


問い合わせ・申込み

<http://w2c-matthew.trgy.co.jp/>



Special EA from Trilogy
W2C-Matthew
¥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。

以下レポート（仕様）もご一読下さい。

W2C-Matthew_ver1.**.ex4

開発者： 株式会社トリロジー

URL : <http://www.trgy.co.jp/>

要約

- ・ エントリー／イグジットが一对の売買ロジック
- ・ ロットコントロールなし
- ・ 最大2ポジション保持、基本途転（稀に両建て）
- ・ 週またぎあり
- ・ トレード回数は、月40回前後
- ・ 検証期間（6年）から導かれる最大のスタートロット（≒最大リスク）
は、1万ドル0.5Lot、レバレッジ10
- ・ 得意、苦手なパターンあり
- ・ 勝率は 40～50%前後
- ・ 利大損小 （利：損 = 5 : 3）

概略・トレード条件

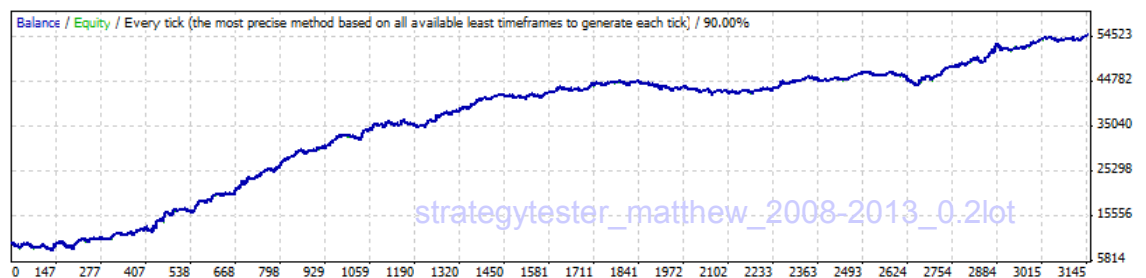
通貨ペア : USD/JPY
時間軸 : H1
トレード頻度 : 400~600回/年
推奨時間帯 : -
難易度 : 易
カテゴリ : シンプルトレード
他 :

Strategy Tester Report

test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
(2008.01.01 - 2013.12.31)
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 44865.42 /6年
- Profit factor 1.41
- Expected payoff 14.28
- Maximal drawdown 3411.03 (7.53%) /6年
- Total trades 3141 /6年
- Profit trades 1418 (45.14%)
- Loss trades 1723 (54.86%)
- Largest profit trade 725.35 loss trade -198.47
- Average profit trade 108.93 loss trade -63.61



https://sites.google.com/site/w2cmatthew/strategytester_matthew_2008-2013_0-2lot

Strategy Tester Report 続き

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。

原資1万ドルに対してLot:0.2 (2万ドル) は、複数ポジションを取るW2C-Matthewにおいて、4倍相当のレバレッジとなる。

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

テスト期間6年間の総損益は、+44865ドルとなり、複利運用を用いない単年度収益は、7478ドル/年となった。

もちろんこれは、スタートLotを増やすこと、及び運用益の複利効果を用いることにより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。

プロフィットファクター 1.41 (総利益154467÷総損失-109601)
期待利得 14.28ドル (44865÷3141)
最大ドローダウン 3411ドル (7.53%)

まず取引回数が3141回と、同様EAに比較しても多く、本テスト結果の正確性を議論するのに十分な試行回数であることを前提とする。

プロフィットファクター 1.41 は、少し大きな値に感じるが、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える。

対して最大ドローダウンは小さく、EA稼働直後にコレに見舞われる極端な例をケアするなら、その最大スタートLotは、0.5 (5万ドル) となる。

勝率 45.14% (1418/3141*100) (負率 : 54.86%)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、それぞれの試行回数が偏らないため、信頼性の高いテスト結果を得ることができる。

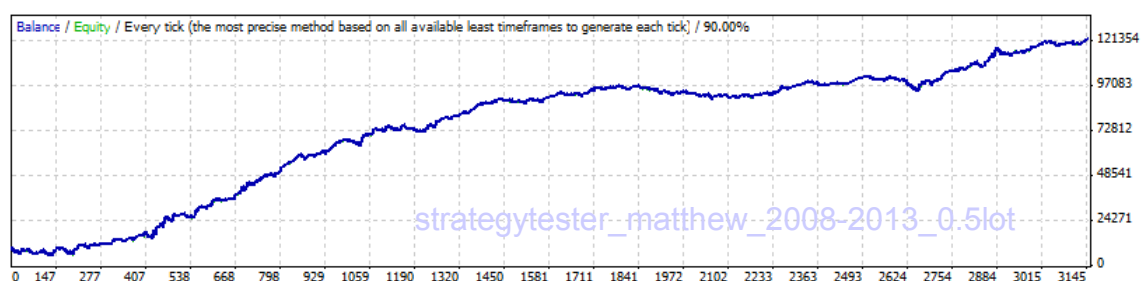
勝ちトレードと負けトレードの中身は、最大利益725ドル、最大損失-198ドルからもわかるように、利大損小 (平均利損108.93ドル、-63.61ドル) となっており、これを好む投資家は多い。

Strategy Tester Report

test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
(2008.01.01 - 2013.12.31)
パラメーター :
Lots=0.5; Spread=10 (1.0pips);

テスト結果 :

- Initial deposit 10000.00
- Total net profit 112163.96 /6年
- Profit factor 1.41
- Expected payoff 35.71
- Maximal drawdown 8527.55 (8.69%) /6年
- Total trades 3141 /6年
- Profit trades 1418 (45.14%)
- Loss trades 1723 (54.86%)
- Largest profit trade 1813.37 loss trade -496.17
- Average profit trade 272.33 loss trade -159.03



https://sites.google.com/site/w2cmatthew/strategytester_matthew_2008-2013_0.5lot

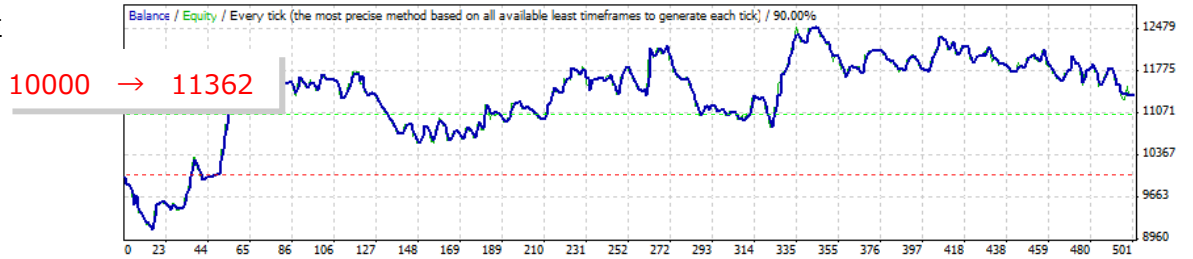
Lotを 0.2→0.5 としテストした結果を上を示す。

Lotの増加に比して、総損益は+112164ドルへ単純に増加、複利運用を用いない単年度収益でも 18694ドル/年となった。

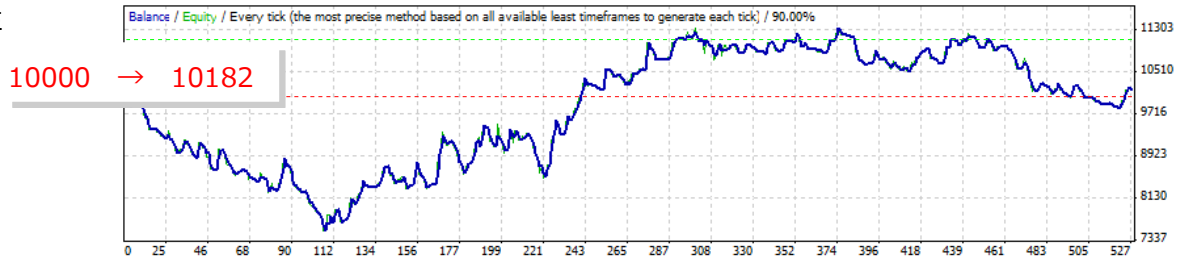
最大ドローダウン8528ドルが、スタート直後に訪れない確率が高いことと、2008年～2013年の直近6年間に、リーマンショック等ボラティリティの極大値を含むため、これは2014年以降の実運用にも十分に耐え得るスタートLotと考えられる。

各年度 Strategy Tester Report エクイティカーブ

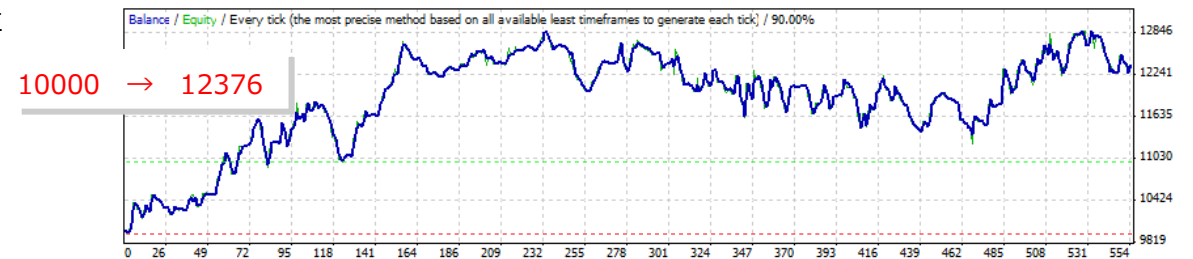
2005年



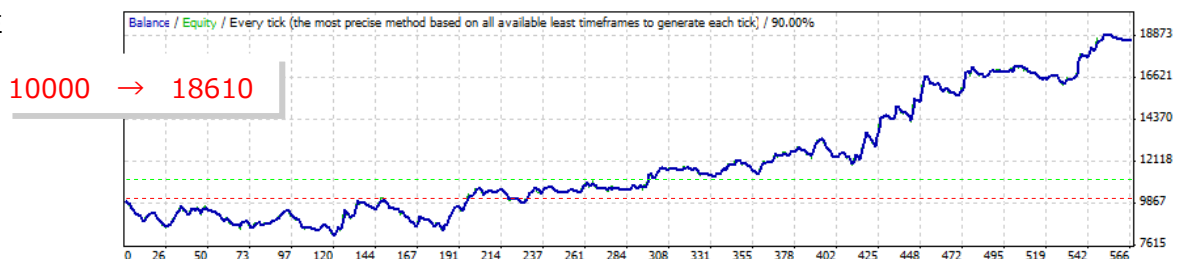
2006年



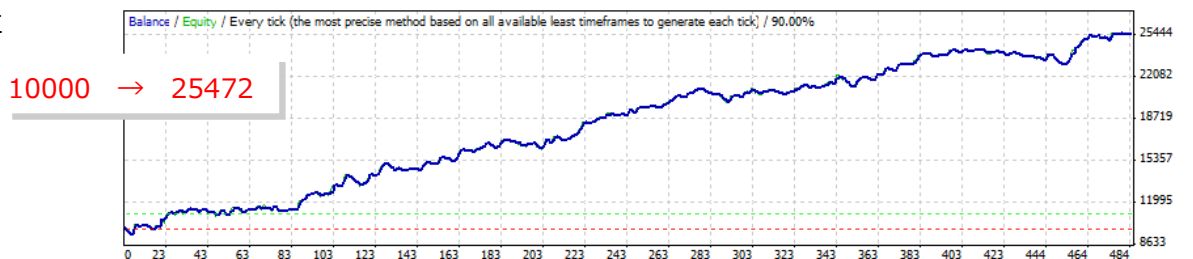
2007年



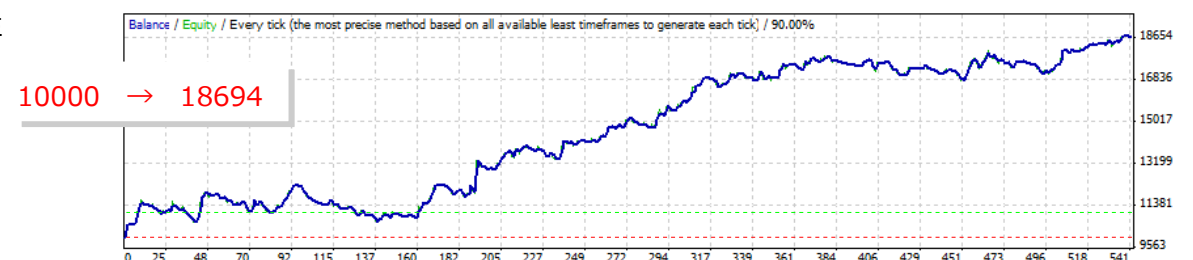
2008年



2009年



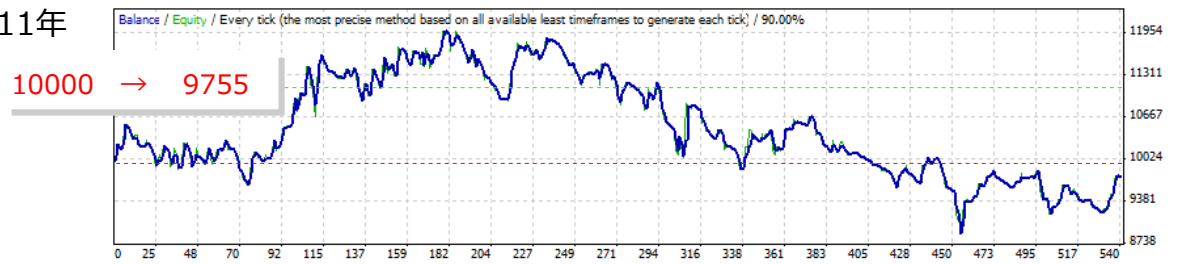
2010年



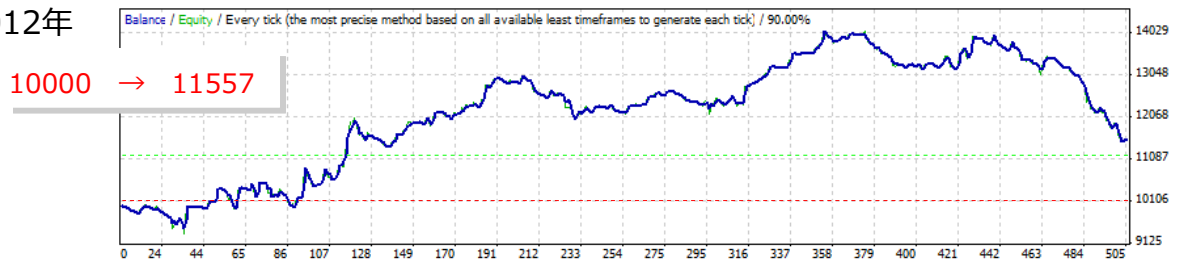
上記各年度のエクイティカーブ・グラフをクリックすると、それぞれの Strategy Tester Report が表示されます。

各年度 Strategy Tester Report エクイティカーブ

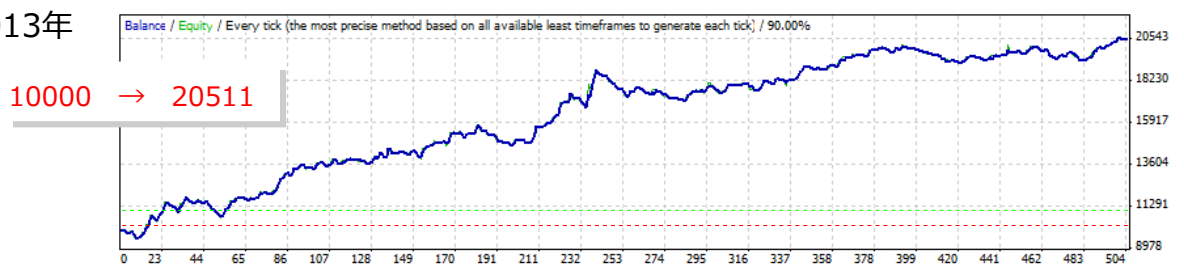
2011年



2012年



2013年



2014年



上記各年度のエクイティカーブ・グラフをクリックすると、それぞれの Strategy Tester Report が表示されます。

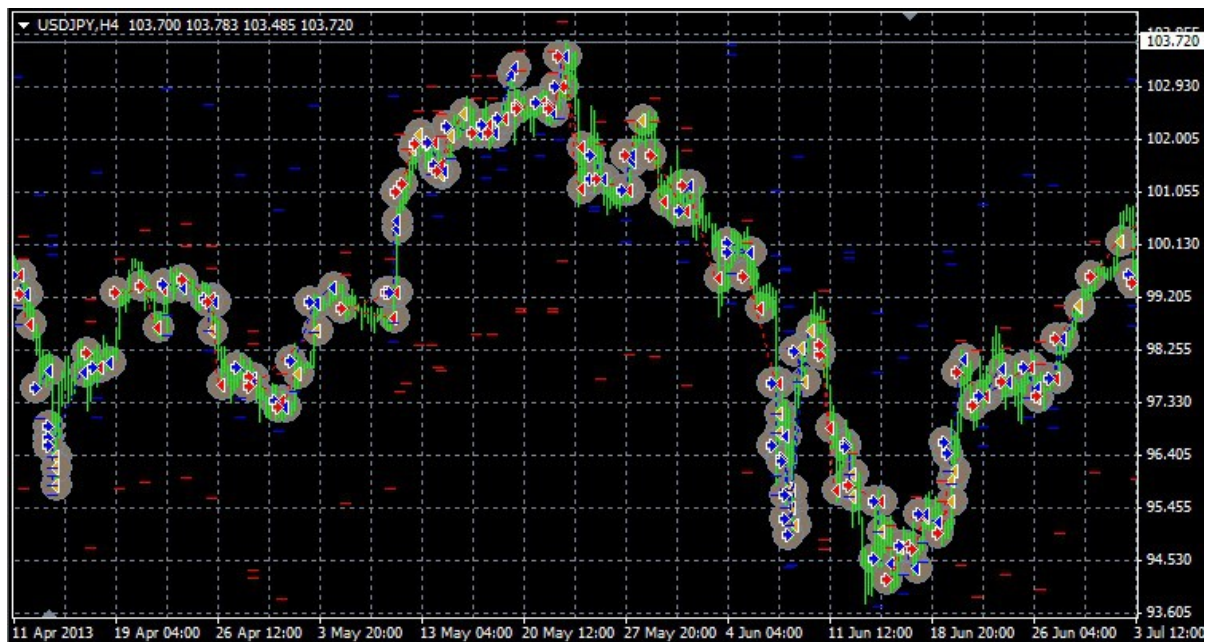
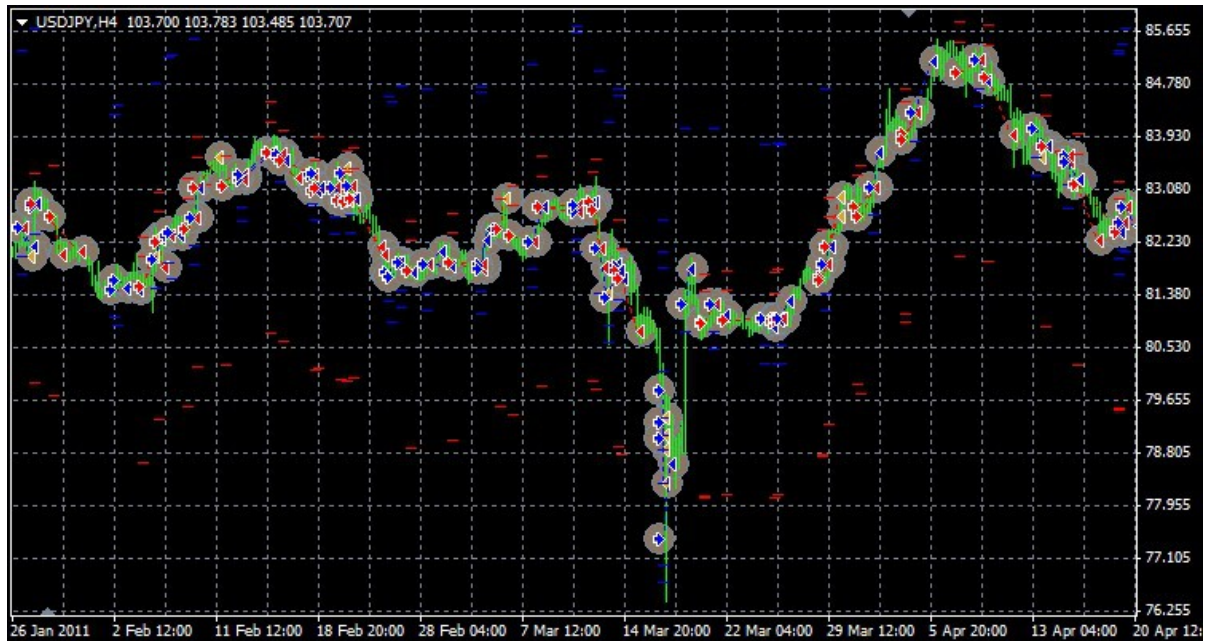
各年度 Strategy Tester Report まとめ

- Initial deposit 10000.00
- Total net profit -245 ~ 15472 /年
- Profit factor 0.99 ~ 1.85
- Expected payoff -0.45 ~ 32.03
- Maximal drawdown 3418.06 (27.95%) ~ 1563.89 (6.36%) /年
- Total trades 483 ~ 540 /年
- Profit trades (% of total) 37.98% ~ 51.14%

通年の結果同様、各年度で行ったテスト結果からも、十分に優秀なEAであることを示した。

トレードサンプル

- ・ 典型的なトレードサンプルをチャートとともに下に示す



Strategy Tester Report

test環境 : AlpariJapan-Demo-1 (Build 509)

通貨ペア : USD/JPY (US Dollar vs Japanese Yen)

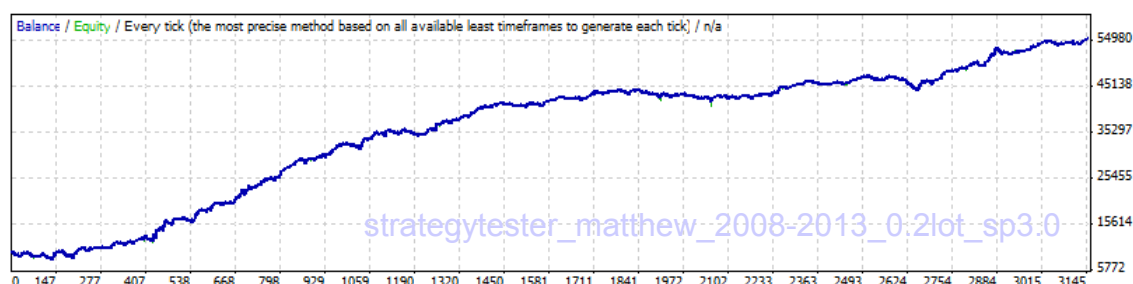
期間 : 1 Hour (H1) 2008.01.01 22:00 - 2013.12.30 23:00 (2008.01.01 - 2013.12.31)

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 30664.72 /6年
- Profit factor 1.26
- Expected payoff 9.72
- Maximal drawdown 5607.78 (15.08%) /6年
- Total trades 3154 /6年
- Profit trades 1355 (42.96%)
- Loss trades 1799 (57.04%)
- Largest profit trade 730.40 loss trade -198.60
- Average profit trade 109.34 loss trade -65.31



https://sites.google.com/site/w2cmatthew/strategytester_matthew_2008-2013_0-2lot_sp3-0

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ともに悪化するという、ある意味当然の結果を得たが、

Total trades 3154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 1.26 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>



Special EA from Trilogy
W2C-Matthew
¥54,000

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。

[お申込みはこちら](#)