

## 【ダウ／日経225先物システム】バックテスト結果

1. トレーディングターゲット    ダウの変動率が  以上のときに逆張りトレード  
 変動率の認識    | ②前日終値と当日終値の比較    ▼

2. ロスカットターゲット     円でロスカット  
 ロスカット時のスリッページコスト     円

3. バックテスト統計値    ※先物1枚でトレードしたときの損益

from	1990/1/4
to	2006/12/12

	ロング	ショート	合計	
総データ数			4,170	
総トレード数	1,422	1,637	3,059	
勝ちトレード数	642	830	1,472	
負けトレード数	780	807	1,587	
総損益	-2,730	40,980	38,250	単位: 千円
総利益	90,800	132,370	223,170	単位: 千円
総損失	-93,530	-91,390	-184,920	単位: 千円
平均損益	-1.9	25.0	12.5	単位: 千円
平均勝ち利益	141.4	159.5	151.6	単位: 千円
平均負け損失	-119.9	-113.2	-116.5	単位: 千円
トレード率			73.4%	
勝率	45.1%	50.7%	48.1%	
ペイオフレシオ	1.18	1.41	1.30	
プロフィットファクター	0.97	1.45	1.21	

