

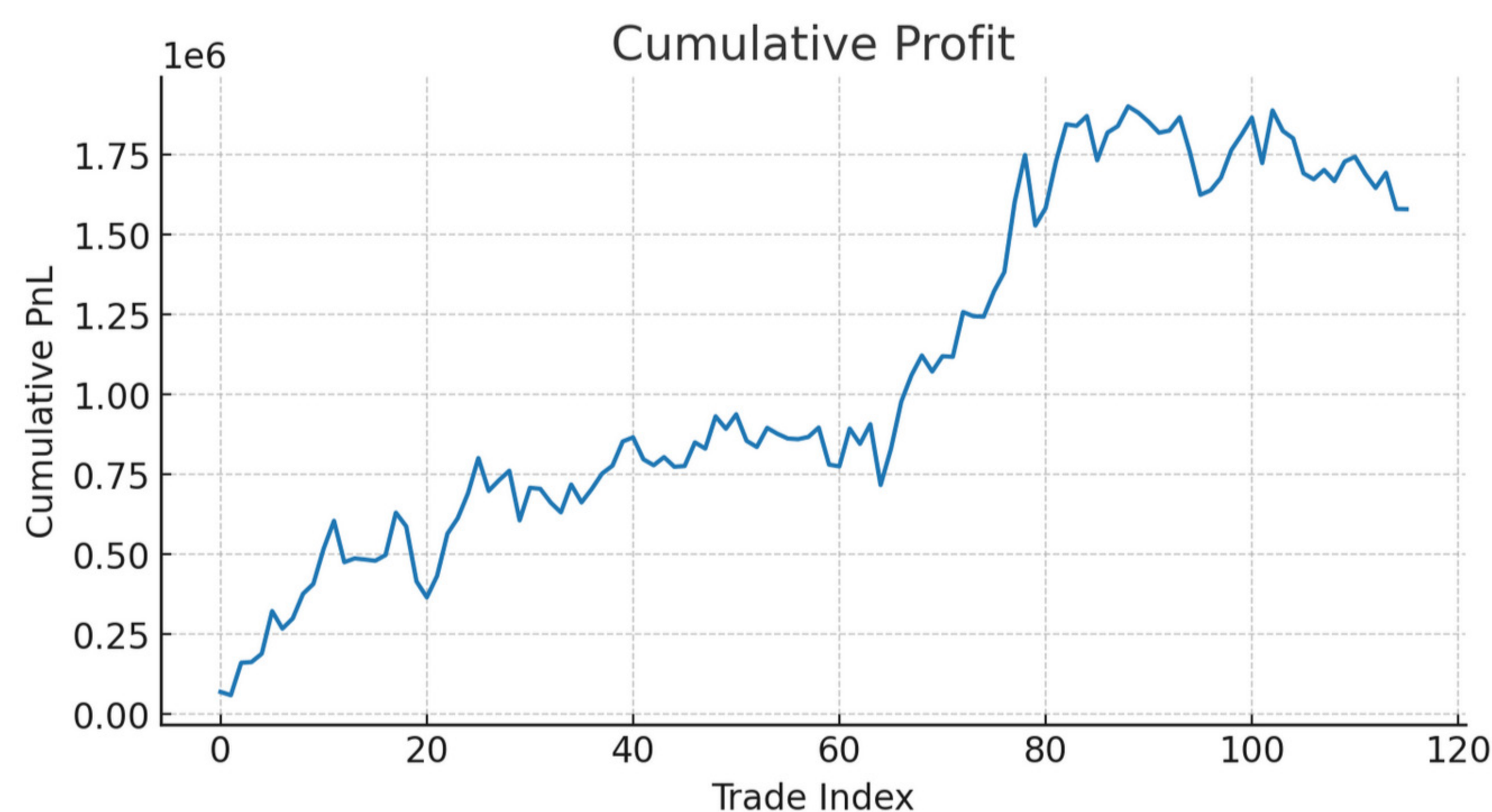
FX Auto-trade Report

Step 1: Statistical Summary

Trade Period: 2023-04-03 09:00:00 to 2023-09-29 22:59:59
Total Trades: 116
Total PnL (JPY): 1,580,400.00
Winning Trades (count): 66
Winning Trades PnL (JPY): 4,470,700.00
Losing Trades (count): 50
Losing Trades Loss (JPY): -2,890,300.00
Win Rate (%): 56.90
Profit Factor: 1.55
Avg Win / Avg Loss: 1.17
Avg PnL per Trade (JPY): 13,624.14
Avg Pips: 13.62
Max Drawdown (JPY): 321,600.00
Max Drawdown (%): -16.91

Step 2: Charts and Comments

Cumulative Profit



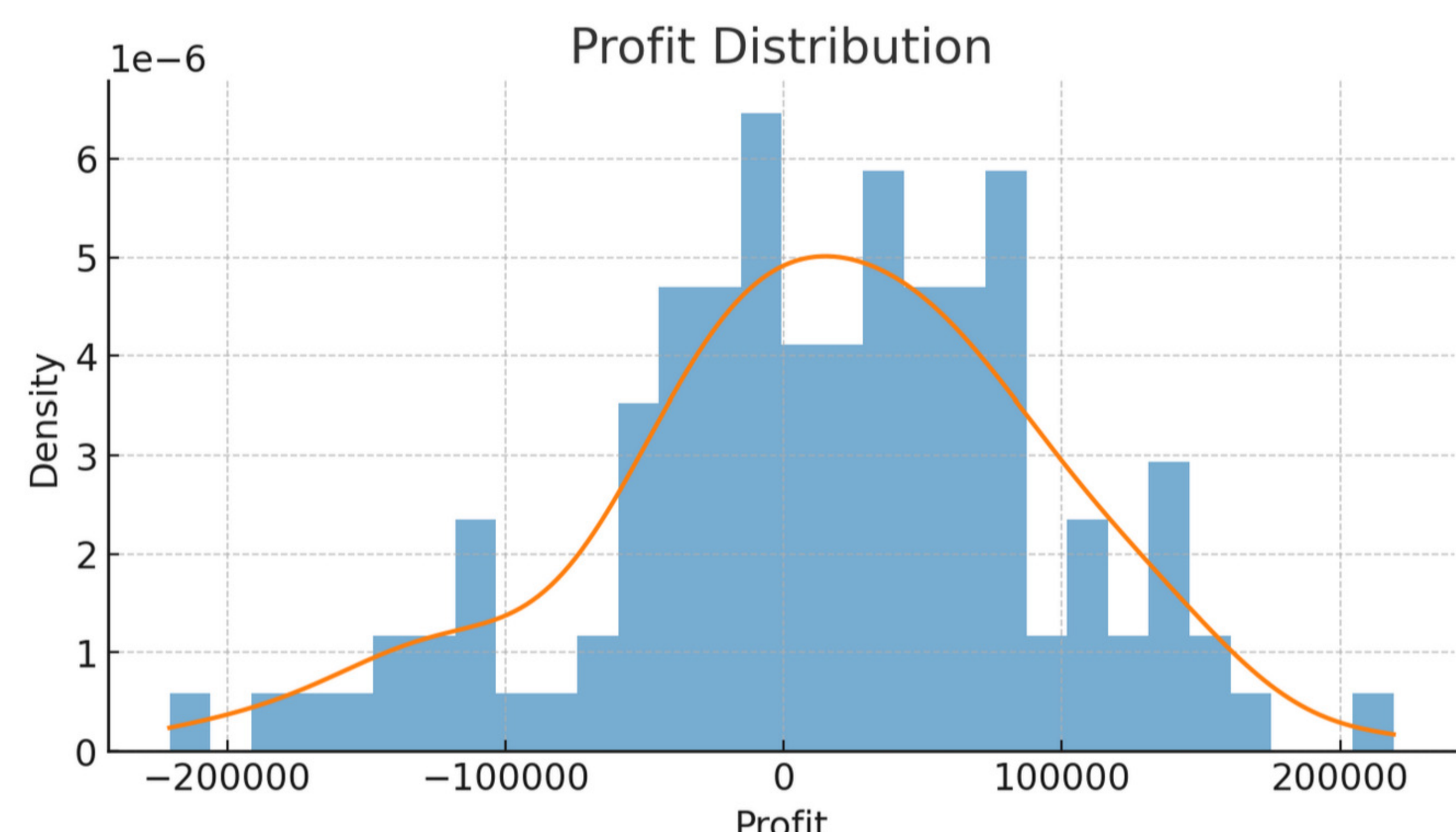
累積損益は時間経過でのパフォーマンスを示します。持続的な上昇は一貫性を示し、落ち込みは損失発生やドロードアウンを示します。

Trade-wise Profit



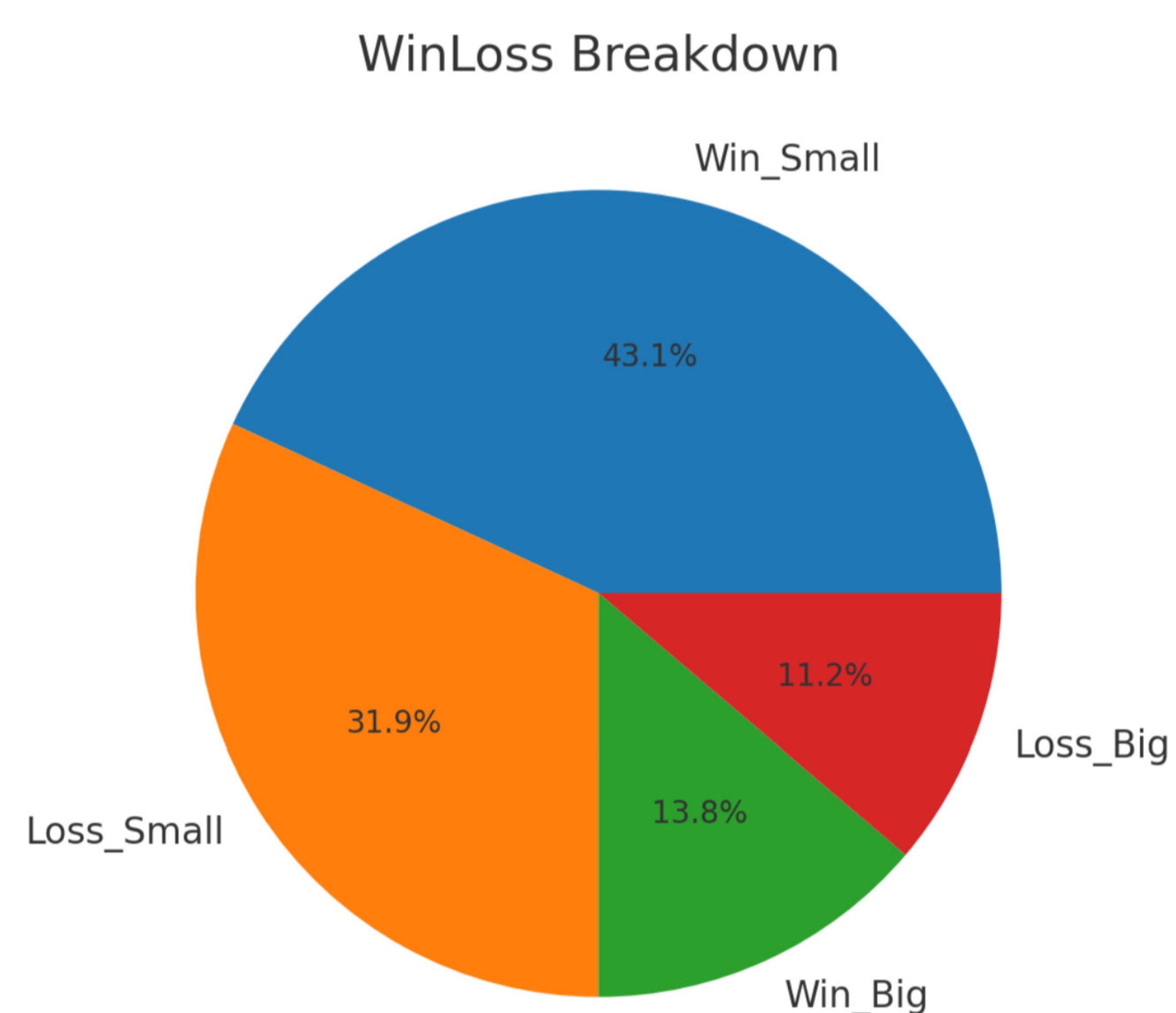
各トレードの損益を棒グラフで示しています。大きな損失や利得が散見される場合、リスク管理の見直しが必要です。

Profit Distribution



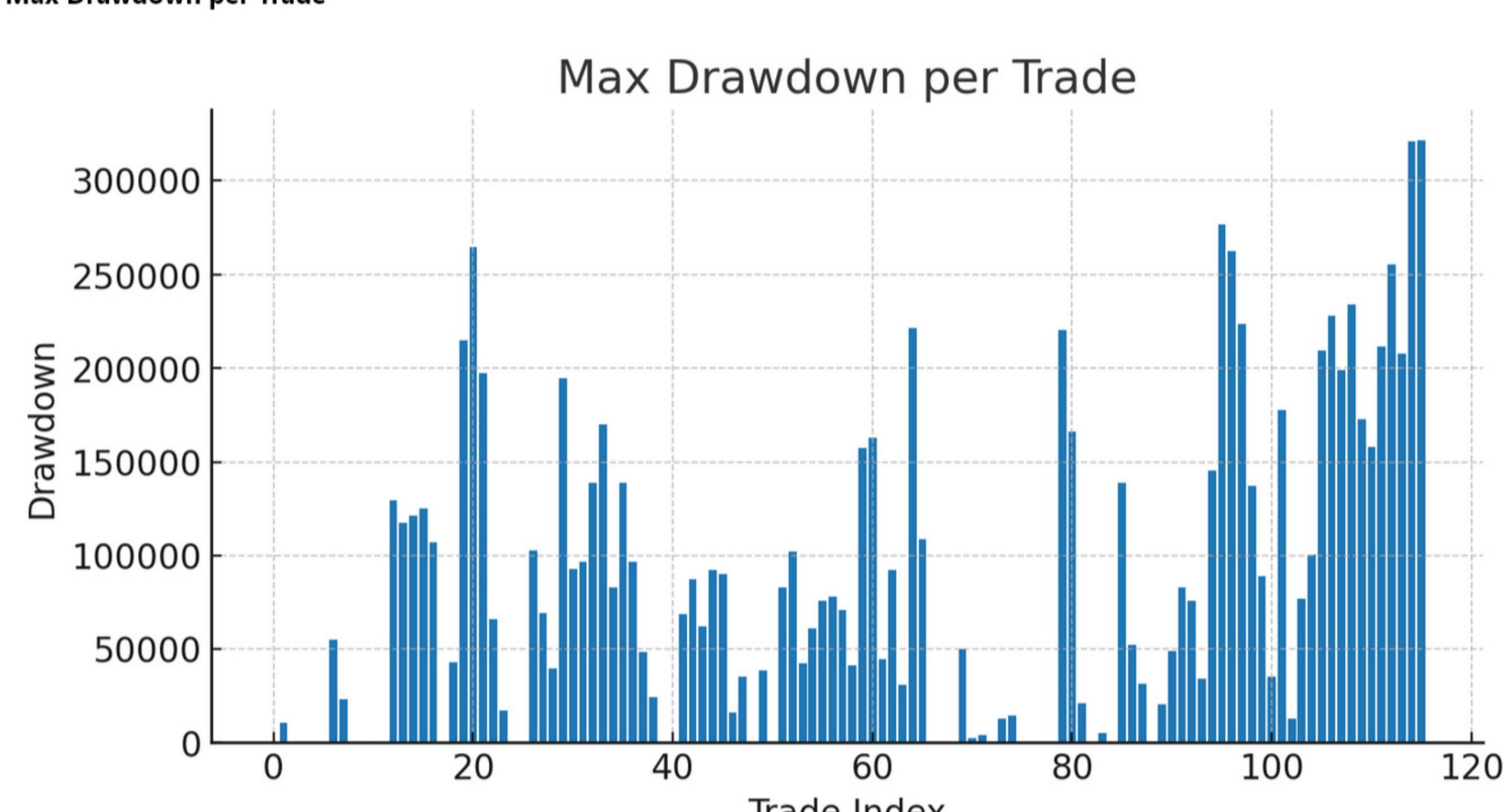
損益の分布を示します。偏りがある場合は戦略の偏向や外れ値の存在が示唆されます。

Win/Loss Breakdown



大勝・小勝・小負・大負の割合を示しています。上位25%を大勝/大負と定義しています。

Max Drawdown per Trade



各トレード時点でのドロードアウン（累積ピークからの下落幅）を示します。特に大きな山がある場合、そのトレードで回復が困難になった可能性があります。

Step 3: AIジャッジメント

勝率の安定性: B - 勝率の変動が中程度

ボラティリティ適応: A - 高ボラティリティ下でより良いパフォーマンス

リスク管理: A - 低ドロードアウン / 良好なプロフィットファクター / 一部はアウトライヤーによる寄与

総合評価: A

Step 4: 課題と改善提案

リスク管理

内容: ドロードアウンとPFは許容範囲内です。

改善提案: 現在のリスクルールを維持しつつ、ウォークフォワードテストによるさらなる最適化を検討してください。

ボラティリティ適応

内容: ボラティリティに対する顕著な負の感応度は見られない、またはデータ不足です。

改善提案: ATRを階層化した条件下での戦略検証や、ストレスシナリオのシミュレーションを検討してください。

安定性

内容: 勝率は概ね安定しているようです。

改善提案: 継続的なモニタリングを行い、定期的な再キャリブレーションの導入を検討してください。

備考

本レポートはFX自動売買分析アシスタントによって生成されました。欠損や計算できなかった項目は「-」で表示されています。日時解析には pandas.to_datetime(...)、errors="coerce" を使用しました。