Expert Advisors Performance Evaluation

W2C – Angely _ Normal

© 2017- Trilogy Inc. All Rights Reserved.

We contribute to make Japan the world leader in finance through continued support to investors.

Thanks.

MetaTrader 4

Trilogy

The head No.372 of the Kinki Regional Finance Bureaus (Kinsho)

Japanese investment-advisory-business association 022-00269

顧問契約・手続き等に関するお問合せ；株式会社トリロジー・サポートデスク info@trgy.co.jp +81(0)6-6356-4045

■ 2037年の日本

我が国の発展に尽力した2人のサラリーマンが同じ会社を退職しました。この2人は、いわゆる中流家庭に生まれ、年齢、出身大学が同じで、2人とも皆から好かれる人間性にも優れた人物でした。そして、これから、悠々自適に第2の人生を謳歌しようとしています。しかし、2人には決定的な違いがありました。

・ 1人が所有する資産の総額は、3000万円。
・ もう1人が所有する資産の総額は、3億円。

■ この違いを生み出す理由

このような差が生まれる理由は何でしょうか？1人は浪費家で、もう1人は倹約家だったわけではありません。20年前（すなわち現在）、1人は資産を全て貯蓄し、もう1人は資産の半分を投資にまわし運用しました。

■ 2017年（現在）の日本

我が国は、賃金上昇を見込めず、終わりの見えない低金利時代に突入しています。一方、増税と無謀なインフレターゲットにより、今、実質金利はマイナス3%を超え、国民の預貯金 / 資産価値は、日々、目減りを続けています。これは、日本国民の皆が投資家になることを求められていると申し上げても過言ではありません。しかしながら、これまでの投資先や手法には、もう旨味がありません。経済成長時の事業投資や、地価株価の右肩上がり神話は崩れ去って久しく、外貨預金では円キャリートレード全盛時のように資産を殖やすことはできないでしょう。一見プロっぽい投資ファンドに大切なお金を預けて痛い目をみたこともあるかもしれません。海外不動産に、値上がり益と20%を超える利回りを夢見、結果は自身の無知と無学を嘆くことになった投資家もいるかもしれません。ようやく他人に預けることが最大のリスクであることを悟り、心機一転トレーダーを目指すも、予測不可能な相場の値動きに翻弄され、その困難さに打ちひしがれている投資家も多いでしょう。このような時代だからこそ、日本国民の皆様には、当社が開発したFX自動売買システム『W2C-Angely』をご紹介したいと思います。

■ 老後資金のためのFX自動売買

『W2C-Angely』は、老後資金のための長期的かつ安定的な資産運用を目的とするFX自動売買システム（Expert Advisors ; EA）です。私どもは、統計学的な検証を行うことにより、搭載するトレーディングロジックの優位性を常に検証し、長期運用への耐久性を評価しています。

■ 私ども（Trilogy Inc.）の目的

当社はEAの販売利益を目的とするのではなく、その先にある投資家の皆様への継続支援を通じ、我が国の金融立国に貢献することを目的としています。『W2C-Angely』は、末永くご利用いただくことで安定した資産形成が実現されるとともに、私どもが投資家の皆様からの信頼を勝ち得るツールになると確信しております。目先のトレード結果に一喜一憂することなく、10年後、20年後、30年後と、先を見据えた長期的な資産運用にお役立ていただけますと幸いです。

■ 謝辞

世には、数多のEAが溢れています。その中で、決して派手ではない『W2C-Angely』を見つけていただき誠にありがとうございます。『W2C-Angely』は地味ですが、極めて高い統計学的優位性を誇ります。皆様の口座残高を着実に殖やしてくれると確信しています。冒頭で述べた2人の違いは資産運用方法の違いです。皆様の豊かな老後を実現するために、当社が、そのお手伝いをさせていただけますと幸いです。

Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

■ 私ども（Trilogy Inc.）のスタンス

私どもは、FX自動売買以外の投資手法（株、不動産、仮想通貨など）を否定するものではありません。一方で、現代を生きる日本国民の多数にとって最も有益な投資手法は、FX自動売買であることを明言するものです。

■ 外国為替市場の利点

FX取引の舞台となる外国為替市場はグローバルマーケットであり、市場規模の大きさから株式市場に現れる仕手筋やインサイダー取引などが生まれません。お金をたくさん持っている人、情報を人より早く取ることが出来る人が必ずしも有利かというと、そうでもありません。したがって、外国為替市場は、公平かつ平等な市場と言えます。また、誰かが勝てば必ず誰かが負けるというゼロサムゲームではなく、”マーケット vs 個人投資家” という構図から、プロもアマも関係なく、皆が同じ土俵で勝負できるフェアでクリーンな取引が可能です。今ではインターネットの普及により全世界の市場で、土日を除いた24時間の取引が可能なため、利益獲得機会が多くあります。

■ 自動売買の利点

自動売買を採用する利点は4つあります。たった4つですが、この4つが極めて重要です。①自分の口座で取引が出来ます。自分の口座で取引ができれば、特殊詐欺に合うことはありません。②トレードの際に時間的拘束を受けません。取引時の時間的拘束を受けなければ、今の生活に影響が出ることはありません。 ③トレードルールを明確に守れます。人間はトレードルールを守れません。逆に、機械はトレードルール通りにしか動きません。よって、トレードルールさえ正しく構築できれば良いわけです。④複利運用ができます。「人類最大の発明は複利である。（The most powerful force in the universe is compound interest.）」とアインシュタインが述べたように、長期間の複利運用は、資産形成において絶大な威力を発揮します。FX自動売買は、長期的かつ安定的な複利運用を可能にします。

■ 自動売買の問題点

自動売買を採用する際、問題点が1つあります。トレードルールを正しく構築した自動売買システム（EA）を探さなければならないのが、唯一の問題点です。世には数多のEAが存在します。その中から、良いEAを見つけなければなりません。売ったモン勝ちみたいな粗雑EAを売る違法業者の方が、合法的に真面目に営業している業者よりも多い業界です。しかし、この問題点は、私ども（Trilogy Inc.）が解決いたします。

■ 私ども（Trilogy Inc.）のEA開発

私どもは、老舗に分類されるEA開発元であり、金融庁に登録し合法的に営業しています。長年、技術を磨き、経験を蓄積して参りました。2015年より、自然科学分野の博士号取得者を主席研究員に起用し、科学的アプローチを導入しました。さらに、外国為替取引のキャリアが20年以上の者と30年以上の者の2名で監修する万全の体制を整えることで、過去の検証を未来の実績につなげています。『W2C-Angely』は、50年以上生き残っているトレーディングロジックを採用したEAです。これからも長く通用するEAとしての活躍が期待できます。目指す利益は年利10%程度です。しかし、デモとリアルの成績の差を小さくするための工夫（スリッページの回避など）を取り入れ、極めて堅牢なEAに仕上げています。細部に魂を宿らせた私どものEAを、是非、ご体験ください。皆様からの朗報を心待ちにしています。

Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

 Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

EA name

W2C-Angely _ Normal version

＊上位モデルである Professional version は EA レンタル会員専用になります。

Summary

- エントリー / イグジットが一対の売買ロジック
- ロットコントロールなし
- 10 通貨ペア、10 .setファイル（主力となる通貨ペア ; GBPJPY）
- 各通貨ペア最大 4 ポジション（両建て有）、最大計 40 ポジション保有
- 全通貨ペアを使用した場合、トレード回数は、月 70 回前後
- 検証期間（12年）から導かれる最大のスタートロット（≒最大リスク）は、原資 1 万ドルに対して合計 1.5 lot
- 勝率は　30 % 前後
- 利大損小（ペイオフレシオ = 3.2）

Developer

Trilogy Inc.（株式会社トリロジー）

投資助言・代理業登録業者/財務省近畿財務局長(金商)第 372 号
一般社団法人日本投資顧問業協会会員 / 会員番号 022-00269

〒530-0043
大阪市北区天満2-1-27　桃井第2ビル5F東
TEL　; 06-6356-4045
e-Mail ; info@trgy.co.jp
URL　; http://www.trgy.co.jp/

Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

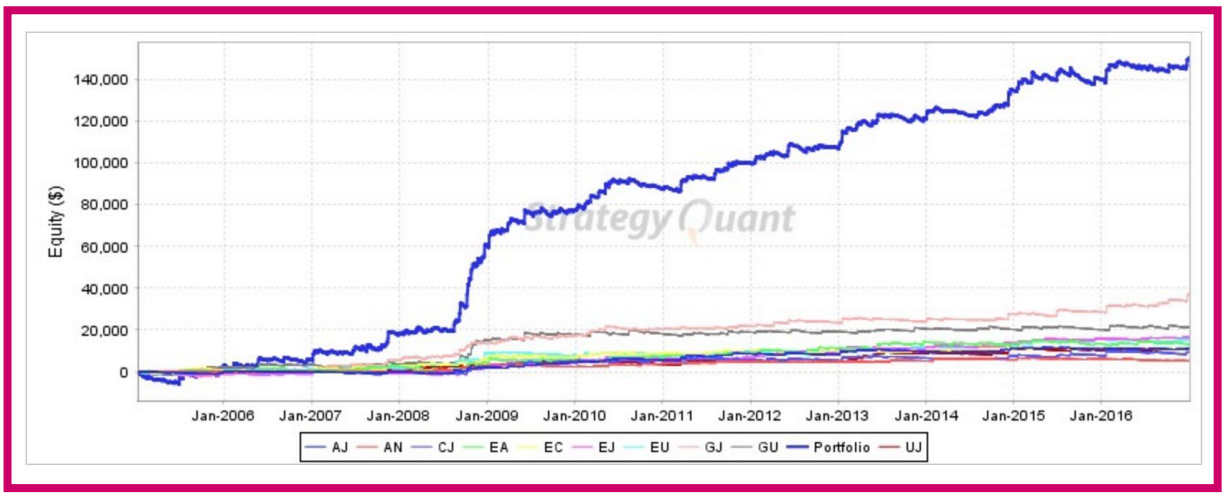
Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

Set up of Quant Analyzer 4

- 統合ツール ; Quant Analyzer 4（Strategy Quant 社, Česká republika）
- テスト環境 ; MetaTrader4 – OANDA-Japan Practice（Build 1045）
- 通貨ペア ; AUDJPY, AUDNZD, CADJPY, EURAUD, EURCAD, EURJPY, EURUSD, GBPJPY, GBPUSD, USDJPY
- パラメータ ; Lots = 0.1, Spread = 12 ～ 50（1.5 ～ 6.0 pips）
- EA ; W2C-Angely Normal
- 時間軸 ; D1

Portfolio Results

- 詳細 ⇒ http://w2c-angely.trgy.co.jp/download/str/Portfolio.html
- Initial deposit ; $ 100,000.00
- Profit factor ; 1.40
- Total net profit ; $ 150,287.38 / 12 年
- Maximal DrawDown ; $ 8,055.80（5.88 %）/ 12 年
- Return / DD ratio ; 18.66
- Total Trades ; 8924 / 12 年（Cancelled ; 890）
- # of Wins（won %） ; 2121（26.40 %）
- # of Losses（lost %） ; 5913（73.60 %）
- Largest ; Win = $ 2,137.2 Loss = $ - 493.9
- Average ; Win = $ 248.93 Loss = $ - 63.68



Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

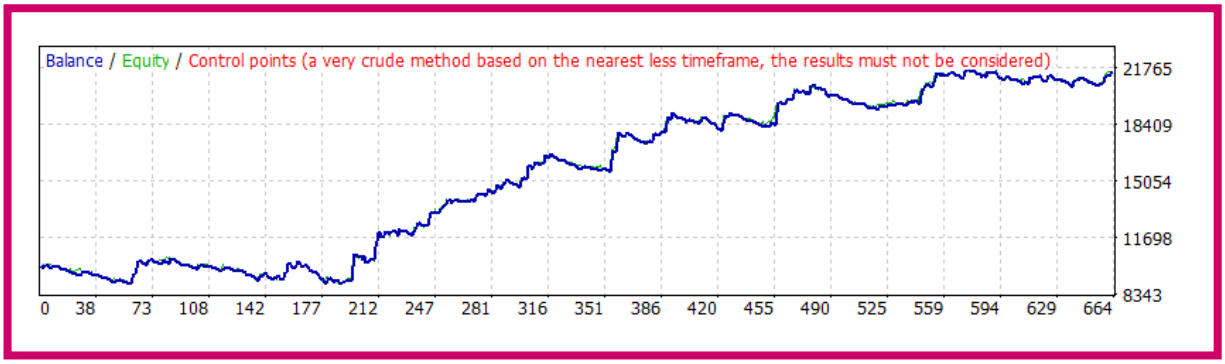
 Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

W2C-Angely_Normal_AUDJPY

- 通貨ペア ; AUDJPY
- 時間軸 ; D1
- テスト環境 ; MetaTrader4 – OANDA-Japan Practice（Build 1045）
- 期間 ; 2005.01.01 – 2017.01.01
- パラメータ ; Lots = 0.1, Spread = 25（2.5 pips）

Strategy Tester Report

- 詳細 ⇒ http://w2c-angely.trgy.co.jp/download/str/StrategyTester_AN_AJ.htm
- Initial deposit ; $ 10,000.00
- Profit factor ; 1.43
- Total net profit ; $ 11,549.92 / 12 年
- Maximal DrawDown ; $ 1,706.55（15.97 %）/ 12 年
- Return / DD ratio ; 6.77
- Total Trades ; 661 / 12 年
- # of Wins（won %） ; 227（34.34 %）
- # of Losses（lost %） ; 434（65.66 %）
- Largest ; Win = $ 825.03 Loss = $ - 459.48
- Average ; Win = $ 167.89 Loss = $ - 61.20

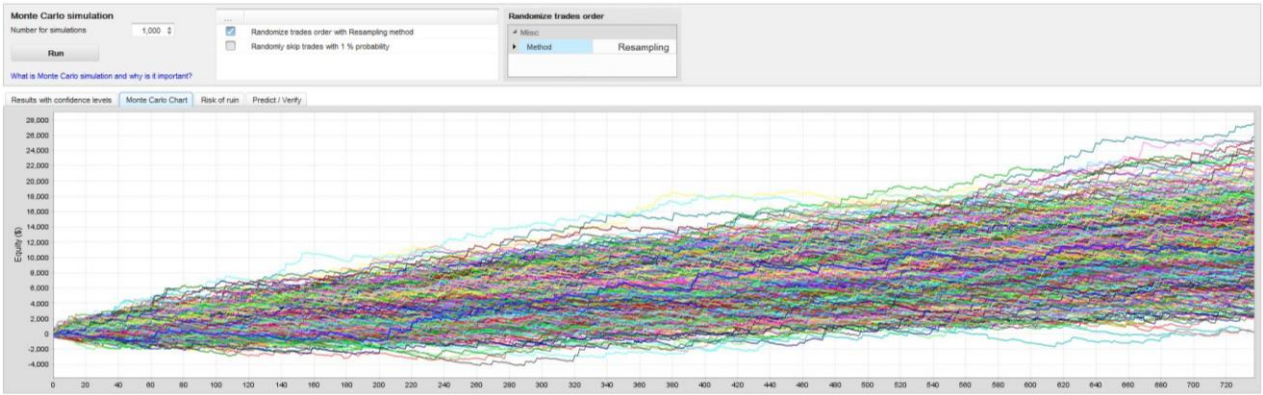


Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

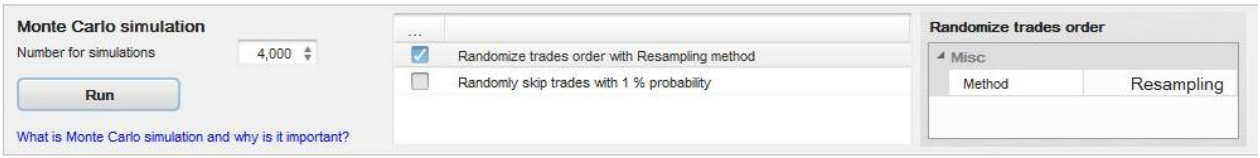
Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

Monte Carlo analysis

- Equity Curves
  - > Simulations = 1,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



- Table example
  - > Simulations = 4,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



Results with confidence levels | Monte Carlo Chart | Risk of ruin | Predict / Verify

Monte Carlo results with confidence levels

Confidence level	Net Profit	% Net Profit	Number of tra...	Max DD	Max % DD	Ret/DD	R Exp	AR %	Consecutive L...
Original	$ 11549.92	115.5 %	738.0	$ 1463.65	13.99 %	0.08	0.3 R	9.69 %	17
50	$ 11531.04	115.31 %	738.0	$ 1740.83	11.45 %	0.07	0.3 R	9.67 %	15
60	$ 10512.45	105.12 %	738.0	$ 1884.81	12.55 %	0.06	0.27 R	8.82 %	16
70	$ 9417.86	94.18 %	738.0	$ 2049.6	13.92 %	0.05	0.25 R	7.9 %	17
80	$ 8160.4	81.6 %	738.0	$ 2271.93	15.87 %	0.04	0.21 R	6.85 %	18
90	$ 6356.84	63.57 %	738.0	$ 2618.05	18.61 %	0.03	0.17 R	5.33 %	20
92	$ 5936.89	59.37 %	738.0	$ 2724.06	19.64 %	0.03	0.16 R	4.98 %	21
95	$ 5009.72	50.1 %	738.0	$ 2977.25	21.42 %	0.02	0.13 R	4.2 %	22
97	$ 4094.19	40.94 %	738.0	$ 3192.07	23.37 %	0.02	0.11 R	3.44 %	24
98	$ 3576.89	35.77 %	738.0	$ 3371.27	25.07 %	0.01	0.09 R	3 %	25
99	$ 2675.45	26.75 %	738.0	$ 3711.91	28.38 %	0.01	0.07 R	2.24 %	27
100	$ -339.73	-3.4 %	738.0	$ 5063.81	39.66 %	-0	-0.01 R	-0.29 %	35

- Statistics
  - > Simulations = 4,000 Runs x 10
  - > Return / DD ratio（mean ± SD of 10 Runs） = 1.7086 ± 0.0406

Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

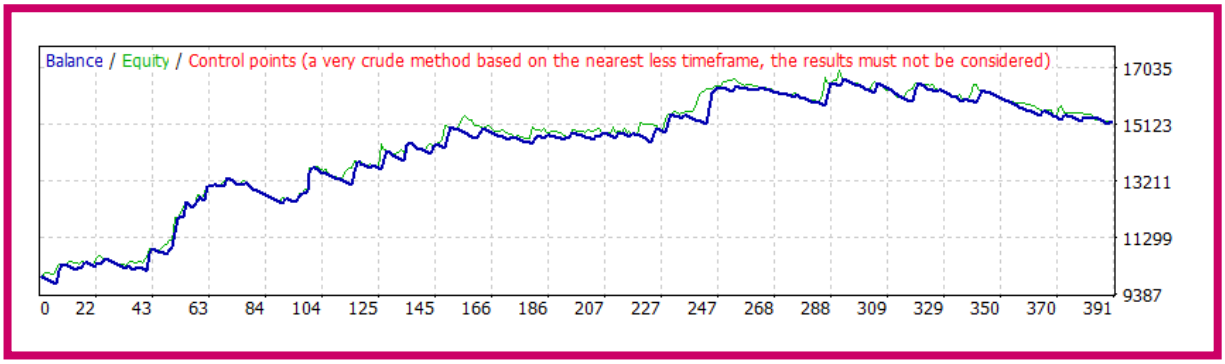
 Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

W2C-Angely_Normal_AUDNZD

- 通貨ペア ; AUDNZD
- 時間軸 ; D1
- テスト環境 ; MetaTrader4 – OANDA-Japan Practice（Build 1045）
- 期間 ; 2007.07.01 – 2017.01.01
- パラメータ ; Lots = 0.1, Spread = 50（5.0 pips）

Strategy Tester Report

- 詳細 ⇒ http://w2c-angely.trgy.co.jp/download/str/StrategyTester_AN_AN.htm
- Initial deposit ; $ 10,000.00
- Profit factor ; 1.43
- Total net profit ; $ 5,236.53 / 10 年
- Maximal DrawDown ; $ 1,812.07（10.65 %）/ 10 年
- Return / DD ratio ; 2.89
- Total Trades ; 389 / 10 年
- # of Wins（won %） ; 100（25.71 %）
- # of Losses（lost %） ; 289（74.29 %）
- Largest ; Win = $ 576.32 Loss = $ - 118.85
- Average ; Win = $ 173.92 Loss = $ - 42.06

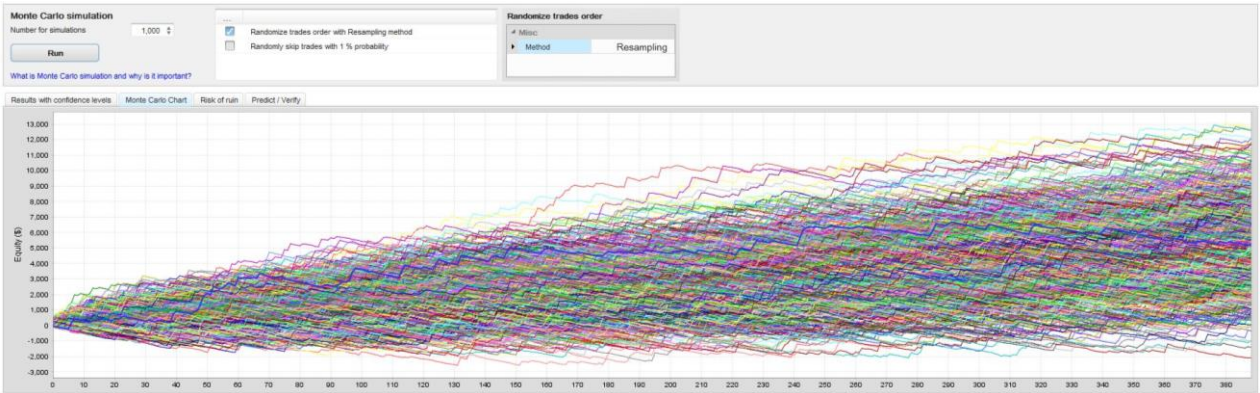


Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

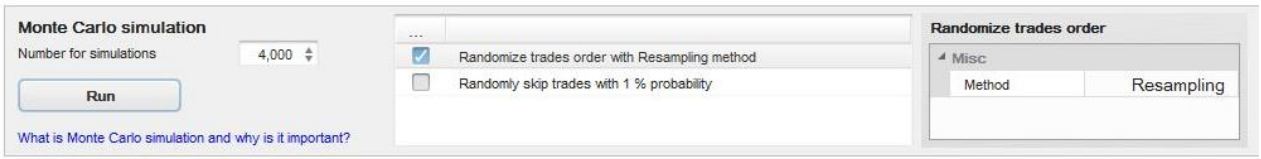
Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

Monte Carlo analysis

- Equity Curves
  - > Simulations = 1,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



- Table example
  - > Simulations = 4,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



Results with confidence levels | Monte Carlo Chart | Risk of ruin | Predict / Verify

Monte Carlo results with confidence levels

Confidence level	Net Profit	% Net Profit	Number of tra...	Max DD	Max % DD	Ret/DD	R Exp	AR %	Consecutive L...
Original	$ 5236.53	52.37 %	389.0	$ 1500.96	9 %	0.03	0.32 R	5.51 %	21
50	$ 5083.11	50.83 %	389.0	$ 1204.93	9.46 %	0.04	0.32 R	5.35 %	16
60	$ 4483.82	44.84 %	389.0	$ 1305.54	10.34 %	0.04	0.28 R	4.72 %	17
70	$ 3825.73	38.26 %	389.0	$ 1424.15	11.4 %	0.03	0.24 R	4.02 %	18
80	$ 3140.54	31.41 %	389.0	$ 1585.72	12.87 %	0.02	0.2 R	3.3 %	20
90	$ 2108.91	21.09 %	389.0	$ 1864.12	15.44 %	0.01	0.13 R	2.22 %	22
92	$ 1849.87	18.5 %	389.0	$ 1948.79	16.23 %	0.01	0.12 R	1.95 %	23
95	$ 1294.35	12.94 %	389.0	$ 2136.56	18.16 %	0.01	0.08 R	1.36 %	25
97	$ 784.86	7.85 %	389.0	$ 2323.26	19.54 %	0	0.05 R	0.83 %	26
98	$ 344.31	3.44 %	389.0	$ 2487.94	21.05 %	0	0.02 R	0.36 %	27
99	$ -322.57	-3.23 %	389.0	$ 2731.95	23.93 %	-0	-0.02 R	-0.34 %	31
100	$ -2883.97	-28.84 %	389.0	$ 4128.94	36.87 %	-0.01	-0.18 R	-3.03 %	45

- Statistics
  - > Simulations = 4,000 Runs x 10
  - > Return / DD ratio（mean ± SD of 10 Runs） = 0.6180 ± 0.0294

Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

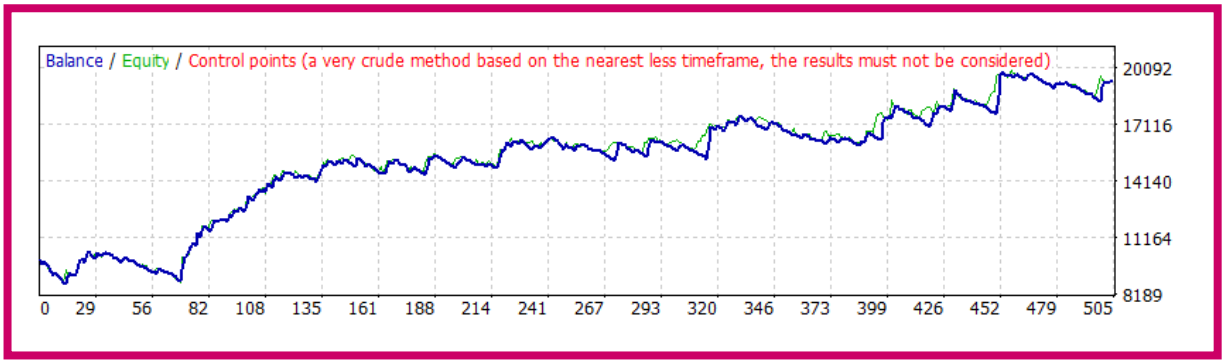
 Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

W2C-Angely_Normal_CADJPY

- 通貨ペア ; CADJPY
- 時間軸 ; D1
- テスト環境 ; MetaTrader4 – OANDA-Japan Practice（Build 1045）
- 期間 ; 2007.07.01 – 2017.01.01
- パラメータ ; Lots = 0.1, Spread = 40（4.0 pips）

Strategy Tester Report

- 詳細 ⇒ http://w2c-angely.trgy.co.jp/download/str/StrategyTester_AN_CJ.htm
- Initial deposit ; $ 10,000.00
- Profit factor ; 1.33
- Total net profit ; $ 9,355.02 / 10 年
- Maximal DrawDown ; $ 1,995.27（18.51 %）/ 10 年
- Return / DD ratio ; 4.69
- Total Trades ; 503 / 10 年
- # of Wins（won %） ; 175（34.79 %）
- # of Losses（lost %） ; 328（65.21 %）
- Largest ; Win = $ 1,046.30 Loss = $ - 245.41
- Average ; Win = $ 215.20 Loss = $ - 86.30

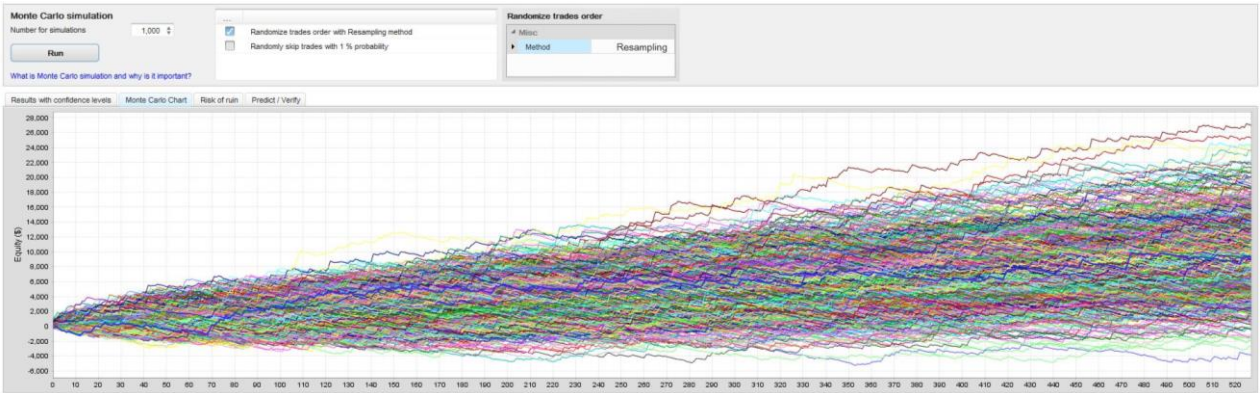


Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

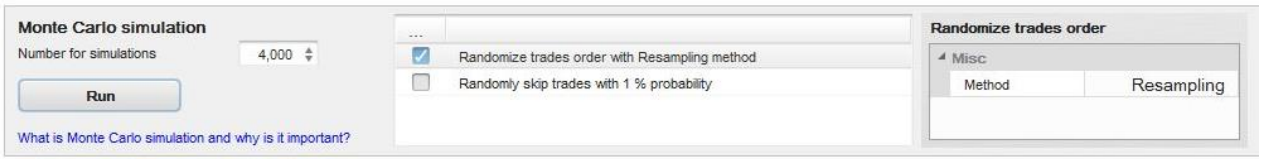
Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

Monte Carlo analysis

- Equity Curves
  - > Simulations = 1,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



- Table example
  - > Simulations = 4,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



Monte Carlo results with confidence levels

Confidence level	Net Profit	% Net Profit	Number of tra...	Max DD	Max % DD	Ret/DD	R Exp	AR %	Consecutive L...
Original	$ 9355.02	93.55 %	528.0	$ 1610.68	15.09 %	0.06	0.22 R	9.84 %	12
50	$ 9231.54	92.32 %	528.0	$ 2218.73	15.08 %	0.04	0.22 R	9.71 %	13
60	$ 8178.79	81.79 %	528.0	$ 2399.54	16.68 %	0.03	0.19 R	8.61 %	14
70	$ 7050.98	70.51 %	528.0	$ 2634.39	18.57 %	0.03	0.17 R	7.42 %	15
80	$ 5614.45	56.14 %	528.0	$ 2938.21	21.03 %	0.02	0.13 R	5.91 %	16
90	$ 3847.14	38.47 %	528.0	$ 3444.8	25.24 %	0.01	0.09 R	4.05 %	18
92	$ 3418.74	34.19 %	528.0	$ 3600.26	26.54 %	0.01	0.08 R	3.6 %	19
95	$ 2520.96	25.21 %	528.0	$ 3905.83	29.75 %	0.01	0.06 R	2.65 %	20
97	$ 1573.45	15.73 %	528.0	$ 4304.36	33.22 %	0	0.04 R	1.66 %	21
98	$ 1035.3	10.35 %	528.0	$ 4538.9	35.9 %	0	0.02 R	1.09 %	22
99	$ 78.66	0.79 %	528.0	$ 5005.38	39.31 %	0	0 R	0.08 %	24
100	$ -3938.2	-39.38 %	528.0	$ 7356.86	65.08 %	-0.01	-0.1 R	-4.14 %	37

- Statistics
  - > Simulations = 4,000 Runs x 10
  - > Return / DD ratio（mean ± SD of 10 Runs） = 0.6456 ± 0.0340

Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

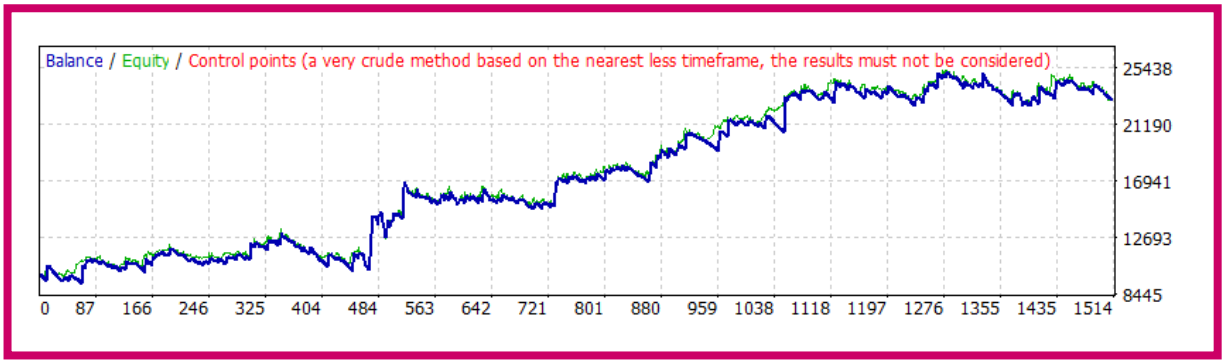
 Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

W2C-Angely_Normal_EURAUD

- 通貨ペア ; EURAUD
- 時間軸 ; D1
- テスト環境 ; MetaTrader4 – OANDA-Japan Practice（Build 1045）
- 期間 ; 2005.01.01 – 2017.01.01
- パラメータ ; Lots = 0.1, Spread = 20（2.0 pips）

Strategy Tester Report

- 詳細 ⇒ http://w2c-angely.trgy.co.jp/download/str/StrategyTester_AN_EA.htm
- Initial deposit ; $ 10,000.00
- Profit factor ; 1.18
- Total net profit ; $ 1,3090.98 / 12 年
- Maximal DrawDown ; $ 3,250.50（24.25 %）/ 12 年
- Return / DD ratio ; 4.03
- Total Trades ; 1508 / 12 年
- # of Wins（won %） ; 397（26.33 %）
- # of Losses（lost %） ; 1111（73.67 %）
- Largest ; Win = $ 1,330.59 Loss = $ - 493.90
- Average ; Win = $ 212.96 Loss = $ - 64.32

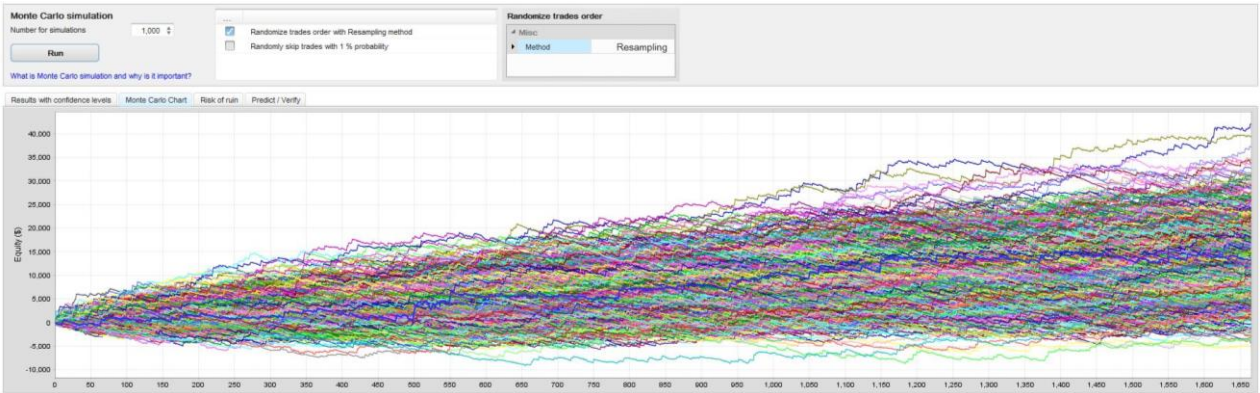


Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

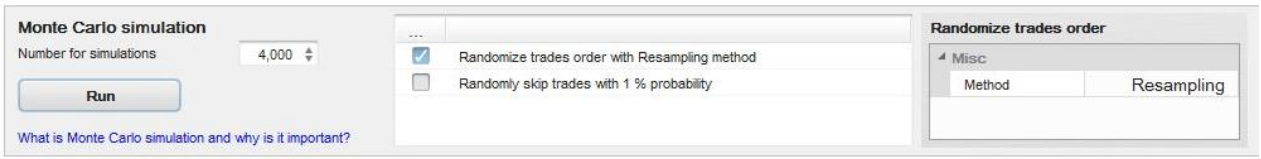
Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

Monte Carlo analysis

- Equity Curves
  - > Simulations = 1,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



- Table example
  - > Simulations = 4,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



Results with confidence levels | Monte Carlo Chart | Risk of ruin | Predict / Verify

Monte Carlo results with confidence levels

Confidence level	Net Profit	% Net Profit	Number of tra...	Max DD	Max % DD	Ret/DD	R Exp	AR %	Consecutive L...
Original	$ 13090.98	130.91 %	1666.0	$ 2826.26	21.71 %	0.05	0.14 R	10.91 %	25
50	$ 12903.59	129.04 %	1666.0	$ 3951.2	24.19 %	0.03	0.14 R	10.75 %	23
60	$ 11153.61	111.54 %	1666.0	$ 4294.86	26.82 %	0.03	0.12 R	9.3 %	24
70	$ 9395.5	93.96 %	1666.0	$ 4684.52	29.9 %	0.02	0.1 R	7.83 %	25
80	$ 7441.11	74.41 %	1666.0	$ 5227.64	34.06 %	0.02	0.08 R	6.2 %	27
90	$ 4551.63	45.52 %	1666.0	$ 6059.74	41.58 %	0.01	0.05 R	3.79 %	29
92	$ 3715.56	37.16 %	1666.0	$ 6354.57	44.48 %	0.01	0.04 R	3.1 %	30
95	$ 2108.23	21.08 %	1666.0	$ 6908.99	49.54 %	0	0.02 R	1.76 %	32
97	$ 485.48	4.85 %	1666.0	$ 7489.4	55.39 %	0	0.01 R	0.4 %	34
98	$ -484.87	-4.85 %	1666.0	$ 7928.01	59.73 %	-0	-0.01 R	-0.4 %	35
99	$ -1973.92	-19.74 %	1666.0	$ 8582.36	69.18 %	-0	-0.02 R	-1.65 %	38
100	$ -10562.29	-105.62 %	1666.0	$ 12854.09	108.67 %	-0.01	-0.12 R	-8.8 %	61

- Statistics
  - > Simulations = 4,000 Runs x 10
  - > Return / DD ratio（mean ± SD of 10 Runs） = 0.3074 ± 0.0270

Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

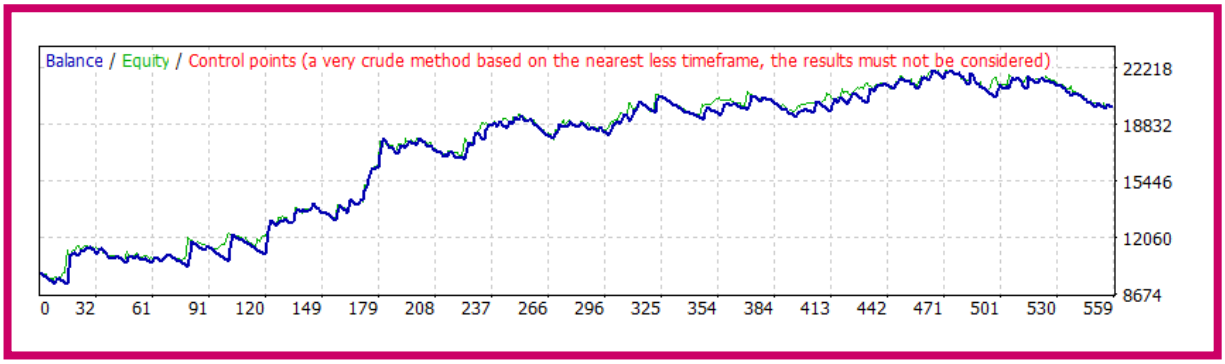
 Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

W2C-Angely_Normal_EURCAD

- 通貨ペア ; EURCAD
- 時間軸 ; D1
- テスト環境 ; MetaTrader4 – OANDA-Japan Practice（Build 1045）
- 期間 ; 2005.01.01 – 2017.01.01
- パラメータ ; Lots = 0.1, Spread = 25（2.5 pips）

Strategy Tester Report

- 詳細 ⇒ http://w2c-angely.trgy.co.jp/download/str/StrategyTester_AN_EC.htm
- Initial deposit ; $ 10,000.00
- Profit factor ; 1.29
- Total net profit ; $ 9,880.72 / 12 年
- Maximal DrawDown ; $ 2,640.14（11.74 %）/ 12 年
- Return / DD ratio ; 3.74
- Total Trades ; 557 / 12 年
- # of Wins（won %） ; 192（34.47 %）
- # of Losses（lost %） ; 365（65.53 %）
- Largest ; Win = $ 876.66 Loss = $ - 240.71
- Average ; Win = $ 229.35 Loss = $ - 93.57

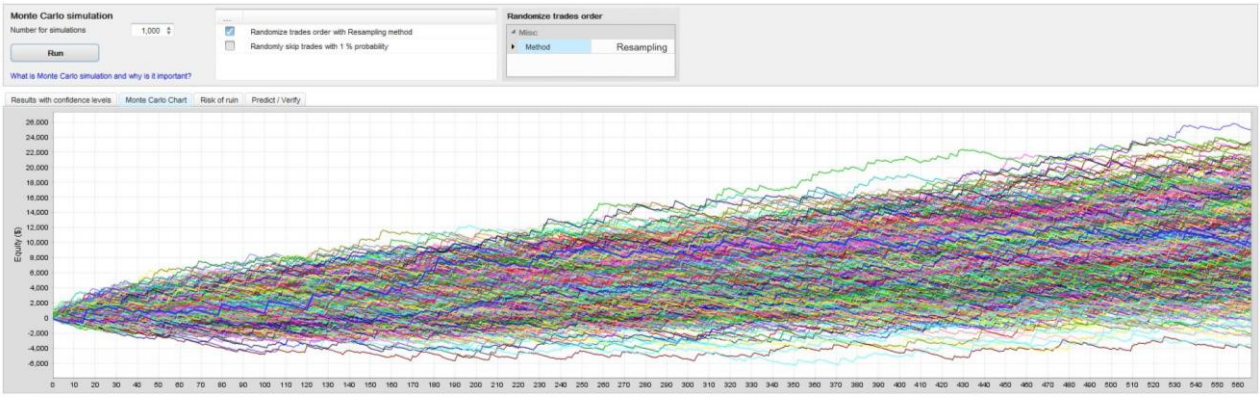


Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

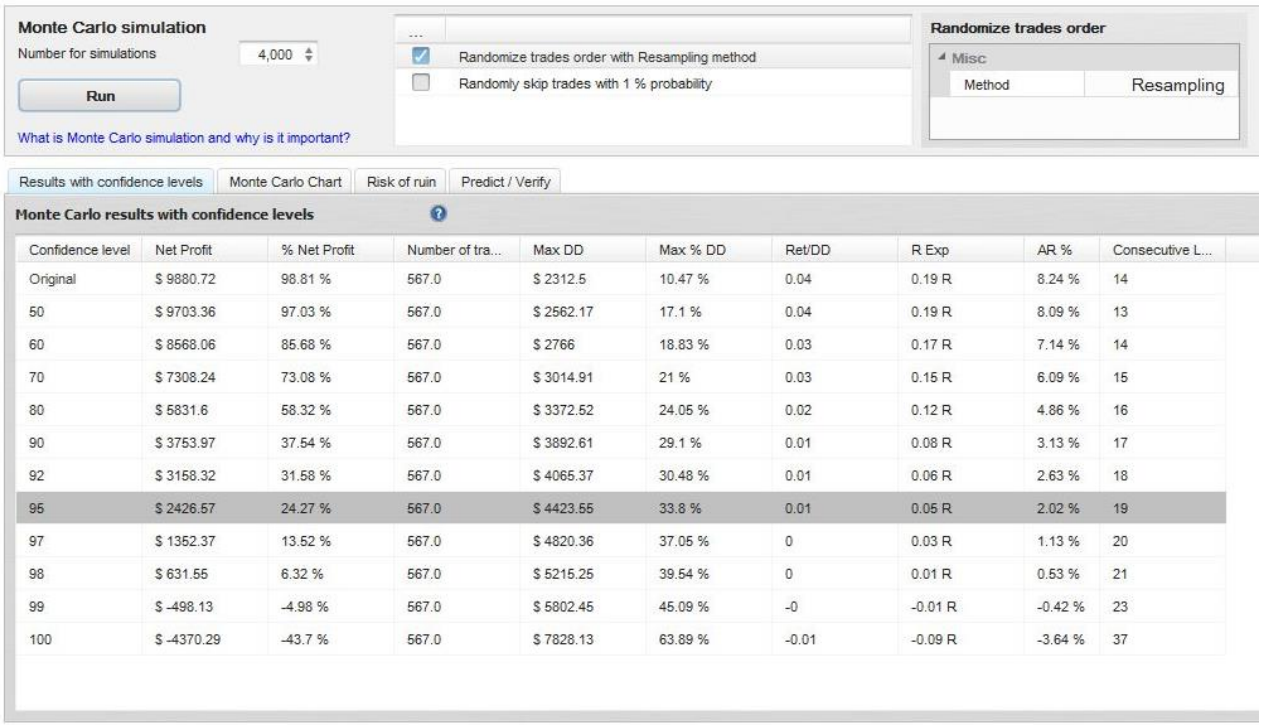
Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

Monte Carlo analysis

- Equity Curves
  - > Simulations = 1,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



- Table example
  - > Simulations = 4,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



Confidence level	Net Profit	% Net Profit	Number of tra...	Max DD	Max % DD	Ret/DD	R Exp	AR %	Consecutive L...
Original	$ 9880.72	98.81 %	567.0	$ 2312.5	10.47 %	0.04	0.19 R	8.24 %	14
50	$ 9703.36	97.03 %	567.0	$ 2562.17	17.1 %	0.04	0.19 R	8.09 %	13
60	$ 8568.06	85.68 %	567.0	$ 2766	18.83 %	0.03	0.17 R	7.14 %	14
70	$ 7308.24	73.08 %	567.0	$ 3014.91	21 %	0.03	0.15 R	6.09 %	15
80	$ 5831.6	58.32 %	567.0	$ 3372.52	24.05 %	0.02	0.12 R	4.86 %	16
90	$ 3753.97	37.54 %	567.0	$ 3892.61	29.1 %	0.01	0.08 R	3.13 %	17
92	$ 3158.32	31.58 %	567.0	$ 4065.37	30.48 %	0.01	0.06 R	2.63 %	18
95	$ 2426.57	24.27 %	567.0	$ 4423.55	33.8 %	0.01	0.05 R	2.02 %	19
97	$ 1352.37	13.52 %	567.0	$ 4820.36	37.05 %	0	0.03 R	1.13 %	20
98	$ 631.55	6.32 %	567.0	$ 5215.25	39.54 %	0	0.01 R	0.53 %	21
99	$ -498.13	-4.98 %	567.0	$ 5802.45	45.09 %	-0	-0.01 R	-0.42 %	23
100	$ -4370.29	-43.7 %	567.0	$ 7828.13	63.89 %	-0.01	-0.09 R	-3.64 %	37

- Statistics
  - > Simulations = 4,000 Runs x 10
  - > Return / DD ratio（mean ± SD of 10 Runs） = 0.5092 ± 0.0264

Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

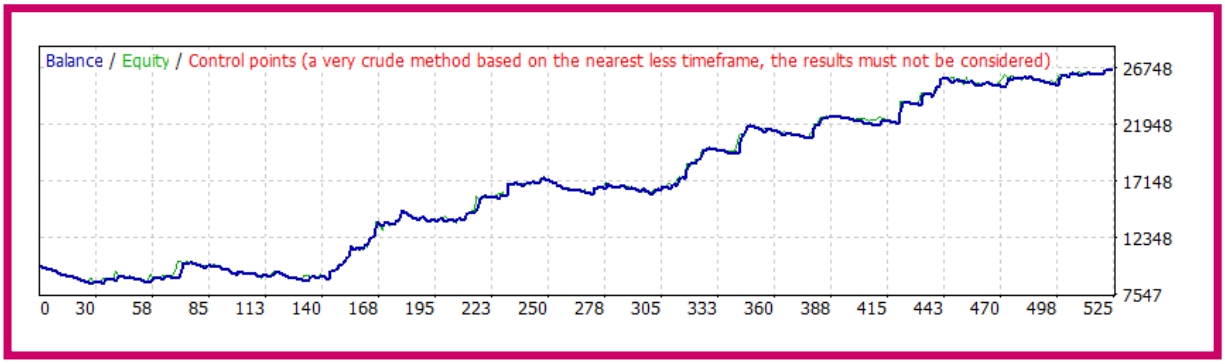
 Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

W2C-Angely_Normal_EURJPY

- 通貨ペア ; EURJPY
- 時間軸 ; D1
- テスト環境 ; MetaTrader4 – OANDA-Japan Practice（Build 1045）
- 期間 ; 2005.01.01 – 2017.01.01
- パラメータ ; Lots = 0.1, Spread = 20（2.0 pips）

Strategy Tester Report

- 詳細 ⇒ http://w2c-angely.trgy.co.jp/download/str/StrategyTester_AN_EJ.htm
- Initial deposit ; $ 10,000.00
- Profit factor ; 1.68
- Total net profit ; $ 16,605.24 / 12 年
- Maximal DrawDown ; $ 1,875.80（11.74 %）/ 12 年
- Return / DD ratio ; 8.85
- Total Trades ; 523 / 12 年
- # of Wins（won %） ; 169（32.31 %）
- # of Losses（lost %） ; 354（67.69 %）
- Largest ; Win = $ 1,086.46 Loss = $ - 328.27
- Average ; Win = $ 241.81 Loss = $ - 68.54

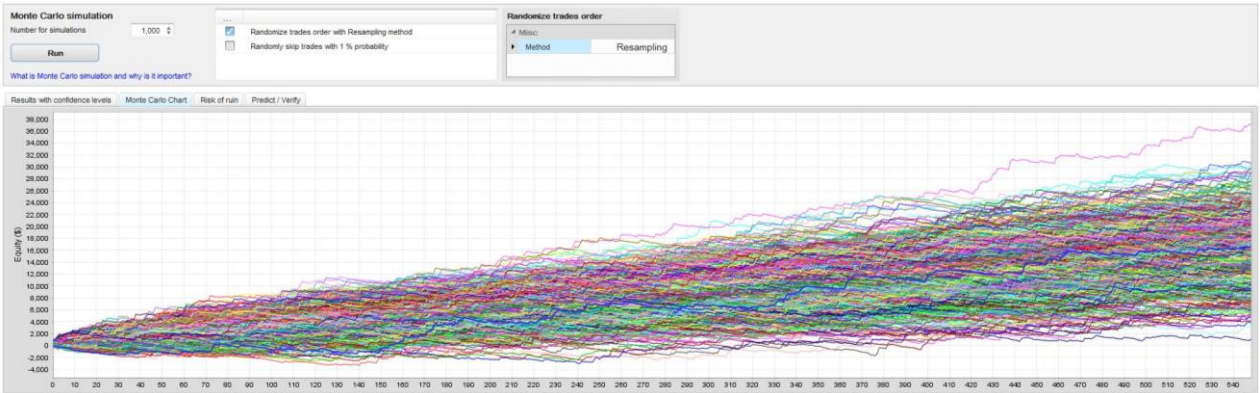


Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

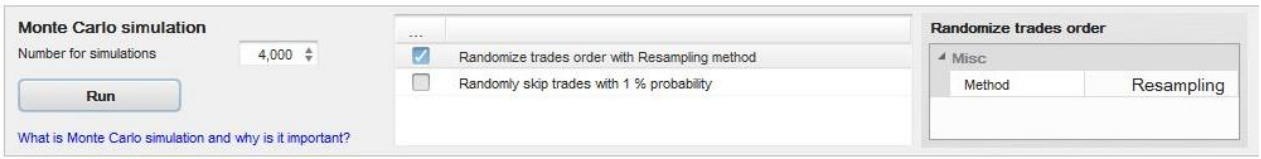
Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

Monte Carlo analysis

- Equity Curves
  - > Simulations = 1,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



- Table example
  - > Simulations = 4,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



Results with confidence levels | Monte Carlo Chart | Risk of ruin | Predict / Verify

Monte Carlo results with confidence levels

Confidence level	Net Profit	% Net Profit	Number of tra...	Max DD	Max % DD	Ret/DD	R Exp	AR %	Consecutive L...
Original	$ 16605.24	166.05 %	549.0	$ 1618.53	15.78 %	0.1	0.47 R	14.05 %	27
50	$ 16472.87	164.73 %	549.0	$ 1661.56	10.16 %	0.1	0.46 R	13.93 %	15
60	$ 15303.73	153.04 %	549.0	$ 1788.63	11.09 %	0.09	0.43 R	12.95 %	15
70	$ 13938.02	139.38 %	549.0	$ 1940.36	12.21 %	0.07	0.39 R	11.79 %	16
80	$ 12387.07	123.87 %	549.0	$ 2143.03	13.84 %	0.06	0.35 R	10.48 %	18
90	$ 10419.18	104.19 %	549.0	$ 2487.63	16.48 %	0.05	0.3 R	8.81 %	20
92	$ 9899.76	99 %	549.0	$ 2621.44	17.47 %	0.04	0.28 R	8.37 %	20
95	$ 8802.14	88.02 %	549.0	$ 2826.54	19.07 %	0.04	0.25 R	7.45 %	22
97	$ 7723.29	77.23 %	549.0	$ 3050.41	21.16 %	0.03	0.22 R	6.53 %	23
98	$ 7039.7	70.4 %	549.0	$ 3283.6	22.74 %	0.03	0.2 R	5.95 %	24
99	$ 5899.34	58.99 %	549.0	$ 3594.23	25.38 %	0.02	0.17 R	4.99 %	26
100	$ 588.2	5.88 %	549.0	$ 6186.21	42.31 %	0	0.02 R	0.5 %	37

- Statistics
  - > Simulations = 4,000 Runs x 10
  - > Return / DD ratio（mean ± SD of 10 Runs） = 3.1977 ± 0.0757

Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

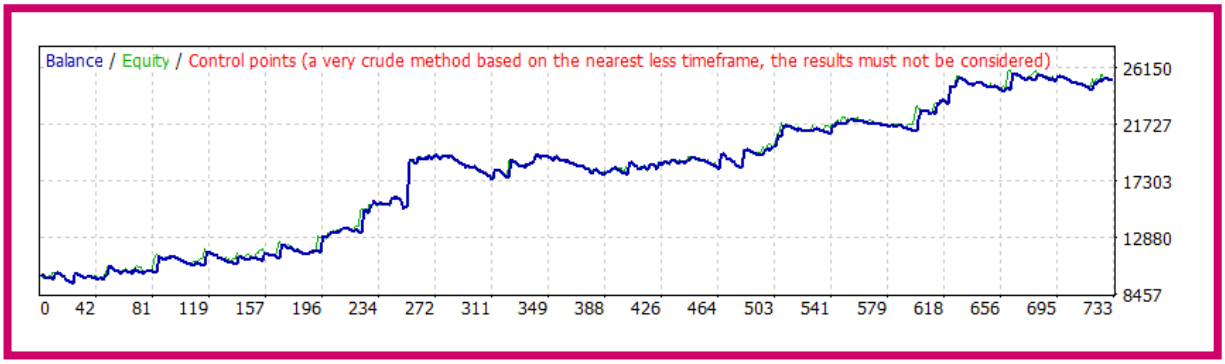
 Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

W2C-Angely_Normal_EURUSD

- 通貨ペア ; EURUSD
- 時間軸 ; D1
- テスト環境 ; MetaTrader4 – OANDA-Japan Practice（Build 1045）
- 期間 ; 2005.01.01 – 2017.01.01
- パラメータ ; Lots = 0.1, Spread = 15（1.5 pips）

Strategy Tester Report

- 詳細 ⇒ http://w2c-angely.trgy.co.jp/download/str/StrategyTester_AN_EU.htm
- Initial deposit ; $ 10,000.00
- Profit factor ; 1.45
- Total net profit ; $ 15,354.80 / 12 年
- Maximal DrawDown ; $ 2,228.90（11.27 %）/ 12 年
- Return / DD ratio ; 6.89
- Total Trades ; 730 / 12 年
- # of Wins（won %） ; 215（29.45 %）
- # of Losses（lost %） ; 515（70.55 %）
- Largest ; Win = $ 1,804.50 Loss = $ - 317.00
- Average ; Win = $ 231.59 Loss = $ - 66.87

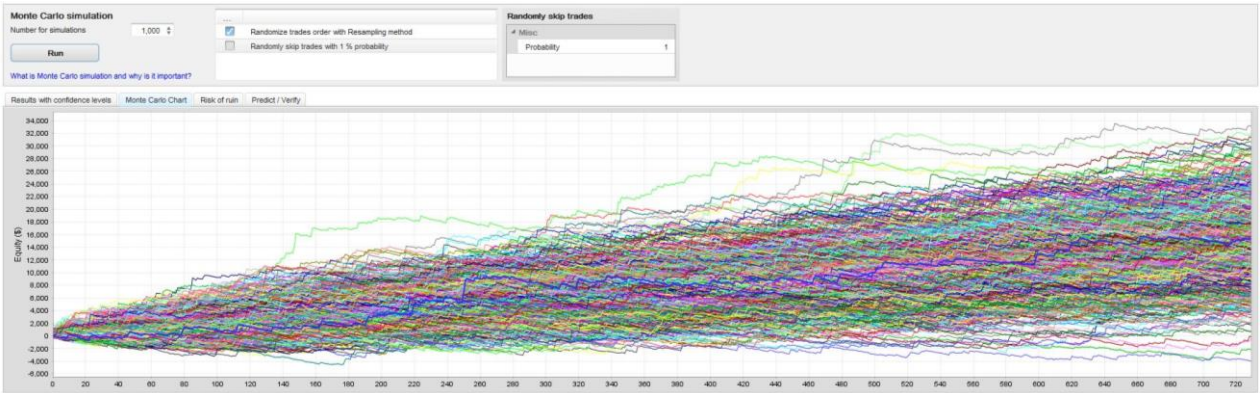


Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

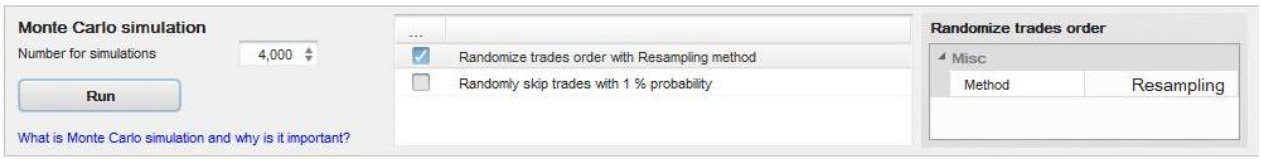
Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

Monte Carlo analysis

- Equity Curves
  - > Simulations = 1,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



- Table example
  - > Simulations = 4,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



Results with confidence levels | Monte Carlo Chart | Risk of ruin | Predict / Verify

Monte Carlo results with confidence levels

Confidence level	Net Profit	% Net Profit	Number of tra...	Max DD	Max % DD	Ret/DD	R Exp	AR %	Consecutive L...
Original	$ 15354.8	153.55 %	730.0	$ 1972.3	10.16 %	0.08	0.31 R	12.8 %	20
50	$ 15233.51	152.34 %	730.0	$ 2225.78	13.62 %	0.07	0.31 R	12.7 %	16
60	$ 13770.29	137.7 %	730.0	$ 2395.77	14.96 %	0.06	0.28 R	11.48 %	17
70	$ 12338.47	123.38 %	730.0	$ 2600.68	16.47 %	0.05	0.26 R	10.28 %	18
80	$ 10741.91	107.42 %	730.0	$ 2904.7	18.73 %	0.04	0.22 R	8.95 %	19
90	$ 8518.47	85.18 %	730.0	$ 3378.67	22 %	0.03	0.18 R	7.1 %	21
92	$ 7983.99	79.84 %	730.0	$ 3500.54	23.19 %	0.03	0.17 R	6.65 %	22
95	$ 6845.73	68.46 %	730.0	$ 3776.58	25.57 %	0.02	0.14 R	5.71 %	23
97	$ 5654.31	56.54 %	730.0	$ 4079.68	28.49 %	0.02	0.12 R	4.71 %	25
98	$ 4746.95	47.47 %	730.0	$ 4323.53	30.24 %	0.01	0.1 R	3.96 %	26
99	$ 3158.76	31.59 %	730.0	$ 4751.97	33.9 %	0.01	0.07 R	2.63 %	28
100	$ -1792.59	-17.93 %	730.0	$ 6208.3	53.55 %	-0	-0.04 R	-1.49 %	41

- Statistics
  - > Simulations = 4,000 Runs x 10
  - > Return / DD ratio（mean ± SD of 10 Runs） = 1.7389 ± 0.0648

Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

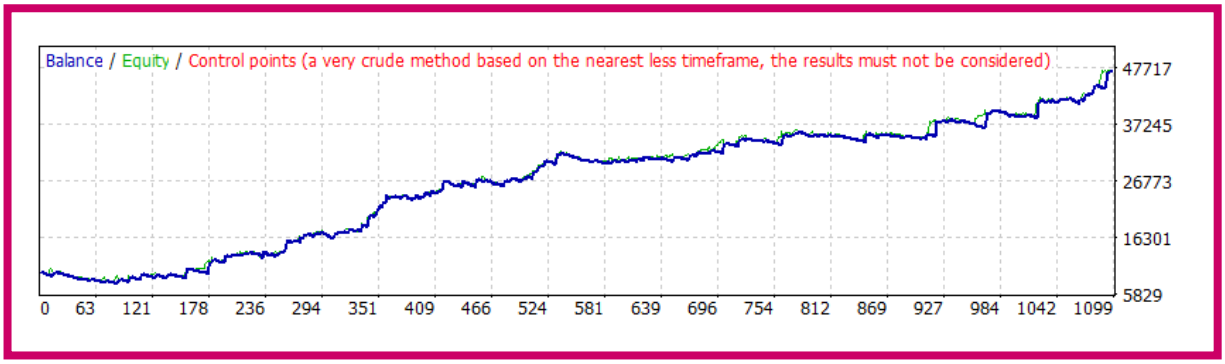
 Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

W2C-Angely_Normal_GBPJPY

- 通貨ペア ; GBPJPY
- 時間軸 ; D1
- テスト環境 ; MetaTrader4 – OANDA-Japan Practice（Build 1045）
- 期間 ; 2005.01.01 – 2017.01.01
- パラメータ ; Lots = 0.1, Spread = 40（4.0 pips）

Strategy Tester Report

- 詳細 ⇒ http://w2c-angely.trgy.co.jp/download/str/StrategyTester_AN_GJ.htm
- Initial deposit ; $ 10,000.00
- Profit factor ; 1.63
- Total net profit ; $ 3,7421.51 / 12 年
- Maximal DrawDown ; $ 2,600.30（11.27 %）/ 12 年
- Return / DD ratio ; 14.39
- Total Trades ; 1095 / 12 年
- # of Wins（won %） ; 255（23.29 %）
- # of Losses（lost %） ; 840（76.71 %）
- Largest ; Win = $ 1,571.57 Loss = $ - 485.32
- Average ; Win = $ 378.34 Loss = $ - 70.30

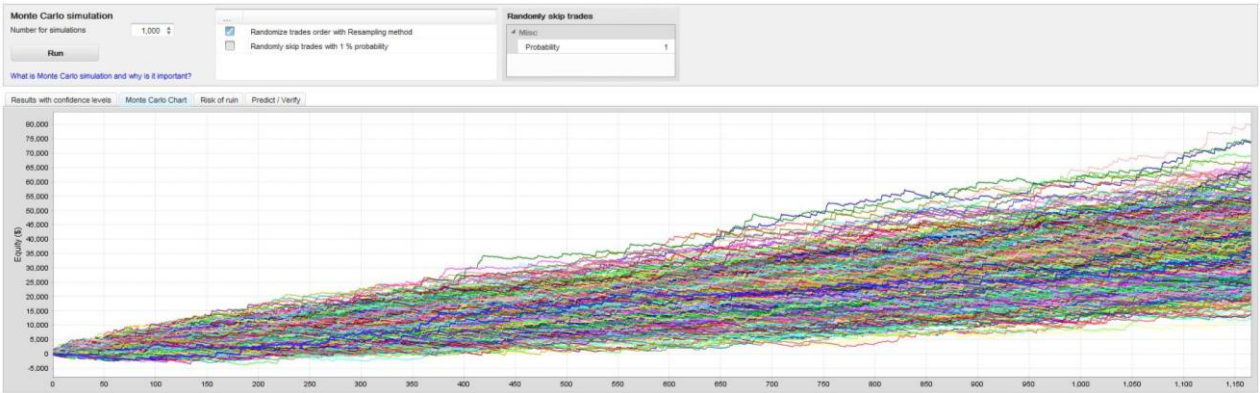


Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

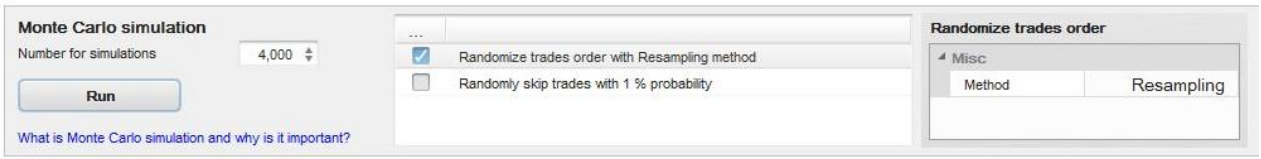
Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

Monte Carlo analysis

- Equity Curves
  - > Simulations = 1,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



- Table example
  - > Simulations = 4,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



Results with confidence levels | Monte Carlo Chart | Risk of ruin | Predict / Verify

Monte Carlo results with confidence levels

Confidence level	Net Profit	% Net Profit	Number of tra...	Max DD	Max % DD	Ret/DD	R Exp	AR %	Consecutive L...
Original	$ 37421.51	374.22 %	1167.0	$ 2152.75	21.9 %	0.17	0.5 R	31.17 %	27
50	$ 37574.59	375.75 %	1167.0	$ 2858.16	13.06 %	0.13	0.49 R	31.3 %	23
60	$ 35184.52	351.85 %	1167.0	$ 3054.05	14.24 %	0.12	0.46 R	29.31 %	25
70	$ 32205.46	322.05 %	1167.0	$ 3271.56	15.77 %	0.1	0.42 R	26.82 %	26
80	$ 29269.41	292.69 %	1167.0	$ 3575.85	17.89 %	0.09	0.39 R	24.38 %	28
90	$ 25194.34	251.94 %	1167.0	$ 4062.57	21.32 %	0.07	0.34 R	20.98 %	31
92	$ 24309.76	243.1 %	1167.0	$ 4234.94	22.46 %	0.07	0.33 R	20.25 %	32
95	$ 22361.7	223.62 %	1167.0	$ 4553.78	24.69 %	0.06	0.3 R	18.63 %	34
97	$ 20501.66	205.02 %	1167.0	$ 4855.52	27.3 %	0.05	0.28 R	17.08 %	36
98	$ 19343.61	193.44 %	1167.0	$ 5124.08	29.97 %	0.05	0.27 R	16.11 %	37
99	$ 16831.08	168.31 %	1167.0	$ 5618.39	33.27 %	0.04	0.23 R	14.02 %	40
100	$ 3747.4	37.47 %	1167.0	$ 7465.51	57.02 %	0.01	0.06 R	3.12 %	65

- Statistics
  - > Simulations = 4,000 Runs x 10
  - > Return / DD ratio（mean ± SD of 10 Runs） = 4.8168 ± 0.10921

Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

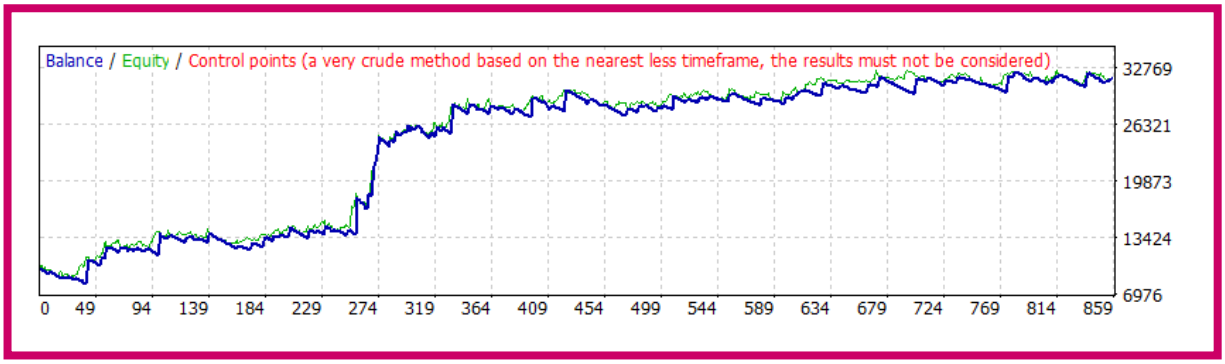
 Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

W2C-Angely_Normal_GBPUSD

- 通貨ペア ; GBPUSD
- 時間軸 ; D1
- テスト環境 ; MetaTrader4 – OANDA-Japan Practice（Build 1045）
- 期間 ; 2005.01.01 – 2017.01.01
- パラメータ ; Lots = 0.1, Spread = 18（1.8 pips）

Strategy Tester Report

- 詳細 ⇒ http://w2c-angely.trgy.co.jp/download/str/StrategyTester_AN_GU.htm
- Initial deposit ; $ 10,000.00
- Profit factor ; 1.63
- Total net profit ; $ 21,487.30 / 12 年
- Maximal DrawDown ; $ 3,068.50（11.27 %）/ 12 年
- Return / DD ratio ; 7.00
- Total Trades ; 856 / 12 年
- # of Wins（won %） ; 195（22.78 %）
- # of Losses（lost %） ; 661（77.22 %）
- Largest ; Win = $ 2,137.20 Loss = $ - 409.80
- Average ; Win = $ 387.91 Loss = $ - 81.93

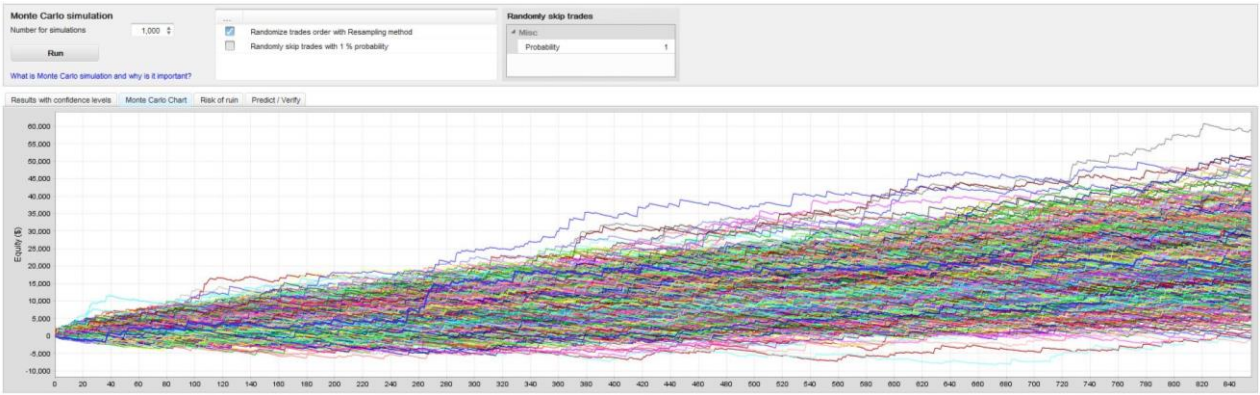


Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

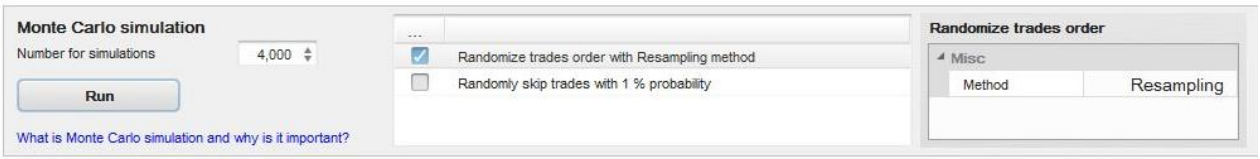
Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

Monte Carlo analysis

- Equity Curves
  - > Simulations = 1,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



- Table example
  - > Simulations = 4,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



Results with confidence levels | Monte Carlo Chart | Risk of ruin | Predict / Verify

Monte Carlo results with confidence levels

Confidence level	Net Profit	% Net Profit	Number of tra...	Max DD	Max % DD	Ret/DD	R Exp	AR %	Consecutive L...
Original	$ 21487.3	214.87 %	856.0	$ 2883.7	18.05 %	0.07	0.31 R	17.89 %	28
50	$ 21298.81	212.99 %	856.0	$ 3578.56	19.31 %	0.06	0.31 R	17.74 %	21
60	$ 19220.46	192.2 %	856.0	$ 3853.17	21.42 %	0.05	0.28 R	16.01 %	22
70	$ 17037.86	170.38 %	856.0	$ 4221.12	23.98 %	0.04	0.25 R	14.19 %	24
80	$ 14406.88	144.07 %	856.0	$ 4679.41	27.47 %	0.03	0.22 R	12 %	26
90	$ 10842.72	108.43 %	856.0	$ 5455.52	32.82 %	0.02	0.16 R	9.03 %	28
92	$ 10023.27	100.23 %	856.0	$ 5710.25	34.32 %	0.02	0.15 R	8.35 %	29
95	$ 8242.47	82.42 %	856.0	$ 6141.76	38.32 %	0.02	0.13 R	6.86 %	31
97	$ 6466.21	64.66 %	856.0	$ 6638.45	42.49 %	0.01	0.1 R	5.38 %	33
98	$ 5268.76	52.69 %	856.0	$ 6979.82	46.11 %	0.01	0.08 R	4.39 %	35
99	$ 3660.34	36.6 %	856.0	$ 7564.23	53.32 %	0.01	0.05 R	3.05 %	37
100	$ -6158.13	-61.58 %	856.0	$ 11146.01	83.66 %	-0.01	-0.1 R	-5.13 %	47

- Statistics
  - > Simulations = 4,000 Runs x 10
  - > Return / DD ratio（mean ± SD of 10 Runs） = 1.3040 ± 0.0433

Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

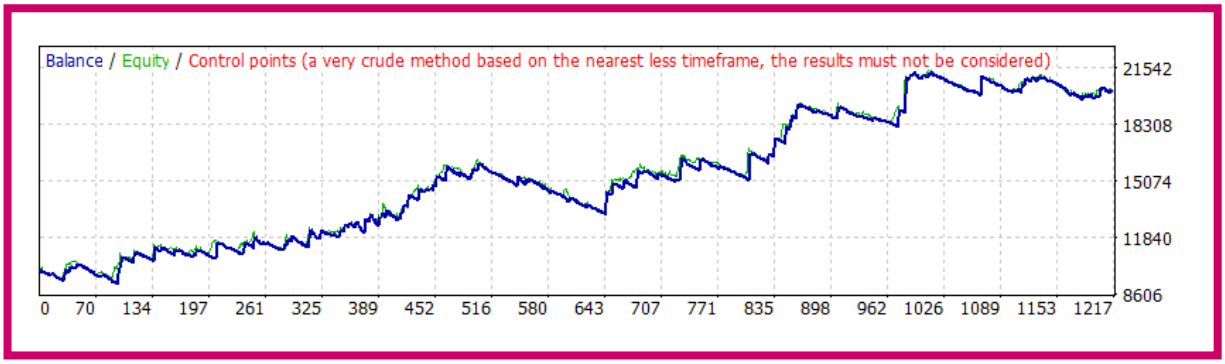
 Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

W2C-Angely_Normal_USDJPY

- 通貨ペア ; USDJPY
- 時間軸 ; D1
- テスト環境 ; MetaTrader4 – OANDA-Japan Practice（Build 1045）
- 期間 ; 2005.01.01 – 2017.01.01
- パラメータ ; Lots = 0.1, Spread = 12（1.2 pips）

Strategy Tester Report

- 詳細 ⇒ http://w2c-angely.trgy.co.jp/download/str/StrategyTester_AN_UJ.htm
- Initial deposit ; $ 10,000.00
- Profit factor ; 1.31
- Total net profit ; $ 1,0305.36 / 12 年
- Maximal DrawDown ; $ 3,217.09（19.60 %）/ 12 年
- Return / DD ratio ; 3.20
- Total Trades ; 1212 / 12 年
- # of Wins（won %） ; 196（16.17 %）
- # of Losses（lost %） ; 1016（83.83 %）
- Largest ; Win = $ 1,024.11 Loss = $ - 158.30
- Average ; Win = $ 221.77 Loss = $ - 32.64

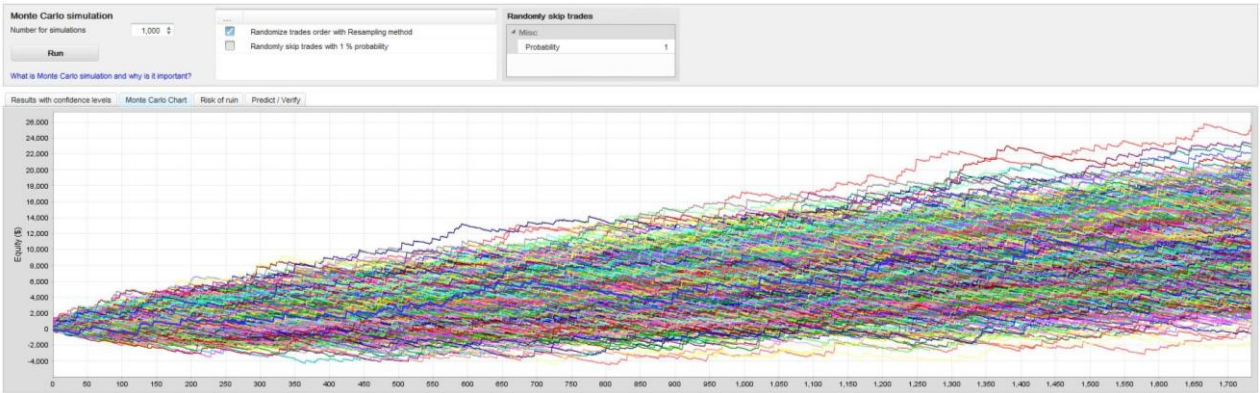


Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

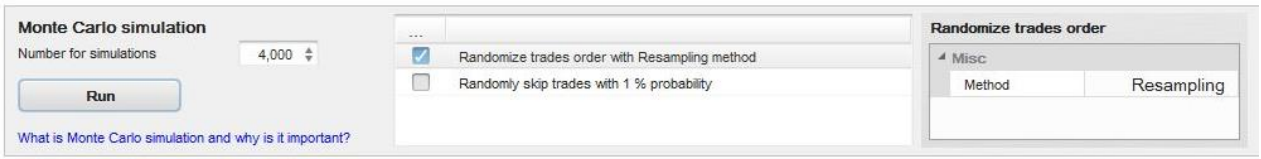
Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

Monte Carlo analysis

- Equity Curves
  - > Simulations = 1,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



- Table example
  - > Simulations = 4,000 Runs
  - > Setting = Randomize trades order with Resampling method



Results with confidence levels | Monte Carlo Chart | Risk of ruin | Predict / Verify

Monte Carlo results with confidence levels

Confidence level	Net Profit	% Net Profit	Number of tra...	Max DD	Max % DD	Ret/DD	R Exp	AR %	Consecutive L...
Original	$ 10305.36	103.05 %	1734.0	$ 2842.98	17.71 %	0.04	0.28 R	8.59 %	50
50	$ 10295.52	102.96 %	1734.0	$ 2145.74	14.34 %	0.05	0.28 R	8.58 %	46
60	$ 9188.67	91.89 %	1734.0	$ 2318.63	15.77 %	0.04	0.25 R	7.66 %	49
70	$ 8009.1	80.09 %	1734.0	$ 2537.38	17.53 %	0.03	0.22 R	6.67 %	52
80	$ 6641.3	66.41 %	1734.0	$ 2810.1	19.74 %	0.03	0.18 R	5.53 %	55
90	$ 4859.21	48.59 %	1734.0	$ 3277.3	23.58 %	0.02	0.13 R	4.05 %	62
92	$ 4249.73	42.5 %	1734.0	$ 3418.78	25.03 %	0.01	0.12 R	3.54 %	64
95	$ 3313.22	33.13 %	1734.0	$ 3680.66	27.77 %	0.01	0.09 R	2.76 %	68
97	$ 2276.68	22.77 %	1734.0	$ 4049.69	30.62 %	0.01	0.06 R	1.9 %	73
98	$ 1683.06	16.83 %	1734.0	$ 4352.13	33.08 %	0	0.05 R	1.4 %	76
99	$ 326.8	3.27 %	1734.0	$ 4647.13	36.6 %	0	0.01 R	0.27 %	82
100	$ -3043.95	-30.44 %	1734.0	$ 6472.38	61.87 %	-0.01	-0.08 R	-2.54 %	121

- Statistics
  - > Simulations = 4,000 Runs x 10
  - > Return / DD ratio（mean ± SD of 10 Runs） = 0.9025 ± 0.0261

Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

 Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

Currency Pairs	Total trades	Profit factor *1	5*Pessimistic rate of return *2	Return / DD ratio *3	PF = 1 - 99.999%	PF = 1 - 99.99%	PF = 1 - 99.9%	PF = 1 - 99.0%	PF = 1 - 95.0%	PF = 1 + 95.0% *4	PF = 1 + 99.0%	PF = 1 + 99.9%	PF = 1 + 99.99%	PF = 1 + 99.999%	Monte Carlo analysis 95% CI		
															Total net	Max DD	R / DD ratio
AUDJPY	661	1.4348	0.7731	6.77	0.7068	0.7371	0.7731	0.8179	0.8583	1.1650	1.2227	1.2935	1.3566	1.4149	5041.46	2950.93	1.7084
AUDNZD	389	1.4308	0.5529	2.89	0.6340	0.6705	0.7140	0.7690	0.8192	1.2207	1.3004	1.4005	1.4915	1.5772	1312.49	2124.00	0.6179
CADJPY	503	1.3305	0.6485	4.69	0.6709	0.7043	0.7441	0.7940	0.8393	1.1915	1.2595	1.3439	1.4198	1.4905	2490.47	3858.04	0.6455
EURAUD	1508	1.1832	0.7708	4.03	0.7957	0.8179	0.8438	0.8756	0.9039	1.1063	1.1421	1.1852	1.2227	1.2567	2152.22	7000.98	0.3074
EURCAD	557	1.2893	0.6531	3.74	0.6847	0.7170	0.7553	0.8032	0.8466	1.1811	1.2450	1.3240	1.3948	1.4605	2280.32	4478.29	0.5092
EURJPY	523	1.6844	0.8187	8.85	0.6762	0.7092	0.7484	0.7975	0.8421	1.1875	1.2539	1.3361	1.4100	1.4788	8867.04	2773.29	3.1973
EURUSD	730	1.4459	0.7807	6.89	0.7190	0.7483	0.7829	0.8259	0.8647	1.1564	1.2108	1.2774	1.3364	1.3909	6587.19	3789.31	1.7384
GBPJPY	1095	1.6337	0.9572	14.39	0.7645	0.7896	0.8191	0.8556	0.8882	1.1259	1.1688	1.2208	1.2665	1.3081	22226.45	4615.30	4.8158
GBPUSD	856	1.3968	0.7506	7.00	0.7377	0.7653	0.7978	0.8382	0.8744	1.1436	1.1931	1.2534	1.3067	1.3556	8017.69	6149.41	1.3038
USDJPY	1212	1.3108	0.7283	3.20	0.7748	0.7990	0.8273	0.8622	0.8934	1.1193	1.1598	1.2088	1.2516	1.2906	3341.43	3701.92	0.9026

*1 Profit factor = Gross profit / Gross loss

*2 5*Pessimistic rate of return = $\dfrac{\text{\$ of Average win} * (\text{\# of win} - 5*\sqrt{\text{\# of win}})}{|\text{\$ of Average loss} * (\text{\# of loss} + 5*\sqrt{\text{\# of loss}})|}$

*3 Return / DD ratio = Total net profit / Maximal Drawdown

*4 PF = 1, **.*** % = 現トレード数で、PF = 1 の EA が CI = **.*** % でとりうる PF の上限または下限。

Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

- 通貨ペア ; GBPJPY operated by Compound interest（複利運用）
- 時間軸 ; D1
- テスト環境 ; MetaTrader4 – OANDA-Japan Practice（Build 1045）
- 期間 ; 2005.01.01 – 2017.01.01（Compound interest by every year）
- パラメータ ; Lots = 0.1, Spread = 40（4.0 pips）

- 詳細 ⇒ http://w2c-angely.trgy.co.jp/download/str/PortfolioCI.html
- Initial deposit ; $ 10,000.00
- Profit factor ; 1.56
- Total net profit ; $ 186,256.00 / 12 年
- Maximal DrawDown ; $ 21,134.32（1.62 %）/ 12 年
- Return / DD ratio ; 8.81
- Total Trades ; 1326 / 12 年
- # of Wins（won %） ; 342（27.65 %）
- # of Losses（lost %） ; 895（72.35 %）
- Largest ; Win = $ 10,663.40 Loss = $ - 2,413.19
- Average ; Win = $ 1,522.53 Loss = $ - 373.69

Where People Meet Profit - Trilogy Inc. / WinSquareClub

 Copyright (C) 2017 - Trilogy Inc. All Rights Reserved.

EA lineup of Trilogy Inc.