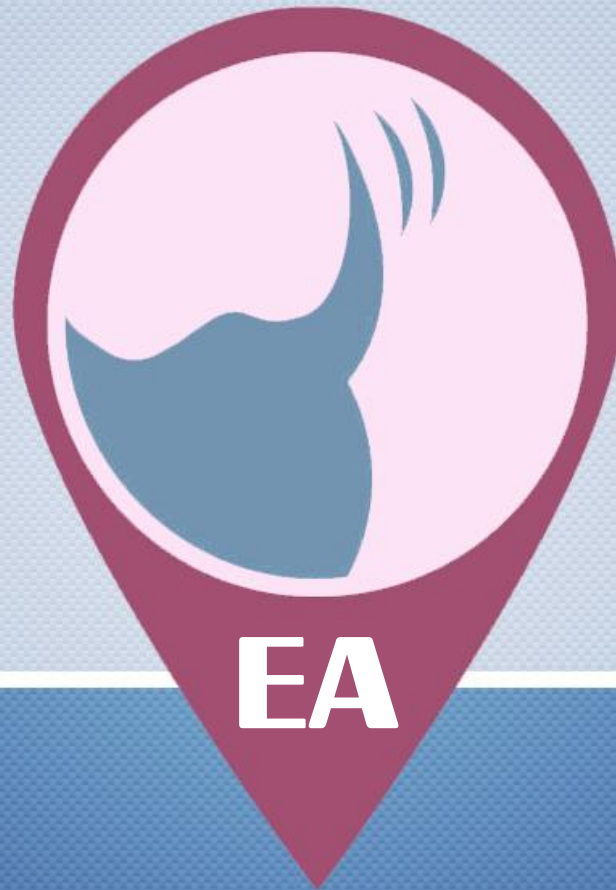


【개미FX】 자동매매 프로그램



10년치 백테스트 결과 분석 데이터

개꼬리 EA (Dog Tail) 개요



- 테스트 기간 : 2010년 1월1일 - 2019년 11월 5일
- 투자원금 : 10,000 달러
- 적용 차트 : 달러-엔 (USD-JPY) 15분 봉
- 순수익 : 5,3134.42 달러
- 최대 손실폭 : 36.24% (MDD)
- 연 수익률 : 54.02%

TOTAL PROFIT

\$ 53134.42

PROFIT IN PIPS 6499.1 PIPS
 YEARLY AVG PROFIT \$ 5402.05
 YEARLY AVG % RETURN 54.02 %
 CAGR 20.23 %

# OF TRADES	SHARPE RATIO	PROFIT FACTOR	RETURN / DD RATIO	WINNING PERCENTAGE
1643	0.06	1.24	6.27	12.54 %
DRAWDOWN	% DRAWDOWN	DAILY AVG PROFIT	MONTHLY AVG PROFIT	AVERAGE TRADE
\$ 8480.23	36.24 %	\$ 18.96	\$ 450.29	\$ 32.34
ANNUAL % / MAX DD %	R EXPECTANCY	R EXPECTANCY SCORE	STR QUALITY NUMBER	SQN SCORE
0.56	0.21 R	35.42 R	2.65	0.91

STATS

Strategy

Wins / Losses Ratio	0.14	Payout Ratio (Avg Win/Loss)	8.67	Average # of Bars in Trade	0
AHPR	0.14	Z-Score	-1.45	Z-Probability	92.65 %
Expectancy	32.34	Deviation	\$ 495.3	Exposure	0 %
Stagnation in Days	808	Stagnation in %	22.51 %		

Trades

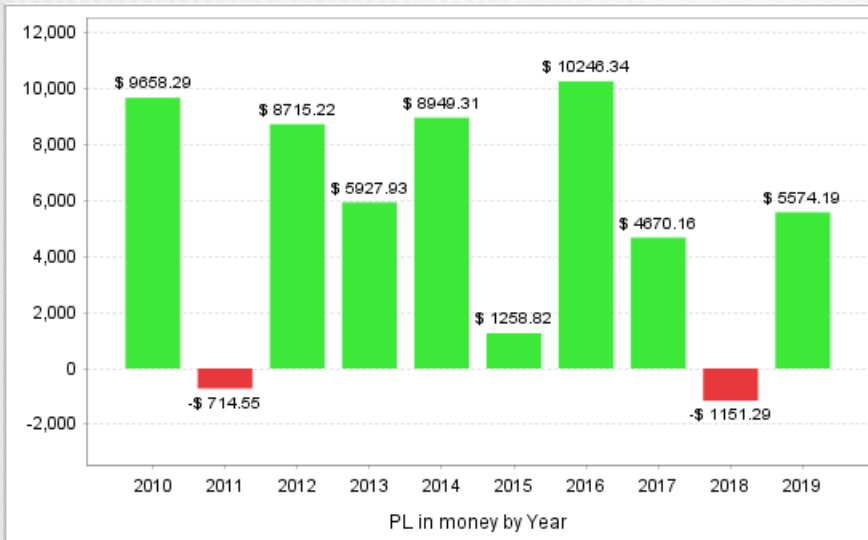
		# of Wins	206	# of Losses	1437	# of Cancelled/Expired	0
Gross Profit	\$ 272312.94	Gross Loss	\$ -219178.52	Average Win	\$ 1321.91	Average Loss	\$ -152.53
Largest Win	\$ 1825.77	Largest Loss	\$ -613.4	Max Consec Wins	3	Max Consec Losses	34
Avg Consec Wins	1.18	Avg Consec Loss	8.21	Avg # of Bars in Wins	0	Avg # of Bars in Losses	0

기본 로직과 연도별 실적



대부분의 수동거래 트레이더들이 장기적인 수익창출에 실패하고 외환시장에서 퇴출당하는 이유는, 적절한 타이밍에 손절매를 하지 못하기 때문이다. 개꼬리 EA는 이러한 고질적인 문제점을 극복하기 위해, 시세 반전을 암시하는 '꼬리형 캔들'이 출현했을 때만 진입하는 로직을 아래와 같은 보조지표와 함께 구현했다. 이로써 손실은 최소화, 수익은 극대화 시키는 '대탐소실' 기법을 실현.

- ◉ RSI, 볼린저밴드, 피벗 (Pivot), 수평선 (전저점 및 전고점) 중, 복수의 조건 충족시 진입.
- ◉ 손절매는 시세가 꼬리보다 5pip-10pip 하락 또는 상승 시 발동. 익절매는 손절폭의 10배-30배 범위.



Period	Net Profit	Profit Factor	# of trades	% Wins
All	\$ 53134.42	1.24	1643	12.54 %
2019	\$ 5574.19	1.56	98	13.27 %
2018	-\$ 1151.29	0.94	175	8.57 %
2017	\$ 4670.16	1.19	207	12.08 %
2016	\$ 10246.34	1.33	220	15.00 %
2015	\$ 1258.82	1.05	195	11.28 %
2014	\$ 8949.31	1.52	137	15.33 %
2013	\$ 5927.93	1.19	201	12.94 %
2012	\$ 8715.22	1.50	121	13.22 %
2011	-\$ 714.55	0.96	113	9.73 %
2010	\$ 9658.29	1.35	176	13.64 %

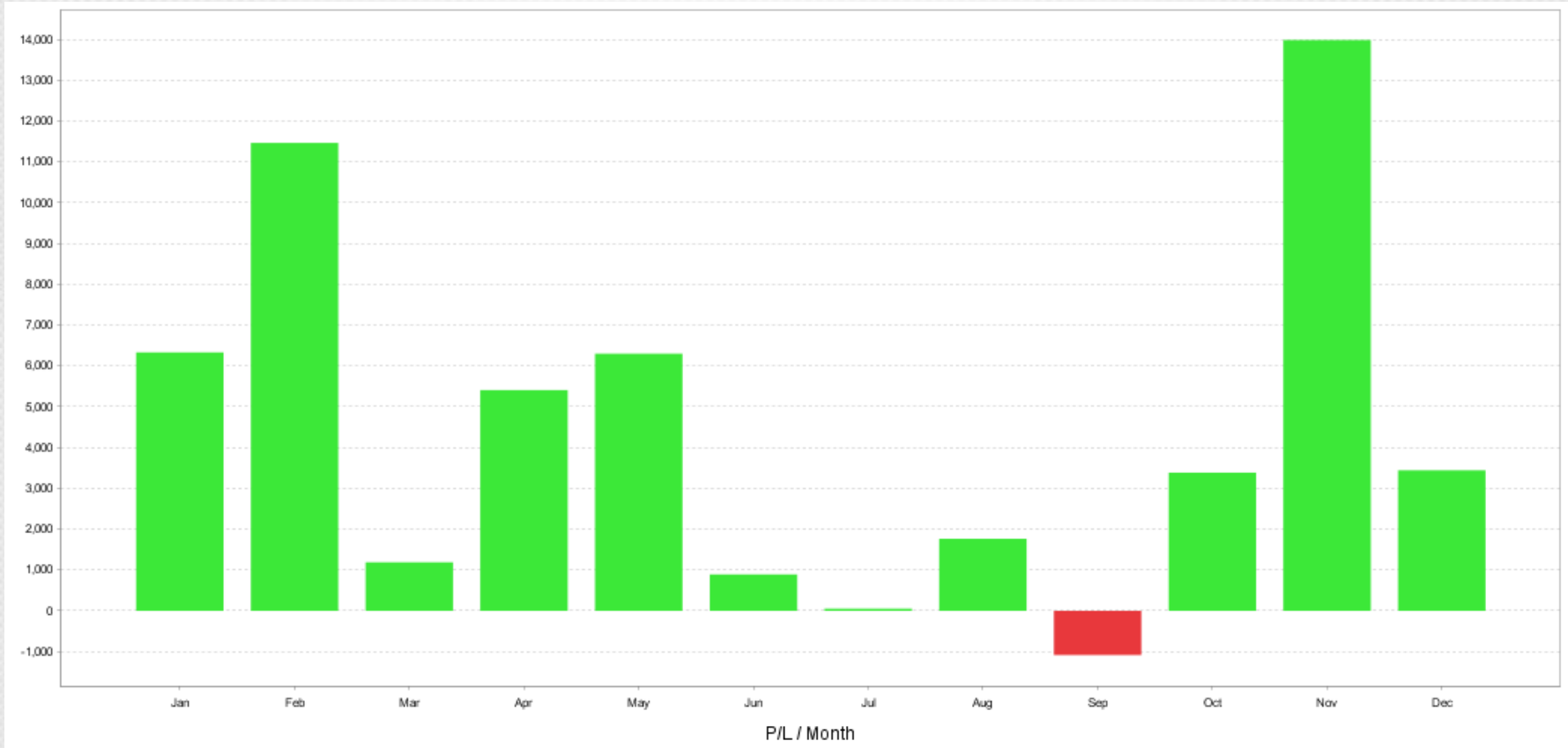
월별 수익 금액



◎ 1년 중 수익성이 가장 좋은 달은 11월과 2월.

(유동성이 부족한 연말연시를 지나, 시세가 가장 안정적으로 움직이는 경향 때문)

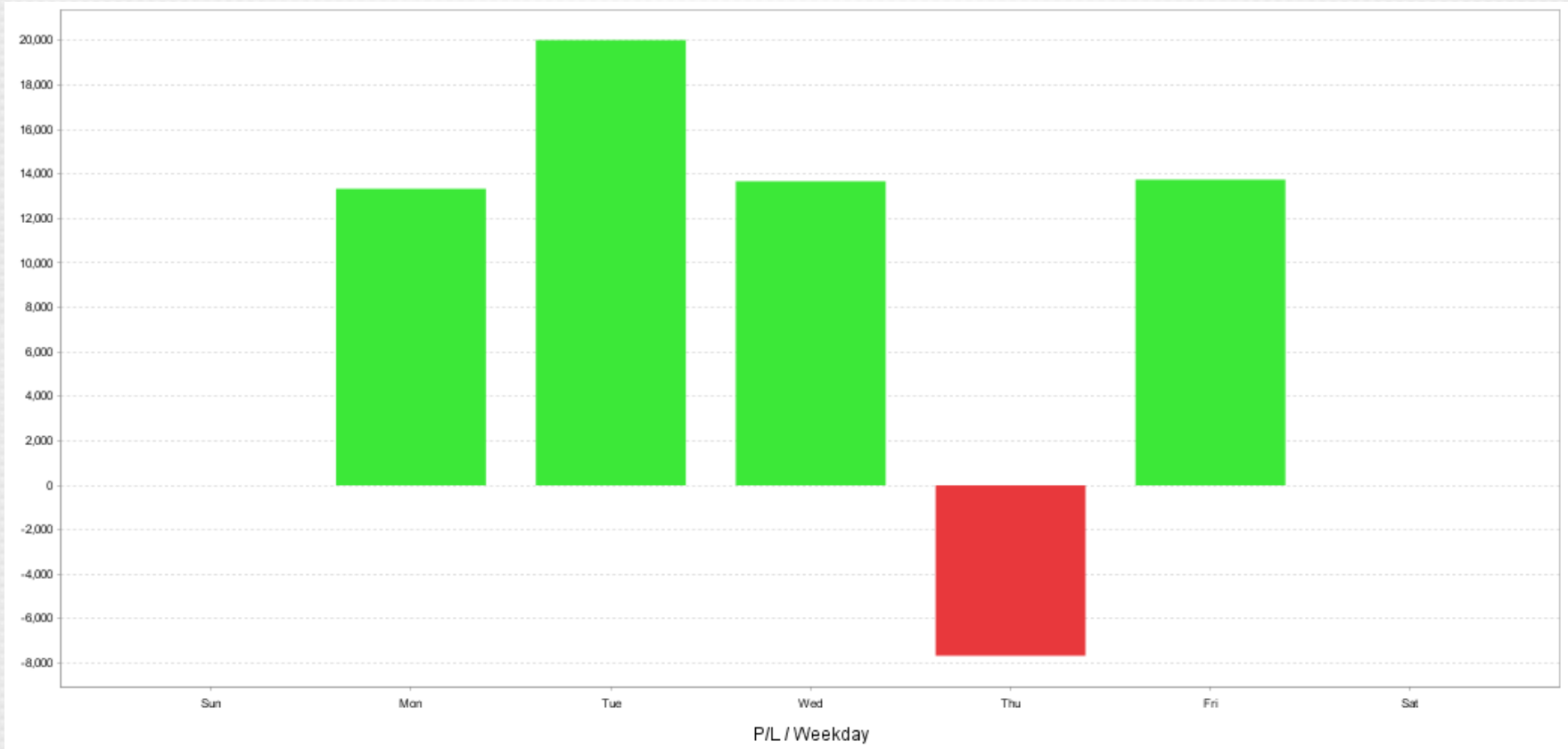
◎ 9월은 평균 손익이 -1,000달러로 유일하게 수익창출에 실패.



요일별 수익 금액



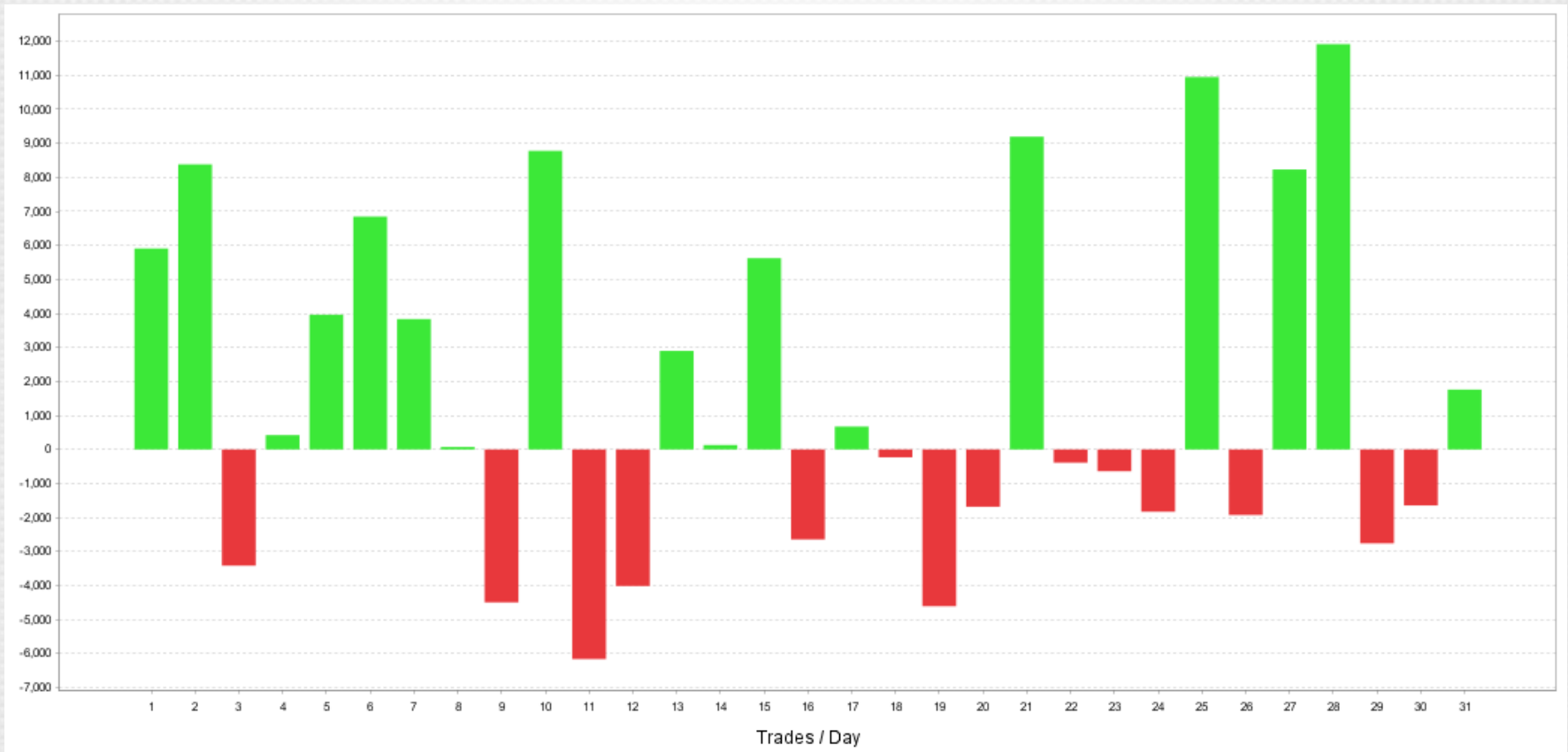
- 수익성이 가장 높은 요일은, 경제지표가 비교적 적게 발표되는 수요일.
- 목요일은 각국의 중앙은행이 금리를 발표하는 경우가 많은 탓에 수익창출 실패. 이러한 시기에는 보유 포지션을 청산하고 프로그램 일시정지 등의 대책 강구.



날짜별 수익 금액



- ◉ 월말에 가까워 질수록 수익률 향상.
- ◉ 손절을 당하지 않는 한 포지션을 며칠 동안 보유하는 탓에 무수익 구간 발생.
- ◉ 31일 중, 손실보다 수익이 많은 날은 총 17일.



시간대별 수익 금액



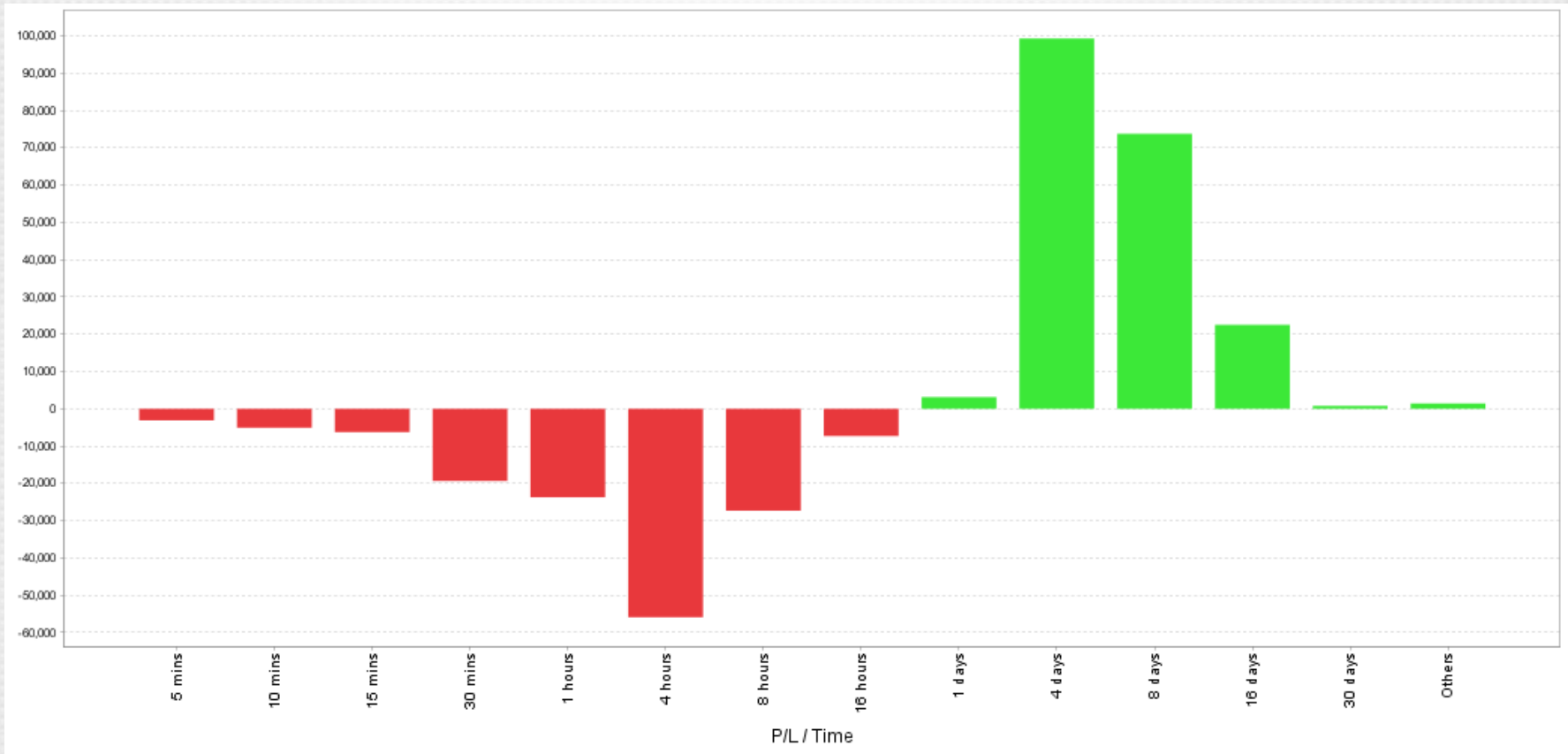
- ◎ 수익성이 가장 좋은 시간대는 MT4 서버시간 오전 4시. (한국시각 11시)
- ◎ 혼조세가 일어나기 쉬운 서버시간 오후 6시와 9시는 손실이 눈에 띄게 증가.
이러한 시기에는 보유 포지션을 청산하고 프로그램 일시정지 등의 대책 강구.



보유 시간별 수익 금액



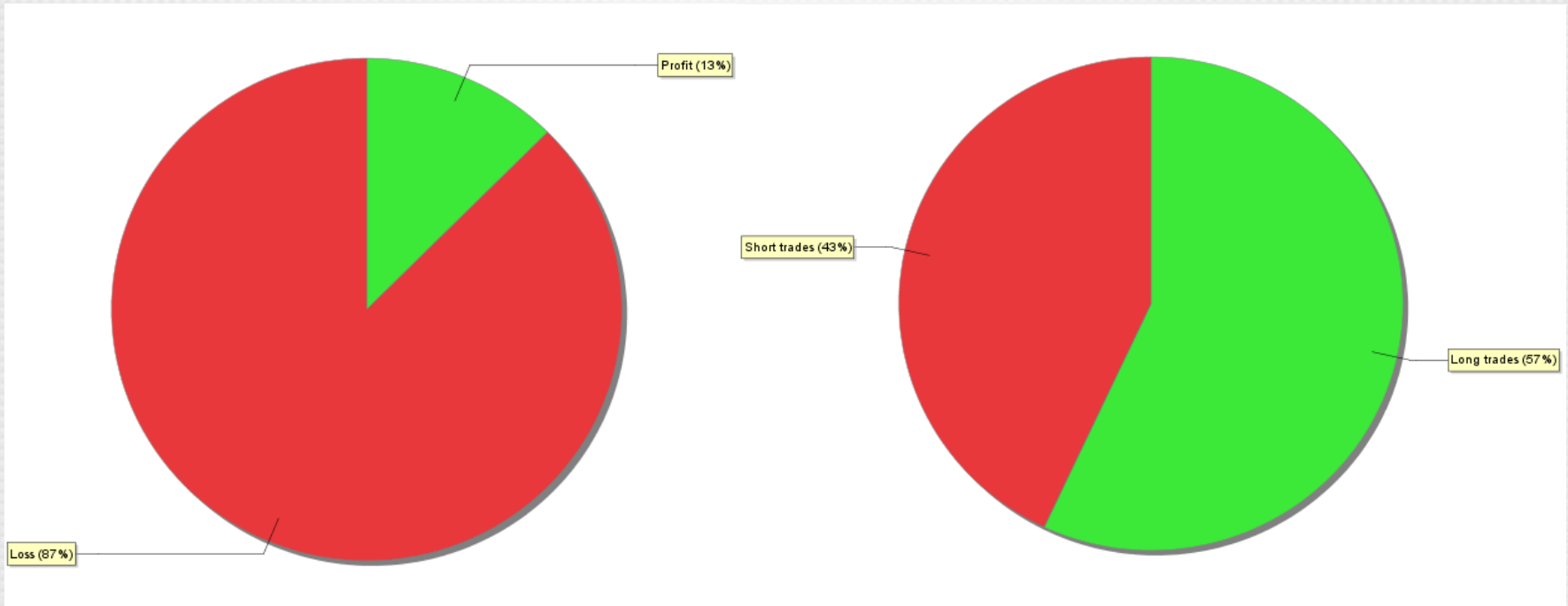
- 손실이 가장 많이 발생한 포지션 보유시간은 진입 후 4시간이 경과한 시점.
- 수익이 가장 많이 발생한 포지션 보유시간은 진입 후 4일-8일이 경과한 시점.
- 대부분 30분-8시간 사이에 손실이 청산되므로, '오버나잇 리스크' 대응 가능.



매수 매도 비율과 매매 승률



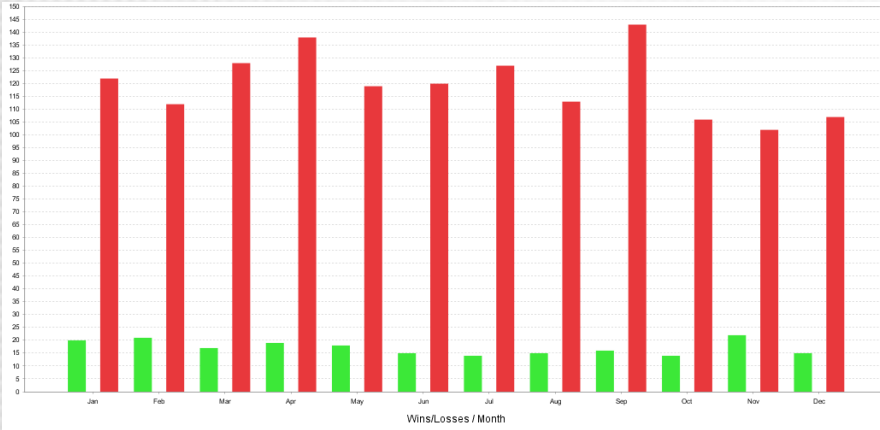
- ◉ '대탐소실' 기법을 구현한 탓에 총 매매승률은 13%수준.
- ◉ 손절폭이 크게 설정된 '소탐대실' 로직으로 만들어진 EA 중에는 승률이 90%를 넘는 EA도 많지만, 그러한 것들은 대부분 30만원 내외로 판매되는 비급 프로그램.
- ◉ 롱, 숏 진입 비율은 57대 43으로 롱 (매수) 포지션이 우세.



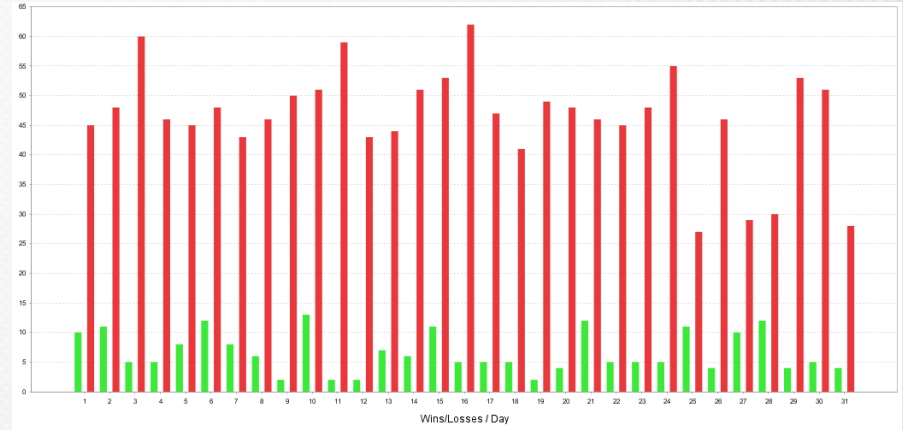
그 외 참고 데이터



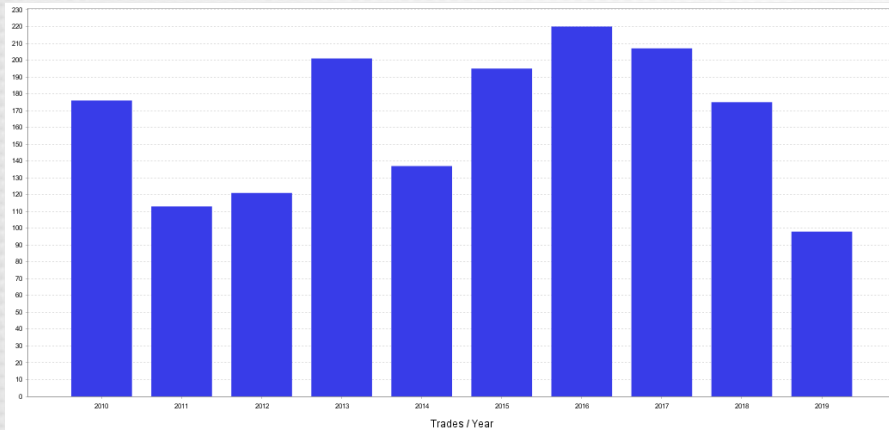
◎ 월별 손익금 비율



◎ 일별 손익금 비율



◎ 연도별 거래 횟수



◎ 일별 거래 횟수

