EXTRADER Algo 評価指標

集計期間 2025年1月 ～ 2026年8月 ／ 2025/1/1 以降のエントリー ／ 業種フィルタ＋日経平均MA乖離率フィルタ適用後 ／ 利益率は単利・複利計算なし

【全サイン集計】:本システムで発生したエントリーサインを全て集計したものです。

【スイングトレード】:1銘柄を保有→売却→保有と繰り返すトレードです。
※同時にサインが出た場合は時価総額上位を採用。）

対象銘柄:時価総額上位200銘柄、【1570】日経レバレッジ
採用設定:【F04】【B10】

指標	全サイン集計	スイングトレード
■ 取引回数		
建玉数	285	154
約定回数	530	284
勝ちトレード	186	98
負けトレード	99	56
■ 収益性		
勝率(%)	65.26	63.64
利益率合計(%)	184.24	98.06
総利益(%)	279.48	148.88
総損失(%)	-95.24	-50.81
★ プロフィットファクター	2.934	2.93
1建玉平均(%)	0.646	0.637
勝ちトレード平均(%)	1.503	1.519
負けトレード平均(%)	-0.962	-0.907
ペイオフレシオ	1.562	1.674
■ リスク		
最大利益(%)	9.69	9.69
最大損失(%)	-5.06	-3.27
標準偏差(%)	1.971	2.015
★ 最大ドローダウン(%)	-11.18	-4.92
MDD発生時の取引番号	82	64
★ リカバリーファクター	16.478	19.937
最大連勝	15	8
最大連敗	5	3
■ 月次		
月平均(%)	9.21	4.9
月中央値(%)	5.8	4.27
プラス月数	18	16
月数	20	20
プラス月率(%)	90	80
最良月(%)	36.14	18.16
最悪月(%)	-2.11	-0.92
月次標準偏差	9.86	4.8
★ 月次シャープレシオ	0.935	1.02
■ その他		
平均保有日数	1.43	1.38