

Special EA from Trilogy

W2C-DIXIE

超絶ボリュームのバックテストが物語るその優位性
ディキシーがあなたのEAポートフォリオを熱くする

¥54,000



■ お申込み

<http://www.w2c-dixie.com/>

お申込みはこちら

本EAは予め申請された リアル口座1つ、および デモ口座1つ
での稼働が可能です。

以下レポート（仕様） もご一読下さい。



■ W2C-Dixie_ver1.**.ex4

開発者： 株式会社トリロジー
URL : <http://w2c-dixie.com>
価格 : ¥54,000

■ 要約

- ・ エントリー／イグジットが一对の売買ロジック
- ・ ベッティングのルールなし
- ・ 最大同時保有ポジション数2
- ・ 途転あり
- ・ 両建てあり
- ・ 週末たぎあり
- ・ 通貨ペア：USD/JPY
- ・ タイムフレーム：H1（1時間足）
- ・ トレード回数：月40回前後
- ・ 大相場を得意とする傾向
- ・ 狭いレンジ相場が苦手
- ・ 勝率は 40～50%前後
- ・ 利大損小（利：損 = 5 : 3）
- ・ 9年間の単年度バックテストすべてにおいてプラス

■ 概略・トレード条件

通貨ペア	:	USD/JPY
時間軸	:	H1
トレード頻度	:	400~600回/年
推奨時間帯	:	—
難易度	:	易
カテゴリ	:	シンプルトレード

■ ロジック概要

多くのテクニカル指標を実装。

長短トレンド系テクニカル指標により、トレンド相場と比較的大きなレンジ相場をカバー。

複数のオシレーター系テクニカル指標を初手エントリーのトリガーに使用。

複数のボラティリティ計測テクニカル指標をフィルターとして、その精度の向上を図っている。

急変動のケアを目的とし、エントリー後は必ずストップオーダーを入れるが、基本的にはその後の相場値動きの判断から自動的にイグジットは行われ、次のエントリーオーダーに備える。

狭いレンジ相場を苦手とする傾向あり。

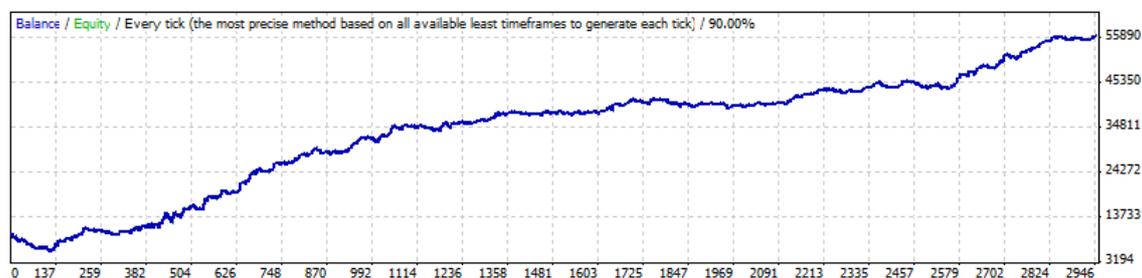
過去9年間、4000回を超えるバックテストにより示された、平均利益5対平均損失3の利大損小ロジックにより、長期にわたって着実に利益を積み上げると考えられる。

Strategy Tester Report

テスト環境 : AlpariJapan-Demo-1 (Build 509)
通貨ペア : USD/JPY (US Dollar vs Japanese Yen)
期間 : 1 Hour (H1) 2008.01.01 22:00 - 2013.12.30 23:00
パラメーター : Lots=0.2; Spread=10 (1.0pips);

テスト結果 :

- Initial deposit 10000.00
- Total net profit 46335.53 /6年
- Profit factor 1.36
- Expected payoff 15.75
- Maximal drawdown 4363.17 (43.49%) /6年
- Total trades 2942 /6年
- Profit trades 1291 (43.88%)
- Loss trades 1651 (56.12%)
- Largest profit trade 725.71 loss trade -198.56
- Average profit trade 134.54 loss trade -77.14



■ Strategy Tester Report 考察

以降、本報告の基準となるテスト結果として、前項を用いる。

スプレッドは、ドル円としては少しワイドな1.0pips (MT4テスター入力 ; Spread;10を選択) とし、ライブトレードでの未約定やスリッページへのマージンを確保した。

投下資金1万ドルに対して0.2ロット (=2万ドル) は、複数ポジションを取る W2C-Dixieにおいて、4倍相当のレバレッジとなる。

最大スタートロットに関しては、本テスト結果における最大ドロダウンから決定し、次項で報告する。

テスト期間6年間の総損益は、+46335ドルとなり、複利を用いない単年収益は、+7722ドル/年となった。

これはロットを増やすこと、及び運用益の複利効果を用いることで、容易に増加させることができる。

本EAの性能を表す数値は以下の通りである。

Profit factor	1.36 (173693÷127357)
Payoff ratio	1.74 (134.54÷ 77.14)
Expected payoff	15.75ドル (46335÷2942)
Maximal drawdown	4363ドル (43.49%)

取引数は年平均500回前後、同タイプEAと比較しても多い部類で、本テスト結果の正確性を議論するに十分な取引数であることを前置きする。

Profit factor=1.36 は、少し大きな値に感じられるかもしれないが、カーブフィッティングを疑うようなレベルではなく、十分に本ロジックの優位性を示す範囲内であると考えられる。

対して Maximal drawdown はかなり大きな値だが、これはスタート時期に大きく依存すること、また投下資金の増額やロットの縮小により抑制することが可能である。

EA稼働直後にこれに見舞われる悪例をケアするなら、その最大ロットは、0.4ロット (=4万ドル) となる。

勝率 43.88% (1291/2942*100) (負率 : 56.12%)は、トレードタイプ EAとして、使用者が非常に扱い易いものである。

勝ち負けの回数に差が少ないことは、同一期間における勝ち負けそれぞれの取引数が偏らないため、信頼性の高いテスト結果を得ることができる。

勝ちトレードと負けトレードの内容は、最大利益725ドル、最大損失-198ドルからもわかるように、利大損小（平均利益135.45ドル、平均損失-77.14ドル）となっており、これを好む投資家は多い。

売買ロジックは、リミット/ストップによる決済を除き、1時間足オープン・クローズでエントリー/イグジットを行うため、同期間における実トレード結果と Strategy Tester Report に大きな差は生まれない。
これは両者の比較により既に証明されている。

また、2種類のソースから取得したヒストリカルデータでのテスト結果を比較し、それが誤差の範囲内であることを確認した。

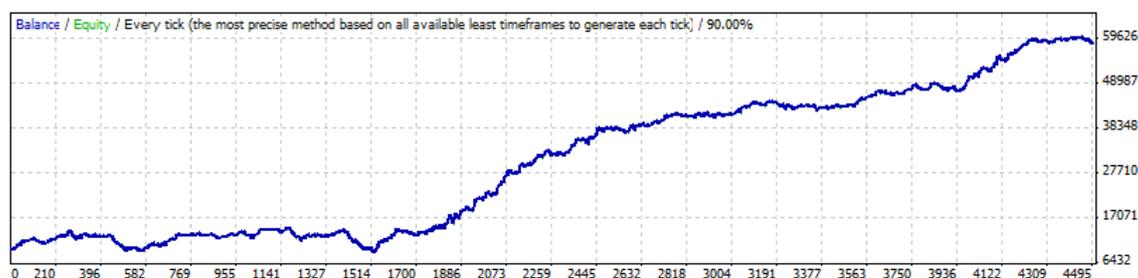
したがって、本レポート内 Strategy Tester Report の信頼度は非常に高いと考えられる。

■ Strategy Tester Report (2005.1-2014.4)

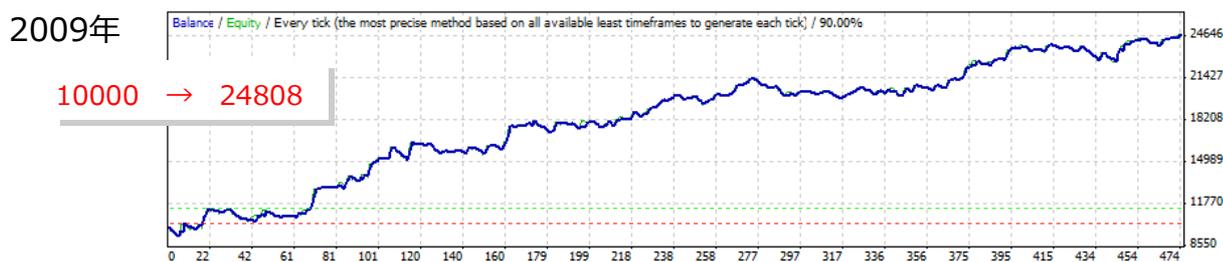
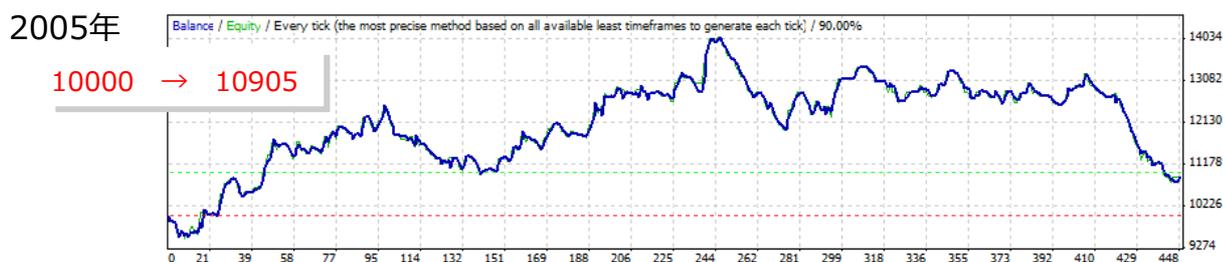
テスト環境 : AlpariJapan-Demo-1 (Build 509)
通貨ペア : USD/JPY (US Dollar vs Japanese Yen)
期間 : 1 Hour (H1) 2005.01.02 23:00 - 2014.04.24 23:00
パラメーター : Lots=0.2; Spread=10 (1.0pips);

テスト結果 :

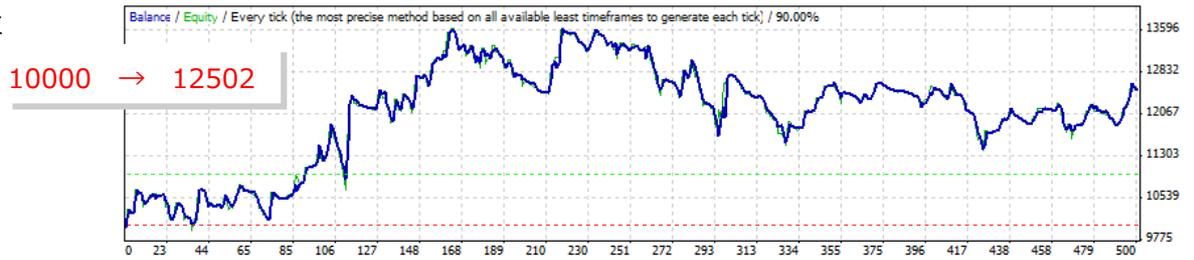
- Initial deposit 10000.00
- Total net profit 48594.69 /9年
- Profit factor 1.26
- Expected payoff 10.83
- Maximal drawdown 5892.47 (39.75%) /9年
- Total trades 4489 /9年
- Profit trades 1961 (43.68%)
- Loss trades 2528 (56.32%)
- Largest profit trade 725.71 loss trade -198.61
- Average profit trade 120.69 loss trade -74.40



■ 各年 損益増減曲線 一覽



2011年



2012年



2013年



2014年



※ 上記、各年の損益増減曲線をクリックすると、それぞれの Strategy Tester Report が表示されます。

一般的に信頼性があるとされている 2005年～ のヒストリカルデータ「10年間分」のテスト結果において、すべての年でプラス運用を確認した。

同評価において同等の結果を得ることができるEAは少ない。

■ 各年 Strategy Tester Report まとめ

- Initial deposit \$10000
- Total net profit \$395 ~ \$14808 /年
- Average \$5628 /年
- Profit factor 1.02 ~ 1.64
- Maximal drawdown \$4361.64 (43.48%) ~ \$1931.37 (8.90%)
- Total trades 447 ~ 552 回/年
- Profit trades (% of total) 40.68 ~ 48.20 %/年

通年の結果同様、各年のテスト結果からも、為替相場における本EAの優位性と、その存在を証明した。

なお、これからの運用においても直近の成績が重要であることに変わりはない。

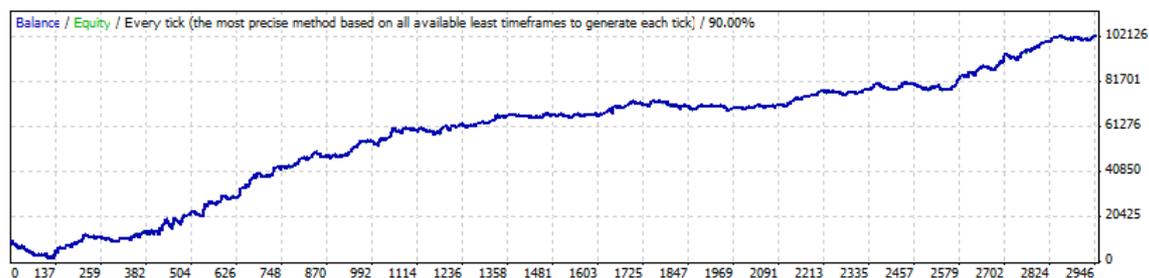
なぜなら、トレード環境が年々劇的に変化し続けているからであり、本EAが直近の成績において収益性が高いことは、本EAの優位性をさらに強固とする事実である。

■ Strategy Tester Report (Lots=0.4)

テスト環境 : AlpariJapan-Demo-1 (Build 509)
通貨ペア : USD/JPY (US Dollar vs Japanese Yen)
期間 : 1 Hour (H1) 2008.01.01 22:00 - 2013.12.30 23:00
パラメーター : Lots=0.4; Spread=10 (1.0pips);

テスト結果 :

- Initial deposit 10000.00
- Total net profit 92671.06 /6年
- Profit factor 1.36
- Expected payoff 31.50
- Maximal drawdown 8726.25 (86.70%) /6年
- Total trades 2942 /6年
- Profit trades 1291 (43.88%)
- Loss trades 1651 (56.12%)
- Largest profit trade 1451.43 loss trade -397.13
- Average profit trade 269.08 loss trade -154.28



ロットを 0.2→0.4 としテストした結果を上を示す。

ロットの増加に比例して、総利益は+97189ドルへ単純に増加、複利運用を用いない単年収益でも 約10400ドル/年となった。

Maximal drawdown が、スタート直後に発生する確率が低いと考えた場合、2005年～2013年の9年間にリーマンショック等を含むため、以降の実運用にも耐え得る可能性は高いと考える。

■ トレードサンプル

- ・ BUY、SELLそれぞれ2種類の異なるエントリー/イグジットのルールに加えて、エントリールールをイグジットに使う途転ルールにより、ポジション保有時間は比較的長い
- ・ レートに連動して設定された50pips、100pips前後の逆指値オーダーにより、相場急変動にも小さな損切りでダメージを抑える
- ・ 大きめに設定された利食い指値オーダー含め、指値逆指値が約定される前にイグジットされる

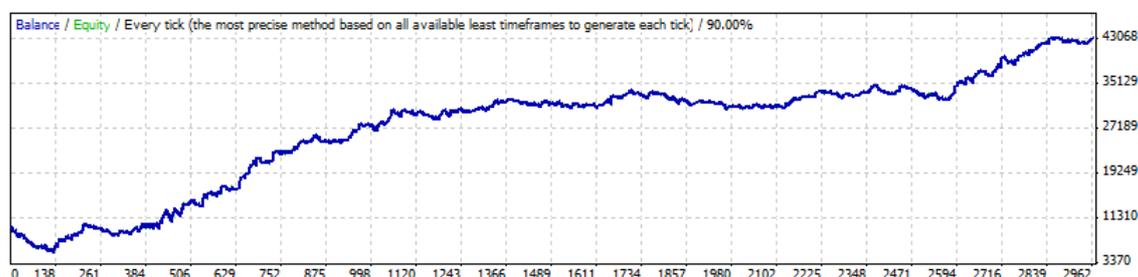


■ Strategy Tester Report (Spread=3pips)

テスト環境 : AlpariJapan-Demo-1 (Build 509)
通貨ペア : USD/JPY (US Dollar vs Japanese Yen)
期間 : 1 Hour (H1) 2008.01.01 22:00 - 2013.12.30 23:00
パラメーター : Lots=0.2; Spread=30 (3.0pips);

テスト結果 :

• Initial deposit	10000.00
• Total net profit	33109.65 /6年
• Profit factor	1.25
• Expected payoff	11.19
• Maximal drawdown	4927.80 (49.16%) /6年
• Total trades	2958 /6年
• Profit trades	1235 (41.75%)
• Loss trades	1723 (58.25%)
• Largest profit trade	730.42
• Largest loss trade	-198.53
• Average profit trade	136.13
• Average loss trade	-78.36



スプレッドを3.0pipsに変更しテストした結果を上を示す。

p.2に示した基準となるテスト結果に比べ、Total net profit、Maximal drawdown とともに悪化するという、ある意味当然の結果を得たが、Total trades 2958回における「偶然に起こり得るProfit factorの範囲 *)」は 1.07 であり、対して本結果である 1.25 は、十分な優位性を持つストラテジーであることを示した。

*) 出典 : <http://www.k22fx.com/24/beginner13.html>

■ お問い合わせ

ご質問等ございましたら、w2c.dixie@gmail.com までお気軽
にお問い合わせ下さい。

■ お申込み

<http://www.w2c-dixie.com/>

Special EA from Trilogy

W2C-DIXIE

超絶ボリュームのバックテストが物語るその優位性
ディキシーがあなたのEAポートフォリオを熱くする

¥54,000

お申込みはこちら

本EAは予め申請された リアル口座1つ、および デモ口座1つ
での稼働が可能です。