

# シストレ検証まとめ(ドル円 & MAクロスorドンチャン)

## 1990~2007の18年間から言える事

1. 長期システムの方が、1取引の内容は優れる傾向
2. 中期システムの方が、パフォーマンス向上目指すならよい傾向
3. 短期システムは、裁量や優れたフィルターを入れなければ、破綻するリスクが高い
4. 単純なシステム取引では、総じて年間+100%を超えるようなパフォーマンスは望めない。+50%を超えれば例外的に高く、+10~30%程度が常識的な目標利回り。
5. ドル円のボラティリティーは、平均8~9%である。

### 結論

1. 短期投資で成功するには、裁量や様々なフィルターを考慮する必要あり。
2. より簡単な方法は、年間8~9%の為替変動を考慮した、長期的なスワップ金利狙いの投資。

## 各通貨まとめ

### MA代表的変数、Entry翌日始値

MA変数	過去18年	直近円安	まとめ
ドル円	25 (変数)	25	全般、25日線で最も良いパフォーマンス。ただし、利回り自体は高くない。
豪ドル円	75	5	直近の円安相場&短期変数で高いパフォーマンス。ただし、長期的には短期変数は大きなドロウダウンのリスク。
NZドル円	75	25	豪ドル同様、円安相場では短期的に取るほうが高いパフォーマンス。ただし、長期的には短期変数は破綻リスク高い。
ポンド円	5	25	全般、短期的な値動きを取ることで高いパフォーマンス。MAとの相性は4通貨ペアの中で最も良い。

ドル

ドル円MA代表的変数  
Entry翌日始値、(1990~2007)

MA変数	利回り	PF	最大DL	勝率
5	破綻	-	-	-
25	50%	1.1	50.6%	23.0%
75	10%	1.1	23.2%	22.9%
200	▼6%	0.8	13.6%	12.3%

ドル

ドル円MA代表的変数  
Entry翌日始値、(2004~2007)

MA変数	利回り	PF	最大DL	勝率
5	▼34%	0.9	78.2	33.1
25	14%	1.3	19.7%	36.0%
75	▼9%	0.6	10.1%	26.3%
200	▼4%	0.6	7.6%	21.4%

NZドル

NZドル円MA代表的変数  
Entry翌日始値、(1990~2007)

MA変数	利回り	PF	最大DL	勝率
5	破綻	-	-	-
25	▼12%	0.9	61.4%	28.8%
75	23%	1.2	37.8%	23.4%
200	18%	1.7	8.3%	23.6%

## NZドル円MA代表的変数 Entry翌日始値、(2001~2007/7)

MA変数	利回り	PF	最大DL	勝率
5	▼7%	1.0	60.9	36.9
25	55%	1.4	27.5%	30.5%
75	48%	2.6	10.2%	25.6%
200	15%	2.8	3.1%	27.3%

# ポンド

## ポンド円MA代表的変数 Entry翌日始値、(1990~2007)

MA変数	利回り	PF	最大DL	勝率
5	513%	1.1	75.4	36.6%
25	121%	1.3	37.4%	29.8%
75	49%	1.5	17.7%	24.4%
200	12%	1.3	9.4%	16.2%

# ポンド

## ポンド円MA代表的変数 Entry翌日始値、(2001~2007/7)

MA変数	利回り	PF	最大DL	勝率
5	1%	1.0	75.1	36.1%
25	64%	1.7	22.3%	38.3%
75	25%	1.8	15.0%	26.5%
200	6%	1.4	9.2%	12.5%



# 豪ドル

## 豪ドル円MA代表的変数 Entry翌日始値、(1990~2007)

MA変数	利回り	PF	最大DL	勝率
5	▼88%	0.7	97.8	34.7%
25	▼27%	0.9	55.5%	24.9%
75	12%	1.1	36.1%	23.2%
200	▼6%	0.8	20.5%	12.9%

# 豪ドル

## 豪ドル円MA代表的変数 Entry翌日始値、(2002~2007)

MA変数	利回り	PF	最大DL	勝率
5	399%	1.3	54.6%	41.3%
25	32%	1.3	18.4%	34.2%
75	36%	2.3	5.6%	33.3%
200	▼13%	2.1	4.0%	17.4%

# 豪ドル

## 豪ドル円MA代表的変数

Entry翌日始値、(2002~2007)、リスク2倍

MA変数	利回り	PF	最大DL	勝率
5	262%	1.1	79.2%	41.3%
25	57%	1.3	34.3%	34.2%
75	74%	2.1	11.1%	33.3%
200	27%	2.0	8.1%	17.4%

ドル円MA翌日始値Entry(1990~2007)  
代表的変数

MA変数	利回り	PF	最大DL	勝率
5	破綻	-	-	-
25	259%	1.1	74.4%	23.8%
75	250%	1.2	59.1%	14.3%
200	▼14%	0.9	39.4%	14.4%

## ドル円MA単純(1990~2007)

### 代表的変数

MA変数	利回り	PF	最大DL	勝率
5	破綻	-	-	-
25	405%	1.1	74.2%	15.7%
75	135%	1.1	67.2%	10.3%
200	▼21%	0.9	43.6%	8.6%

## ドル円MAクロス(1990~2007)

短期1~35、長期1~350で可変

短期 - 長期	利回り	PF	最大DL	勝率
7-63	565%	1.4	39.8%	39.8%
8-27	672%	1.4	26.6%	41.1%
15-21	1089%	1.6	35.7%	44.9%
25-324	343%	11.7	8.4%	69.2%

## ドンチャン・チャネル・ブレイクアウト ドル円・MAフィルター2(1990~2007)

	フィルター 1~350	利回り	PF	最大DL	勝率
Entry20 Exit10	あり (MA~28)	268%	1.5	21.3%	39.6%
Entry20 Exit10	あり (MA350-25 のクロス)	184%	1.9	16.1%	42.4%
Entry20 Exit10	なし (テクニカル)	268%	1.5	21.3%	39.6%
Entry12 Exit8	あり (MA16)	861%	1.5	19.0%	44.7%
Entry12 Exit8	なし	820%	1.5	19.0%	44.5%

ドンチャン・チャネル・ブレイクアウト  
ドル円・MAフィルター(1990~2007)

	フィルター 350/25	利回り	PF	最大DL	勝率
Entry20 Exit10	あり (ボラ*2)	182%	1.5	25.6%	51.7%
Entry20 Exit10	なし (ボラ*2)	278%	1.3	29.8%	47.8%
Entry20 Exit10	あり (テクニカル)	184%	1.9	16.1%	42.4%
Entry20 Exit10	なし (テクニカル)	268%	1.5	21.3%	39.6%



ドンチャン・チャネル・ブレイクアウト  
ドル円・exitルール(1990~2007)

	Exit rule	利回り	PF	最大DL	勝率
Entry20 Exit10	テクニカル	268%	1.5	21.3%	39.6%
Entry20 Exit10	ボラ*2	278%	1.3	29.8%	47.8%
Entry20 Exit10	ボラ*1	824%	1.2	59.0%	33.8%
Entry20 Exit10	標準偏差 *1	341%	1.1	79.9%	28.6%

ドンチャン・チャネル・ブレイクアウト  
ドル円・最適化(1990~2007)

	利回り	PF	最大DL	勝率
Entry12 Exit8	229%	1.7	9.9%	44.5%
Entry4 Exit2	403%	1.2	34.2%	39.5%
Entry20 Exit10	101%	1.6	10.7%	39.6%

ドンチャン・チャネル・ブレイクアウト  
ドル円・リスク変化(1990~2007)

	リスク	利回り	PF	最大DL	勝率
Entry12 Exit8	4%	820%	1.5	19.0%	44.5%
Entry12 Exit8	2%	229%	1.7	9.9%	44.5%
Entry20 Exit10	4%	268%	1.5	21.3%	39.6%
Entry20 Exit10	2%	101%	1.6	10.7%	39.6%

## ドンチャン・チャネル・ブレイクアウト

entry60日 exit30日(1990~2007)

	利回り	PF	最大DL	勝率
ドル円	33%	1.7	9.3%	38.7%
ポンド円	6%	1.1	19.5%	37.1%
豪ドル円	5%	1.1	10.3%	33.9%

## ドンチャン・チャネル・ブレイクアウト

entry20日 exit10日(1990~2007)

	利回り	PF	最大DL	勝率
ドル円	101%	1.6	10.7%	39.6%
ポンド円	36%	1.2	22.9%	42.4%
豪ドル円	25%	1.2	14.8%	36.5%

ドル円ボラティリティー  
(2002~2007)

	HV	IV	ATR
平均	8.56%	9.08%	1.09
最大	15.86%	17.82%	4.74
最低	3.14%	5.85%	0.14