016 02:35	EURAUD	Sell	0.05	1.52171	1.51973	19.8	1695.00	36d	0.07%
04.29.2016 13:19	06.24.2016 06:43	EURAUD	Sell	0.05	1.49216	1.49019	19.7	2020.00	55d	0.08%
04.28.2016 19:18	06.24.2016 16:59	EURAUD	Sell	0.05	1.48375	1.48176	19.9	2077.00	56d	0.09%
05.03.2016 07:40	06.15.2016 11:26	EURAUD	Sell	0.05	1.52031	1.51827	20.4	1795.00	43d	0.08%
05.03.2016 07:37	06.15.2016 11:27	EURAUD	Sell	0.05	1.51986	1.51776	21.0	1818.00	43d	0.08%
05.03.2016 07:30	06.15.2016 12:53	EURAUD	Sell	0.05	1.51851	1.51634	21.7	1847.00	43d	0.08%
05.03.2016 07:30	06.15.2016 13:09	EURAUD	Sell	0.05	1.51800	1.51579	22.1	1864.00	43d	0.08%
05.03.2016 07:30	06.15.2016 17:43	EURAUD	Sell	0.05	1.51619	1.51453	16.6	1645.00	43d	0.07%

Previous 1 2 3 4 5 .. 192 Next

リアルタイム成績の計測⑩(myfxbook編)

(15)注意すべき箇所

<http://www.myfxbook.com/members/sybla/sybla-100m/1678565>



FXの学校なら
あおのり学校

リアルタイム成績の計測⑪(myfxbook編)

(16) 注意すべき箇所

<http://www.myfxbook.com/members/sybla/sybla-100m/1678565>



リアルタイム成績の計測⑫(myfxbook編)
(17)注意すべき箇所

<http://www.myfxbook.com/members/sybla/sybla-100m/1678565>

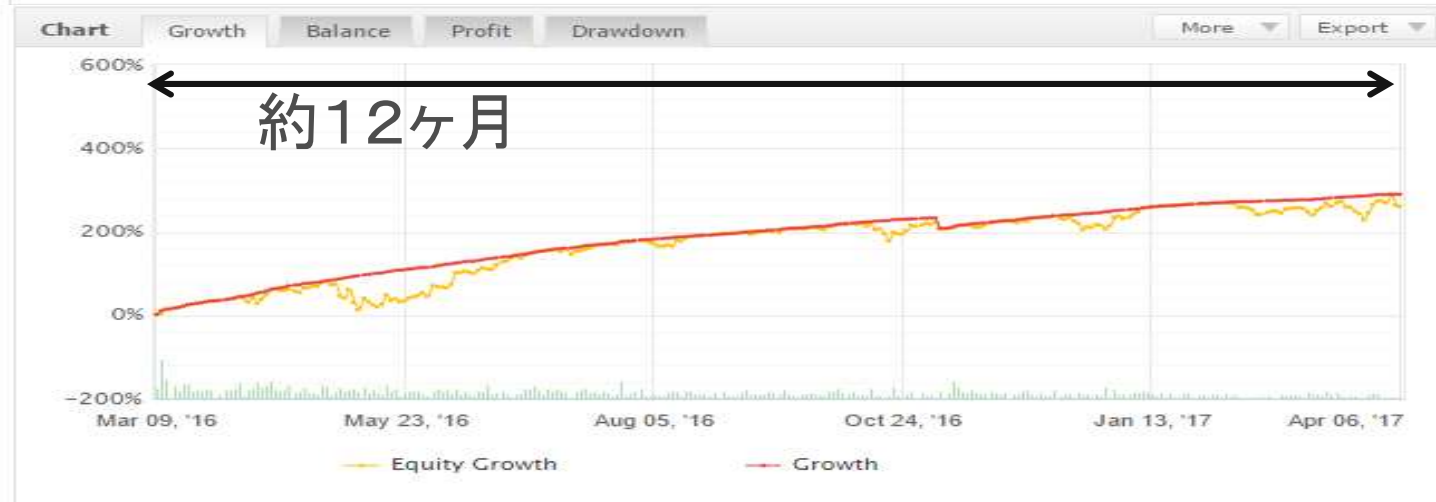
Trading Activity	Open Trades	Open Orders	History (3837)		Exposure							Filter
Open Date	Close date	Symbol	Action	Lots	Open Price	Close Price	Pips	Profit (JPY)	Duration	Gain		
04.29.2016 13:07	06.24.2016 08:53	EURAUD	Sell	0.05	1.49193	1.48973	22.0	2122.00	55d	0.09%		
04.28.2016 22:25	06.24.2016 15:50	EURAUD	Sell	0.05	1.48777	1.48579	19.8	2069.00	56d	0.09%		
02.02.2017 10:04	03.10.2017 17:39	EURAUD	Buy	0.05	1.41056	1.41257	20.1	-1170.00	36d	-0.03%		
02.02.2017 04:24	03.10.2017 17:40	EURAUD	Buy	0.05	1.41102	1.41300	19.8	-1182.00	36d	-0.03%		
04.29.2016 15:06	06.23.2016 21:02	EURAUD	Sell	0.05	1.49578	1.49369	20.9	2109.00	55d	0.09%		
04.29.2016 08:57	06.24.2016 15:06	EURAUD	Sell	0.05	1.48826	1.48623	20.3	2064.00	56d	0.09%		
02.10.2017 05:10	03.29.2017 15:08	EURAUD	Buy	0.01	1.39350	1.40533	118.3	501.00	47d	0.01%		
05.03.2016 11:20	06.08.2016 14:59	EURAUD	Sell	0.05	1.52428	1.52220	20.8	1664.00	36d	0.07%		
05.03.2016 11:10	06.09.2016 00:01	EURAUD	Sell	0.05	1.52378	1.52178	20.0	1704.00	36d	0.08%		
04.29.2016 10:01	06.24.2016 08:55	EURAUD	Sell	0.05	1.49047	1.48821	22.6	2146.00	55d	0.09%		
05.03.2016 11:02	06.09.2016 00:01	EURAUD	Sell	0.05	1.52221	1.52017	20.4	1721.00	36d	0.08%		
04.29.2016 10:01	06.24.2016 08:55	EURAUD	Sell	0.05	1.49013	1.48805	20.8	2078.00	55d	0.09%		
05.03.2016 11:01	06.09.2016 02:35	EURAUD	Sell	0.05	1.52171	1.51973	19.8	1695.00	36d	0.07%		
04.29.2016 13:19	06.24.2016 06:43	EURAUD	Sell	0.05	1.49216	1.49019	19.7	2020.00	55d	0.08%		
04.28.2016 19:18	06.24.2016 16:59	EURAUD	Sell	0.05	1.48375	1.48176	19.9	2077.00	56d	0.09%		
05.03.2016 07:40	06.15.2016 11:26	EURAUD	Sell	0.05	1.52031	1.51827	20.4	1795.00	43d	0.08%		
05.03.2016 07:37	06.15.2016 11:27	EURAUD	Sell	0.05	1.51986	1.51776	21.0	1818.00	43d	0.08%		
05.03.2016 07:30	06.15.2016 12:53	EURAUD	Sell	0.05	1.51851	1.51634	21.7	1847.00	43d	0.08%		
05.03.2016 07:30	06.15.2016 13:09	EURAUD	Sell	0.05	1.51800	1.51579	22.1	1864.00	43d	0.08%		
05.03.2016 07:30	06.15.2016 17:43	EURAUD	Sell	0.05	1.51619	1.51453	16.6	1645.00	43d	0.07%		
							Previous12345..192Next					

リアルタイム成績の計測⑬(mvfxbook編)

Info		Stats	General
Gain:		+251.01%	
Abs. Gain:		+79.29%	
Daily:		1.11%	
Monthly:		39.01%	
Drawdown:		34.41%	
Balance:		¥2710830.00	
Equity:		(104.80%) ¥2840950.00	
Highest:		(Mar 07) ¥3849507.00	
Profit:		¥2835165.00	
Interest:		-¥61312.00	
Deposits:		¥3575665.00	
Withdrawals:		¥3700000.00	
Updated:		14 Seconds ago	
Tracking		0	



Info		Stats	General
Gain:		+289.82%	
Abs. Gain:		+289.82%	
Daily:		0.35%	
Monthly:		10.93%	
Drawdown:		42.04%	
Balance:		¥3898231.00	
Equity:		(92.50%) ¥3605704.00	
Highest:		(Apr 06) ¥3898231.00	
Profit:		¥2898231.00	
Interest:		-¥73550.00	
Deposits:		¥1000000.00	
Withdrawals:		¥0.00	
Updated:		27 Seconds ago	
Tracking		4	



相場から退場しない為に

Medallion Fund annual returns since inception



Bloomberg

＜James Simons氏が率いるAIファンド＞
創業以来の運用リターン年平均38%

Source: Bloomberg