

## ニュースフィルターについて (White Bear V1)

White Bear V1 は、重要経済指標時には稼動を停止させたほうが好成績に繋がること、これまでのバックテストから明らかになっています。そこで、パラメーターで指定した時間帯に EA を停止させる「News Filter」を搭載しました。デフォルト設定では、本機能は使用しない(false)になっていますので、適宜変更してご利用ください。

News		--- News Filter ---
①	use_NewsFilte	<b>true</b>
②	Day_Of_The_Week	Mon=1, Tue=2, Wed=3, Thu=4, Fri=5
	DayOfTheWeek	5
③	NewsTime GMT	(+9 in Japan)
	Hour_of_News	12
④	PreHour_of_News	2
⑤	PostHour_of_News	3

- ① ニュースフィルターを使用するかどうか true=使用する、false=使用しない
- ② 曜日の設定 1月曜日 2火曜日 3水曜日 4木曜日 5金曜日
- ③ 指標の時間帯 GMTで指定、例:GMT12 (GMT12時は日本時間21時)  
※日本時間は GMT+9時間になります。
- ④ EA 停止開始(指標前) 時間で設定 例:2 GMT12-2=GMT10
- ⑤ EA 停止終了(指標後) 時間で設定 例:3 GMT12+3=GMT15

※指標の時間帯から最大前後 12 時間まで設定できます。

★上記設定の場合、GMT10時からGMT15時まで(日本時間で金曜日19時から24時まで)停止します。ただし、White Bear V1のエントリー時間は、22時45分から8時45分なので、実際には22時45分から24時までの稼動を停止させるということになります。

※フィルターによって EA が停止しているかどうかについては、チャート左上のコメント欄でご確認いただけます。

### EA 稼働中



### EA 停止中

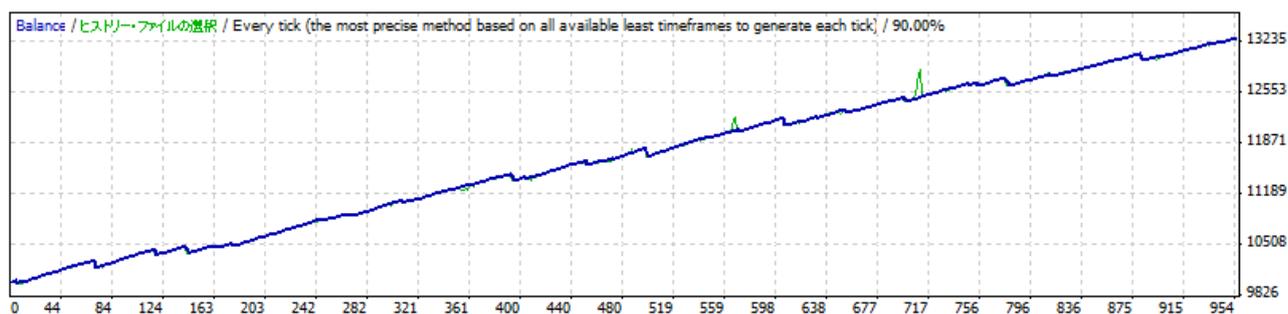


〈ニュースフィルターの効果〉 金曜日 21 時台には、毎月第一金曜日に米国雇用統計の発表など、重要指標が多いことから、この時間帯の EA の稼働を停止させた場合のバックテストを行いました。

### ★ニュースフィルター使用しない

News		--- News Filter ---
①	use_NewsFilte	false

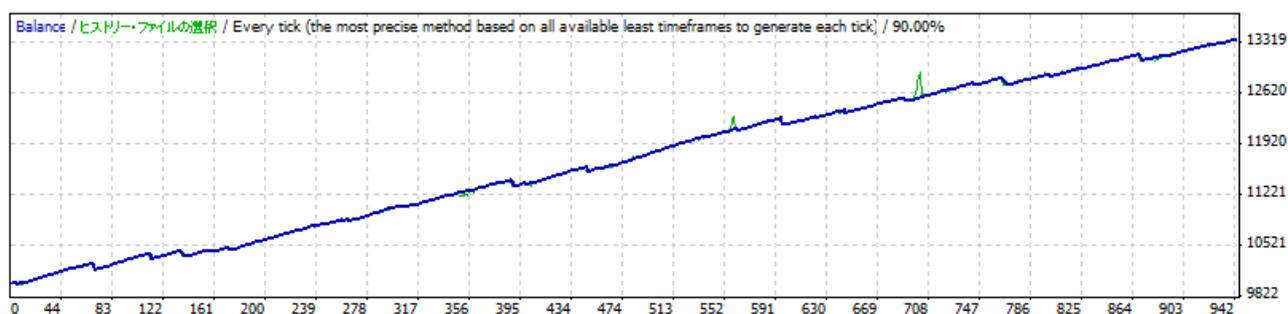
バックテスト【実施 証券会社：FXDD】 スプレッド2.0pips固定, ヒストリカルデータはFXDDの1分足データから生成					
通貨ペア	EURUSD (Euro vs. United States Dollar)				
テスト期間	5分足(M5) 2010.02.15 00:00 - 2012.02.14 23:55 (2010.02.15 - 2012.02.15)				
テストしたバーの数	146162	テストしたティック数	40566171	ティックの割合	90.00%
初期投資額	10000 [≒ 100万 円]				
総純損益	3267.00	総利益	4370.06	総損失	-1103.05
プロフィット ファクター	3.96	期待損益	3.43		
初期投資額からの ドロウダウン	140	最大ドロウダウン	293.99 (2.31%)	最大ドロウダウンの 割合	2.31% (293.99)
総トレード数	953	売りトレード数 (勝ちの割合)	502 (96.02%)	買いトレード数 (勝ちの割合)	451 (90.47%)
		勝ちトレード数 (全体の割合)	890 (93.39%)	負けトレード数 (全体の割合)	63 (6.61%)
	最大値	勝ちトレード	6.00	負けトレード	-56.24
	平均値	勝ちトレード	4.91	負けトレード	-17.51
	最大値	連続勝ちトレード数 (利益)	85(423.50)	連続負けトレード数 (損失)	4 (-80.90)
	最大値	連続利益 (勝ち数)	423.50 (85)	連続損失 (負け数)	-109.40 (3)
	平均値	連続勝ちトレード数	25	連続負けトレード数	2



## ★金曜日 19時から24時(日本時間)まで EA 稼働停止

News		--- News Filter ---
①	use_NewsFilter	true
②	DayOfTheWeek	5
③	Hour_of_News	12
④	PreHour_of_News	2
⑤	PostHour_of_News	3

バックテスト【実施 証券会社：FXDD】 スプレッド2.0pips固定, ヒストリカルデータはFXDDの1分足データから生成					
通貨ペア	EURUSD (Euro vs. United States Dollar)				
テスト期間	5分足(M5) 2010.02.15 00:00 - 2012.02.14 23:55 (2010.02.15 - 2012.02.15)				
テストしたバーの数	146162	テストしたティック数	40566171	ティックの割合	90.00%
初期投資額	10000 [≒ 100万 円]				
総純損益	3352.20	総利益	4322.06	総損失	-969.85
プロフィット ファクター	4.46	期待損益	3.56		
初期投資額からの ドロウダウン	140	最大ドロウダウン	293.99 (2.29%)	最大ドロウダウンの 割合	2.29% (293.99)
総トレード数	941	売りトレード数 (勝ちの割合)	491 (96.74%)	買いトレード数 (勝ちの割合)	450 (90.44%)
		勝ちトレード数 (全体の割合)	882 (93.73%)	負けトレード数 (全体の割合)	59 (6.27%)
	最大値	勝ちトレード	6.00	負けトレード	-56.24
	平均値	勝ちトレード	4.9	負けトレード	-16.44
	最大値	連続勝ちトレード数 (利益)	85(423.50)	連続負けトレード数 (損失)	4 (-80.90)
	最大値	連続利益 (勝ち数)	423.50 (85)	連続損失 (負け数)	-99.90 (2)
	平均値	連続勝ちトレード数	26	連続負けトレード数	2



## ◆バックテスト結果から

金曜日の 21 時以降の稼働停止によって勝率の上昇、平均損失の低下、プロフィットファクター (PF) の向上が認められました。White Bear V1 では、重要経済指標時の EA の稼働停止は成績向上に効果的であると思われました。

## ◆上記バックテスト結果については、下記からダウンロードできます。

➤ ニュースフィルター使用しない

<http://firestorage.jp/download/df8374a33c166f0233aa7b1f9efa883ddeded3e5>

➤ 金曜日 19 時から 24 時(日本時間)まで EA 稼働停止

<http://firestorage.jp/download/09f33bf29f4f051e256cae48644c9e121915ba9b>

➤ <参考>スプレッドの違いによる成績の差異

<http://firestorage.jp/download/6e4d021e5871b6b9f9840069457b14cd34d4ae00>

《注意》2012 年 3 月に公開して以来、好調を継続している EA ですので、直近 2 年のバックテスト結果では非常に綺麗な直線を描いていますが、過去には負けが混んだ時期もあります。今後もこの成績が保証されるものではないということをご理解ください。

今後ともどうぞ宜しくお願いいたします。

Penguin FX (Racco)

