

**EasyLTP**

**2016年11月度**

**月次レポート**

2016/12/06

●稼働以来のパフォーマンス( 2015/10/02 ~ )

<<2015 年 10 月 02 日~2016 年 11 月 30 日現在>>



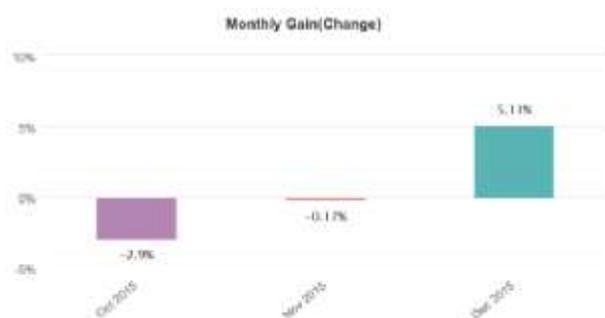
Advanced Statistics		Trades	Summary	Hourly	Daily	Risk Of Ruin	Duration	MAE/MFE
Trades:	1281	Longs Won:	(375/615) 60%	Profit Factor:	1.01			
Profitability:	<div style="width: 50%; background-color: green;"></div>	Shorts Won:	(401/666) 60%	Standard Deviation:	\$38.75			
Pips:	315.0	Best Trade(\$):	(Apr 11) 92.72	Sharpe Ratio:	0.00			
Average Win:	25.90 pips / \$24.19	Worst Trade(\$):	(Oct 09) -222.83	Z-Score (Probability):	-4.06 (99.99%)			
Average Loss:	-39.18 pips / -\$36.96	Best Trade (Pips):	(Apr 11) 92.3	Expectancy:	0.2 Pips / \$0.08			
Lots:	128.1	Worst Trade (Pips):	(Oct 09) -219.0	AHPR:	0.00%			
Commissions:	\$0.00	Avg. Trade Length:	11h 2m	GHPR:	0.00%			



## EasyLTP 2016 年 11 月度 月次レポート



## &lt;&lt;2015 年&gt;&gt;



## &lt;&lt;2016 年&gt;&gt;



## 【分析】

2016 年 11 月 30 日現在のトータルトレード数は1281 回、勝率は買いトレードが615 トレード中375 勝の60%、  
売りトレードが666 トレード中 4 0 1 勝の60%、PF は1.01 っており、勝率、PF ともに10 月末時点からの変化  
 はありません。

11 月は、結果的には成績としてはほぼ変化のない1 か月となりました。

EasyLTP に搭載されている13 のトレード戦略別の成績を見ると、EasyLTP07、EasyLTP11、EasyLTP13 の3つのトレード戦略が、順調に推移しています。

特に、EasyLTP07 が11 月は右肩上がりに推移しており、目先の好調戦略の筆頭となっています。

また平均利益と平均損失に関しましては、平均利益額 25.90pips に対して平均損失額 39.18pips と、平均利益は微減、平均損失は微増となっています。

ただ、損失が利益の1.5 倍程度であることに変わりはなく、これは1 回の損失は平均して1.5 回のトレードで回復できることを意味するため、安心して取引できる大きな材料となることに変わりはありません。

10 月は調子のよいトレードとなりましたので、11 月も期待しておりましたが、結果的には成績はほぼ横ばいの状態となっています。

これまでの実績としては、月次ベースでの最大の損失が今年 9 月の 8%ほどとなっており、これまでの1 年以上に渡る運用の中で 10% を超えたことはありません。

リスク度合いは、人それぞれではありますが、月次で 10% までの損失であれば比較的多くの方が許容できるレベルではないかと思えます。

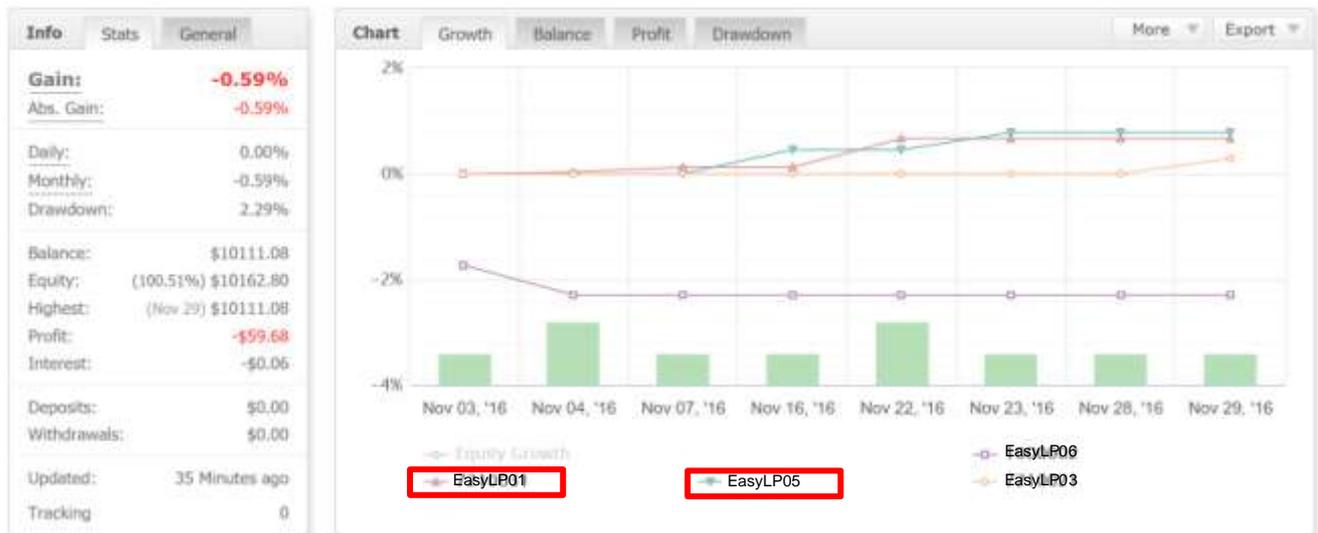
この点も、このEA が多くの方に、かつ中長期的に運用していただきたEA のポイントとなっています。

●2016 年 11 月 01 日-11 月 30 日のトレード

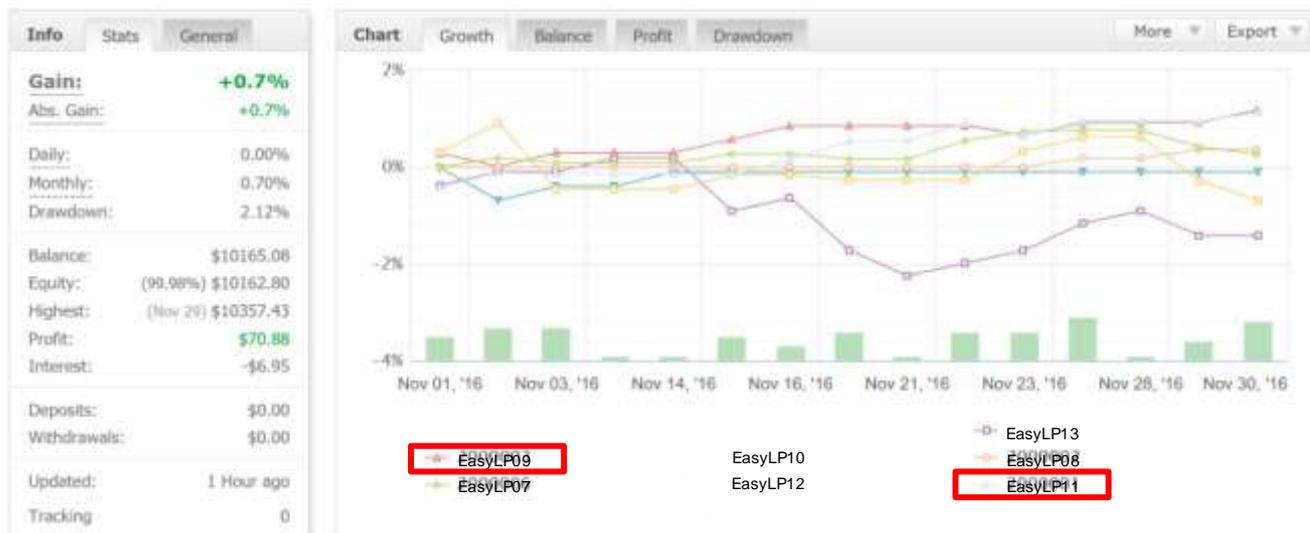
<<2016 年 11 月 01 日~2016 年 11 月 30 日>>



Advanced Statistics		Trades	Summary	Hourly	Daily	Risk Of Ruin	Duration	MAE/MFE
Trades:	80	Longs Won:	(27/38) 71%	Profit Factor:	1.01			
Profitability:	<div style="width: 50%; background-color: green;"></div>	Shorts Won:	(25/42) 59%	Standard Deviation:	\$40.88			
Pips:	22.8	Best Trade(\$):	(Nov 16) 45.40	Sharpe Ratio:	0.00			
Average Win:	25.86 pips / \$24.22	Worst Trade(\$):	(Nov 03) -176.52	Z-Score (Probability):	-0.72 (52.85%)			
Average Loss:	-47.21 pips / -\$44.59	Best Trade (Pips):	(Nov 16) 45.4	Expectancy:	0.3 Pips / \$0.14			
Lots:	8	Worst Trade (Pips):	(Nov 03) -176.8	AHPR:	0.00%			
Commissions:	\$0.00	Avg. Trade Length:	8h 19m	GHPR:	0%			



EasyLTP 2016 年 11 月度 月次レポート



<< 決済トレード

>>

Trading Activity		Open Trades (2)	Open Orders (0)	History (80)	Exposure	More							
Open Date	Close date	Symbol	Action	Lots	SL(Price)	TP(Price)	Open Price	Close Price	Pips	Net Profit	Duration	Gain	
10.31.2016 18:00	11.01.2016 06:00	AUDUSD	Sell	0.10	0.77254	0.75804	0.76106	0.76515	-40.9	-41.26	12h 0m	-0.41%	
10.31.2016 18:01	11.01.2016 17:00	USDJPY	Buy	0.10	104.423	105.323	105.02500	104.62200	-40.3	-38.63	22h 59m	-0.38%	
11.01.2016 00:02	11.01.2016 10:00	EURJPY	Buy	0.10	113.084	115.334	115.03600	115.33400	29.8	28.39	9h 58m	0.28%	
11.01.2016 00:46	11.01.2016 10:09	GBPUSD	Buy	0.10	1.20375	1.22675	1.22375	1.22675	30.0	30.00	9h 23m	0.30%	
11.01.2016 17:00	11.01.2016 17:00	EURUSD	Sell	0.10	1.12387	1.10087	1.10382	1.10400	-1.8	-1.80	1s	-0.02%	
11.01.2016 18:00	11.02.2016 17:00	EURUSD	Sell	0.10	1.12419	1.10119	1.10414	1.11099	-68.5	-68.48	23h 0m	-0.67%	
11.02.2016 00:09	11.02.2016 03:46	AUDUSD	Sell	0.10	0.77719	0.76269	0.76569	0.76269	30.0	30.00	3h 37m	0.30%	
11.02.2016 00:39	11.02.2016 12:00	EURJPY	Buy	0.10	113.060	115.310	115.01100	114.72600	-28.5	-27.53	11h 21m	-0.27%	
11.02.2016 00:57	11.02.2016 09:56	GBPUSD	Buy	0.10	1.20383	1.22683	1.22383	1.22688	30.5	30.50	8h 59m	0.30%	
11.02.2016 02:00	11.02.2016 13:46	USDCAD	Sell	0.10	1.35670	1.33670	1.33922	1.33670	25.2	18.85	11h 46m	0.19%	
11.02.2016 10:59	11.02.2016 13:43	GBPUSD	Buy	0.10	1.20709	1.23009	1.22709	1.23020	31.1	31.10	2h 44m	0.31%	
11.02.2016 10:59	11.02.2016 13:48	USDJPY	Sell	0.10	104.250	103.350	103.65000	103.34800	30.2	29.22	2h 49m	0.29%	
11.02.2016 12:00	11.03.2016 12:05	GBPUSD	Sell	0.10	1.24408	1.22208	1.22658	1.24426	-176.8	-176.52	1d	-1.74%	
11.02.2016 20:00	11.03.2016 13:45	EURUSD	Sell	0.10	1.12987	1.10687	1.10988	1.10687	30.1	30.16	17h 45m	0.30%	
11.02.2016 21:27	11.03.2016 02:48	USDJPY	Sell	0.10	104.055	103.155	103.45100	103.15300	29.8	27.14	5h 21m	0.27%	
11.02.2016 22:15	11.03.2016 04:44	EURJPY	Sell	0.10	116.717	114.467	114.76700	114.45900	30.8	29.06	6h 29m	0.29%	
11.03.2016 02:43	11.03.2016 17:00	GBPUSD	Sell	0.10	1.25063	1.22763	1.23063	1.24449	-138.6	-138.60	14h 16m	-1.38%	
11.03.2016 07:20	11.03.2016 17:00	USDJPY	Sell	0.10	103.394	102.494	102.79400	103.07400	-28.0	-27.16	9h 40m	-0.27%	
11.03.2016 09:32	11.03.2016 17:00	USDCAD	Sell	0.10	1.35486	1.33486	1.33736	1.33873	-13.7	-10.23	7h 28m	-0.10%	
11.03.2016 12:06	11.03.2016 17:00	AUDUSD	Sell	0.10	0.77888	0.76438	0.76738	0.76769	-3.1	-3.10	4h 54m	-0.03%	

## EasyLTP 2016 年 11 月度 月次レポート

Trading Activity		Open Trades (2)	Open Orders (0)	History (80)	Exposure	More ▾								
Open Date ▲	Close date	Symbol	Action	Lots	SL(Price)	TP(Price)	Open Price	Close Price	Pips	Net Profit	Duration	Gain		
11.03.2016 20:00	11.04.2016 16:00	GBPUSD	Sell	0.10	1.26208	1.24008	1.24458	1.25027	-56.9	-56.81	20h 0m	-0.58%		
11.04.2016 17:00	11.04.2016 17:02	AUDUSD	Buy	0.10	0.74873	0.76963	0.76693	0.76721	2.8	2.80	2m	0.03%		
11.07.2016 00:30	11.07.2016 01:07	AUDUSD	Buy	0.10	0.74834	0.76924	0.76654	0.76751	9.7	9.70	37m	0.10%		
11.08.2016 00:02	11.08.2016 14:01	USDJPY	Buy	0.10	103.880	104.780	104.48000	104.78000	30.0	28.63	13h 59m	0.29%		
11.14.2016 18:00	11.14.2016 20:18	EURUSD	Buy	0.10	1.05231	1.07531	1.07233	1.07531	29.8	29.80	2h 18m	0.30%		
11.15.2016 00:19	11.15.2016 10:38	USDJPY	Buy	0.10	107.785	108.685	108.38500	107.78500	-60.0	-55.67	10h 19m	-0.56%		
11.15.2016 00:49	11.15.2016 10:33	EURJPY	Buy	0.10	114.381	116.631	116.33300	116.63100	29.8	27.61	9h 44m	0.28%		
11.15.2016 08:00	11.15.2016 09:14	USDCAD	Sell	0.10	1.37219	1.35219	1.35468	1.35219	24.9	18.41	1h 14m	0.19%		
11.15.2016 09:19	11.15.2016 10:40	GBPUSD	Sell	0.10	1.26924	1.24624	1.24924	1.24624	30.0	30.00	1h 21m	0.30%		
11.15.2016 11:37	11.15.2016 16:05	USDJPY	Sell	0.10	108.830	107.930	108.22700	108.83000	-60.3	-55.41	4h 28m	-0.56%		
11.15.2016 21:58	11.16.2016 09:45	AUDUSD	Sell	0.10	0.76644	0.75194	0.75494	0.75194	30.0	29.64	11h 47m	0.30%		
11.16.2016 00:18	11.16.2016 05:00	EURJPY	Buy	0.10	115.076	117.326	117.02300	117.32600	30.3	27.79	4h 42m	0.28%		
11.16.2016 00:18	11.16.2016 09:29	USDJPY	Buy	0.10	108.532	109.432	109.12800	109.43200	30.4	27.78	9h 11m	0.28%		
11.16.2016 05:00	11.16.2016 09:42	AUDUSD	Sell	0.10	0.77756	0.75206	0.75660	0.75206	45.4	45.40	4h 42m	0.46%		
11.16.2016 18:48	11.17.2016 06:00	AUDUSD	Sell	0.10	0.76000	0.74550	0.74852	0.74744	10.8	9.72	11h 12m	0.10%		
11.16.2016 21:37	11.17.2016 03:06	USDJPY	Buy	0.10	108.577	109.477	109.17600	108.57700	-59.9	-55.48	5h 29m	-0.56%		
11.17.2016 00:50	11.17.2016 17:00	USDCAD	Buy	0.10	1.32595	1.34595	1.34345	1.34209	-13.6	-10.13	16h 10m	-0.10%		
11.17.2016 07:06	11.17.2016 15:47	USDJPY	Sell	0.10	109.632	108.732	109.03200	109.63200	-60.0	-54.73	8h 41m	-0.55%		
11.17.2016 08:14	11.17.2016 15:47	AUDUSD	Sell	0.10	0.75962	0.74512	0.74812	0.74512	30.0	30.00	7h 33m	0.30%		
11.17.2016 09:37	11.17.2016 17:00	GBPUSD	Sell	0.10	1.26363	1.24063	1.24363	1.24467	-10.4	-10.40	7h 23m	-0.11%		

Previous 1 2 3 4 Next

Trading Activity		Open Trades (2)	Open Orders (0)	History (80)	Exposure	More ▾								
Open Date ▲	Close date	Symbol	Action	Lots	SL(Price)	TP(Price)	Open Price	Close Price	Pips	Net Profit	Duration	Gain		
11.21.2016 18:37	11.22.2016 05:41	USDCAD	Sell	0.10	1.35979	1.33979	1.34228	1.33979	24.9	18.27	11h 4m	0.19%		
11.21.2016 18:39	11.22.2016 02:26	AUDUSD	Buy	0.10	0.72402	0.73852	0.73549	0.73852	30.3	30.32	7h 47m	0.31%		
11.21.2016 21:58	11.21.2016 23:15	USDJPY	Buy	0.10	110.536	111.436	111.13600	110.53600	-60.0	-54.28	1h 17m	-0.55%		
11.22.2016 08:00	11.22.2016 09:13	AUDUSD	Sell	0.10	0.75830	0.73740	0.74011	0.73740	27.1	27.10	1h 13m	0.27%		
11.22.2016 08:02	11.22.2016 11:01	USDCAD	Sell	0.10	1.35831	1.33831	1.34083	1.33831	25.2	18.83	2h 59m	0.19%		
11.22.2016 08:31	11.22.2016 17:00	AUDUSD	Buy	0.10	0.72769	0.74219	0.73919	0.73975	5.6	5.60	8h 29m	0.06%		
11.22.2016 08:34	11.22.2016 11:27	USDJPY	Sell	0.10	111.501	110.601	110.90200	110.60100	30.1	27.21	2h 53m	0.27%		
11.22.2016 11:30	11.22.2016 17:21	AUDUSD	Sell	0.10	0.75899	0.73809	0.74078	0.73809	26.9	26.90	5h 51m	0.27%		
11.22.2016 12:51	11.22.2016 17:00	USDCAD	Sell	0.10	1.35681	1.33681	1.33931	1.33924	0.7	0.52	4h 9m	0.01%		
11.22.2016 18:38	11.23.2016 15:06	USDJPY	Buy	0.10	110.411	111.311	111.00900	111.31100	30.2	27.03	20h 28m	0.27%		
11.22.2016 21:36	11.23.2016 06:00	AUDUSD	Sell	0.10	0.75104	0.73654	0.73954	0.74207	-25.3	-25.66	8h 24m	-0.26%		
11.23.2016 00:25	11.23.2016 15:27	USDCAD	Buy	0.10	1.32646	1.34646	1.34396	1.34646	25.0	18.57	15h 2m	0.19%		
11.23.2016 00:53	11.23.2016 10:35	GBPUSD	Sell	0.10	1.26212	1.23912	1.24212	1.23912	30.0	30.00	9h 42m	0.30%		
11.23.2016 01:48	11.23.2016 12:00	EURJPY	Buy	0.10	116.048	118.298	118.00500	117.78400	-22.1	-19.91	10h 12m	-0.20%		
11.23.2016 04:00	11.23.2016 15:35	AUDUSD	Sell	0.10	0.76314	0.73764	0.74215	0.73890	32.5	32.50	11h 35m	0.32%		

## EasyLTP 2016 年 11 月度 月次レポート

11.23.2016 14:53	11.23.2016 15:31	GBPUSD	Sell	0.10	1.26159	1.23859	1.24159	1.23859	30.0	30.00	38m	0.30%
11.23.2016 18:55	11.24.2016 00:54	USDCAD	Buy	0.10	1.32995	1.34995	1.34742	1.34995	25.3	17.92	5h 59m	0.18%
11.24.2016 00:11	11.24.2016 08:19	EURJPY	Buy	0.10	116.692	118.942	118.63600	118.94200	30.6	27.14	8h 8m	0.27%
11.24.2016 00:11	11.24.2016 01:33	USDJPY	Buy	0.10	111.816	112.716	112.41500	112.71600	30.1	26.70	1h 22m	0.27%
11.24.2016 00:18	11.24.2016 12:41	GBPUSD	Buy	0.10	1.22310	1.24610	1.24310	1.24610	30.0	30.00	12h 23m	0.29%

Previous 1 2 3 4 Next

Trading Activity		Open Trades (2)	Open Orders (0)	History (80)	Exposure								More
Open Date	Close date	Symbol	Action	Lots	SL(Price)	TP(Price)	Open Price	Close Price	Pips	Net Profit	Duration	Gain	
11.24.2016 07:01	11.24.2016 09:32	USDJPY	Buy	0.10	112.110	113.010	112.71200	113.01000	29.8	26.37	2h 31m	0.26%	
11.24.2016 08:34	11.24.2016 17:00	USDCAD	Buy	0.10	1.33363	1.35363	1.35116	1.34912	-20.4	-15.12	8h 25m	-0.15%	
11.24.2016 09:50	11.24.2016 11:54	AUDUSD	Buy	0.10	0.72555	0.74005	0.73704	0.74005	30.1	30.10	2h 4m	0.30%	
11.24.2016 10:35	11.24.2016 12:46	EURGBP	Sell	0.10	0.85962	0.84712	0.84862	0.84712	15.0	18.71	2h 11m	0.18%	
11.24.2016 11:15	11.24.2016 17:00	USDJPY	Buy	0.10	112.483	113.383	113.08000	113.13100	5.1	4.51	5h 44m	0.04%	
11.28.2016 04:00	11.29.2016 11:53	EURJPY	Buy	0.10	116.884	119.774	118.96300	119.29600	33.3	29.15	1d	0.29%	
11.28.2016 12:00	11.28.2016 12:00	GBPUSD	Sell	0.10	1.26144	1.23944	1.24382	1.24381	0.1	0.10	17s	0.00%	
11.28.2016 18:11	11.28.2016 19:02	USDJPY	Buy	0.10	111.522	112.422	112.12100	112.42200	30.1	26.77	51m	0.26%	
11.28.2016 23:45	11.29.2016 09:29	EURGBP	Sell	0.10	0.86620	0.85370	0.85520	0.85370	15.0	18.44	9h 44m	0.18%	
11.29.2016 02:13	11.29.2016 17:00	USDCAD	Sell	0.10	1.35839	1.33839	1.34089	1.34561	-47.2	-35.08	14h 47m	-0.34%	
11.29.2016 08:00	11.29.2016 17:00	GBPUSD	Sell	0.10	1.26043	1.23743	1.24045	1.24965	-92.0	-92.00	8h 59m	-0.90%	
11.29.2016 08:41	11.29.2016 11:11	USDJPY	Sell	0.10	112.691	111.791	112.09200	112.69100	-59.9	-53.15	2h 30m	-0.52%	
11.29.2016 21:00	11.30.2016 05:19	USDJPY	Buy	0.10	111.795	112.695	112.39900	112.69500	29.6	26.25	8h 19m	0.26%	
11.29.2016 22:00	11.30.2016 06:18	EURJPY	Buy	0.10	117.641	119.891	119.59300	119.89100	29.8	25.99	8h 18m	0.26%	
11.30.2016 00:04	11.30.2016 06:00	AUDUSD	Buy	0.10	0.73680	0.75130	0.74830	0.74715	-11.5	-11.50	5h 55m	-0.11%	
11.30.2016 00:53	11.30.2016 17:00	GBPUSD	Buy	0.10	1.22893	1.25193	1.24895	1.24479	-41.6	-41.60	16h 6m	-0.41%	
11.30.2016 02:07	11.30.2016 17:00	USDCAD	Buy	0.10	1.32530	1.34530	1.34280	1.34076	-20.4	-15.22	14h 52m	-0.15%	
11.30.2016 08:06	11.30.2016 14:17	USDJPY	Sell	0.10	113.454	112.554	112.85300	113.45400	-60.1	-52.97	6h 11m	-0.52%	
11.30.2016 08:44	11.30.2016 14:13	AUDUSD	Sell	0.10	0.75939	0.74489	0.74789	0.74489	30.0	30.00	5h 29m	0.30%	
11.30.2016 21:20	11.30.2016 22:57	USDJPY	Buy	0.10	113.488	114.388	114.08000	114.38800	30.8	26.93	1h 37m	0.27%	

Previous 1 2 3 4 Next

## 【分析】

2016 年 11 月 01 日 ~ 11 月 30 日のトレード数は80回、勝率は買いトレードが38トレード27勝で71%。

売りトレードは42トレード25勝で59%となりました。またPFは1.01となっています。

平均ポジション保有時間は8時間19分となっています。

トレード戦略別の成績では、[EasyLTP01](#)、[EasyLTP05](#)、[EasyLTP09](#)、[EasyLTP11](#) が成績良好となっています。

11月度に関しては、0.11% とわずかながらではありますが、プラスとなりました。

わずかでも、これで10月・11月と2カ月連続でプラスとなっていることは良い傾向です。

12月は年末相場で、EA運用の観点からは毎年厳しい1か月になることが多い月ですが、少しでもプラスになることを

祈りつゝ引き続き中長期的観点から運用を見守ってきたいと思います。