

Strategy Tester Report

Murrey Lab 2.0

Alpari-ECN1 (Build 1170)

Символ	AUDNZD (Australian Dollar vs New Zealand Dollar)				
Период	15 Минут (M15) 2015.01.02 09:00 - 2019.06.28 23:45 (2015.01.01 - 2019.06.30)				
Модель	Все тики (наиболее точный метод на основе всех наименьших доступных таймфреймов)				
Параметры	mn=825; comm="D1_3_9"; CloseManualOrders=false; manual=false; stop=false; B001="##### DATES BLOCK #####"; FRS=false; ECB=false; CAD=false; CHF=false; GBP=false; AUD=false; NZD=false; TradeOnlyAtDates=false; SkipDates=true; DaysBeforeDates=0; DaysAfterDates=0; NY=false; JH=true; reverse=false; reverseCL=false; invert=false; B002="##### SPREAD & SLIPPAGE BLOCK #####"; MaxWaiting=30; Slip_on=0; Slip=10; CloseDuration=90; Spread_on=0; Spread=41; CheckBUYclose=false; CheckSELLopenNEXT=false; CheckBUYopenNEXT=true; CommonSpreadSlippageClosing=true; swap=0; B01="##### SL/TP BLOCK #####"; RealTP=false; pointstp=0; NumberTP=0; pointstp2=0; dollartp=0; percATRtp=0; percequitytp=0; PriceTP=0; PriceSL=0; pointssl=-2000; firstorderSL=0; dollarsl=0; percequitysl=0; pointssllwarn=0; firstorderSLwarn=0; dollarsllwarn=0; BEatrMAX=0; BEpointsMAX=0; BEpointsFIX=0; MurreyBELevel=0; alert_sl=0; breaktrade=true; Klock=2; TPSLock=true; SLock=100; stop_together=true; BE=false; TPlock=100; indiv_var=0; indvtp=0; TPreal=false; indivsl=0; SLreal=false; indiv_tp_MurrN=0; indiv_Period_tp=13; indiv_Period_sl=13; indiv_ATR_TF=1440; stop_sl=false; displayslp=true; B02="##### CLOSE ONLY in PROFIT BLOCK #####"; B021="===== Small grid conditions ====="; CloseProfit0=0; CloseProfit_Points0=0; CP_ATR_perc0=0; B022="===== Medium grid definition ====="; CloseProfit_min=1; CloseProfit_max=0; B023="===== Medium grid conditions ====="; CloseProfit=0; CloseProfit_Points=500; CP_ATR_perc=0; B024="===== Big grid conditions ====="; CloseProfit2=0; CloseProfit_Points2=0; CP_ATR_perc2=0; CP_ATR_Period=0; CP_ATR_TF=60; CP_ATR_ED=0; SecondIndCheck=true; B03="##### LOT SIZE BLOCK #####"; optionLot=0; FixLot=0.02; PercentOfDepo=1; multipl1=1; multipl2=1; AccFreeMargin=0; B031="===== Classical section ====="; T1=0.01; N1=12; T2=0.02; N2=21; T3=0.05; N3=29; T4=0.13; B04="##### EQUITY MANAGEMENT #####"; MaxPercDepo=0; MaxPercFree=100; B05="##### ENTRANCE DELAY BLOCK #####"; wait=0; ResetWait=false; onlylowerhigher=false; xdist=1700; multi_xdist=1; exponent_factor_xdist=1; DMOdist=0; lotDMO=0.01; xcandles=0; xdistONreal=false; B051="===== 'GX' Parameters ====="; GX_on=false; _GX_time_="Время фиксации цены"; GX_hour=10; GX_minut=0; GX_price_var=2; GX_points=700; GX_points_buy=700; GX_points_sell=700; GX_ATR_perc=10; GX_ATR_Period=1; GX_ATR_TF=5; GX_Price_buy=0; GX_Price_sell=0; B052="===== PivotEnvelope Parameters ====="; PE_op_dm=false; PE_tf_op_dm=1; PE_i_tf_op_old=1440; PE_i_maPeriod_op_old=2; PE_i_maShift_op_old=0; PE_i_maMethod_op_old=0; PE_i_maPrice_op_old=0; PE_i_indBarsCount_op_old=1000; PE_i_shift_op_old=1; B053="===== 2nd PivotEnvelope Parameters ====="; PE_op_on_jr=false; PE_i_tf_op_jr=240; PE_i_shift_op_jr=1; GX_Line_STYLE=0; B06="##### INDICATOR SETTINGS BLOCK #####"; DrawInd=false; B061="##### Quantum settings #####"; tf=5; qde_general=12; qde_oc=1; qdc_general=18; B0621="##### Main Oscillator settings #####"; RSI_period=0; B0622="===== Main Oscillator Open settings ====="; Stochastic_tf=5; Stochastic_op_on=false; Stochastic_K_op=5; Stochastic_D_op=3; Stochastic_S_op=3; Stochastic_OS_op=20; B0623="===== Main Oscillator Close settings ====="; Stochastic_tf_cl=1; Stochastic_cl_on=false; Stochastic_K_cl=5; Stochastic_D_cl=3; Stochastic_S_cl=3; Stochastic_OS_cl=30; B0631="##### PFE settings #####"; Pfe_tf=5; B0632="===== PFE Open settings ====="; Pfe_op_on=true; Pfe_Period_op=5; i_tf=15;				
Баров в истории	112131	Смоделировано тиков	116666643	Качество моделирования	90.00%
Ошибки рассогласования графиков	1				
Начальный депозит	1000.00	Спред			30
Чистая прибыль	437.86	Общая прибыль	443.12	Общий убыток	-5.27
Прибыльность	84.16	Матожидание выигрыша	12.51		
Абсолютная просадка	48.33	Максимальная просадка	85.50 (8.24%)	Относительная просадка	8.24% (85.50)
Всего сделок	35	Короткие позиции (% выигравших)	22 (86.36%)	Длинные позиции (% выигравших)	13 (92.31%)
		Прибыльные сделки (% от всех)	31 (88.57%)	Убыточные сделки (% от всех)	4 (11.43%)
Самая большая		прибыльная сделка	44.92	убыточная сделка	-2.15
		Средняя прибыльная сделка	14.29	убыточная сделка	-1.32
Максимальное количество		непрерывных выигрышей (прибыль)	9 (109.45)	непрерывных проигрышей (убыток)	1 (-2.15)
	Макс.	непрерывная прибыль (число выигрышей)	109.45 (9)	непрерывный убыток (число проигрышей)	-2.15 (1)
	Средний	непрерывный выигрыш	6	непрерывный проигрыш	1



№	Время	Тип	Ордер	Объем	Цена	S / L	T / P	Прибыль	Баланс
1	2015.02.16 10:30	buy	1	0.02	1.03708	0.00000	0.00000		
2	2015.02.24 18:06	close	1	0.02	1.04452	0.00000	0.00000	9.66	1009.66
3	2015.02.26 06:40	buy	2	0.02	1.03744	0.00000	0.00000		
4	2015.03.06 09:35	close	2	0.02	1.04489	0.00000	0.00000	9.66	1019.31
5	2015.03.12 03:40	buy	3	0.02	1.03748	0.00000	0.00000		
6	2015.03.13 11:25	close	3	0.02	1.04493	0.00000	0.00000	9.97	1029.28
7	2015.03.16 07:30	buy	4	0.02	1.03779	0.00000	0.00000		
8	2015.03.30 13:05	buy	5	0.02	1.02063	0.00000	0.00000		
9	2015.04.06 01:50	buy	6	0.02	1.00347	0.00000	0.00000		
10	2015.04.28 20:56	close	6	0.02	1.03761	0.00000	0.00000	44.92	1074.20

01.07.2019

Strategy Tester: Murrey Lab 2.0

11	2015.04.28 20:56	close	5	0.02	1.03761	0.00000	0.00000	21.57	1095.76
12	2015.04.28 20:56	close	4	0.02	1.03761	0.00000	0.00000	-2.08	1093.68
13	2015.04.29 01:15	buy	7	0.02	1.03699	0.00000	0.00000		
14	2015.04.30 00:10	close	7	0.02	1.04951	0.00000	0.00000	16.69	1110.37
15	2015.04.30 16:45	buy	8	0.02	1.03726	0.00000	0.00000		
16	2015.05.06 01:47	close	8	0.02	1.05571	0.00000	0.00000	24.61	1134.98
17	2015.06.15 17:40	sell	9	0.02	1.11093	0.00000	0.00000		
18	2015.06.18 18:05	sell	10	0.02	1.12812	0.00000	0.00000		
19	2015.07.08 10:04	close	10	0.02	1.11113	0.00000	0.00000	21.36	1156.34
20	2015.07.08 10:04	close	9	0.02	1.11113	0.00000	0.00000	-2.15	1154.19
21	2015.07.09 08:45	sell	11	0.02	1.11088	0.00000	0.00000		
22	2015.07.09 17:15	close	11	0.02	1.10342	0.00000	0.00000	10.02	1164.21
23	2015.07.14 07:50	sell	12	0.02	1.11166	0.00000	0.00000		
24	2015.07.16 07:05	sell	13	0.02	1.12930	0.00000	0.00000		
25	2015.07.23 09:07	close	13	0.02	1.11037	0.00000	0.00000	24.87	1189.08
26	2015.07.23 09:07	close	12	0.02	1.11037	0.00000	0.00000	0.83	1189.91
27	2015.07.23 21:25	sell	14	0.02	1.11149	0.00000	0.00000		
28	2015.07.27 09:30	close	14	0.02	1.10404	0.00000	0.00000	9.85	1199.75
29	2015.07.31 11:35	sell	15	0.02	1.11090	0.00000	0.00000		
30	2015.08.03 14:09	close	15	0.02	1.10346	0.00000	0.00000	9.92	1209.67
31	2015.08.04 05:05	sell	16	0.02	1.11118	0.00000	0.00000		
32	2015.08.04 20:30	sell	17	0.02	1.12825	0.00000	0.00000		
33	2015.08.12 11:26	close	17	0.02	1.10989	0.00000	0.00000	24.02	1233.69
34	2015.08.12 11:26	close	16	0.02	1.10989	0.00000	0.00000	1.09	1234.77
35	2015.08.12 13:00	sell	18	0.02	1.11123	0.00000	0.00000		
36	2015.08.14 09:10	sell	19	0.02	1.12846	0.00000	0.00000		
37	2015.08.19 22:23	close	19	0.02	1.11113	0.00000	0.00000	23.04	1257.82
38	2015.08.19 22:23	close	18	0.02	1.11113	0.00000	0.00000	-0.44	1257.38
39	2015.08.19 23:30	sell	20	0.02	1.11336	0.00000	0.00000		
40	2015.08.20 10:06	close	20	0.02	1.10591	0.00000	0.00000	9.76	1267.14
41	2015.08.24 16:15	sell	21	0.02	1.11465	0.00000	0.00000		
42	2015.08.25 15:30	close	21	0.02	1.10288	0.00000	0.00000	15.74	1282.88
43	2016.08.31 07:35	buy	22	0.02	1.03783	0.00000	0.00000		
44	2016.09.22 13:11	close	22	0.02	1.04552	0.00000	0.00000	9.30	1292.18
45	2016.12.08 09:50	buy	23	0.02	1.03786	0.00000	0.00000		
46	2016.12.15 09:07	close	23	0.02	1.04590	0.00000	0.00000	10.50	1302.68
47	2017.01.25 23:55	buy	24	0.02	1.03670	0.00000	0.00000		
48	2017.02.02 00:57	close	24	0.02	1.04415	0.00000	0.00000	9.58	1312.26
49	2017.06.22 16:55	buy	25	0.02	1.03783	0.00000	0.00000		
50	2017.06.28 04:15	close	25	0.02	1.04528	0.00000	0.00000	9.84	1322.10
51	2017.09.01 15:45	sell	26	0.02	1.11176	0.00000	0.00000		
52	2017.09.05 18:28	close	26	0.02	1.10432	0.00000	0.00000	9.84	1331.94
53	2017.09.06 20:10	sell	27	0.02	1.11089	0.00000	0.00000		
54	2017.09.12 10:28	close	27	0.02	1.10149	0.00000	0.00000	12.14	1344.08
55	2017.10.19 09:10	sell	28	0.02	1.11125	0.00000	0.00000		
56	2017.10.24 20:10	sell	29	0.02	1.12843	0.00000	0.00000		
57	2017.11.01 00:05	close	29	0.02	1.11102	0.00000	0.00000	22.75	1366.82
58	2017.11.01 00:05	close	28	0.02	1.11102	0.00000	0.00000	-0.59	1366.23
59	2017.11.01 01:40	sell	30	0.02	1.11103	0.00000	0.00000		
60	2017.11.08 23:09	close	30	0.02	1.10237	0.00000	0.00000	11.07	1377.30
61	2017.11.14 05:35	sell	31	0.02	1.11108	0.00000	0.00000		
62	2017.11.15 02:55	close	31	0.02	1.10345	0.00000	0.00000	10.17	1387.47
63	2017.11.17 10:10	sell	32	0.02	1.11209	0.00000	0.00000		
64	2017.11.27 15:45	close	32	0.02	1.10408	0.00000	0.00000	10.11	1397.58
65	2017.12.05 10:10	sell	33	0.02	1.11088	0.00000	0.00000		
66	2017.12.07 02:45	close	33	0.02	1.09668	0.00000	0.00000	18.75	1416.33
67	2018.08.09 03:15	sell	34	0.02	1.11131	0.00000	0.00000		
68	2018.08.13 19:32	close	34	0.02	1.10377	0.00000	0.00000	9.97	1426.30
69	2019.02.14 16:50	buy	35	0.02	1.03780	0.00000	0.00000		
70	2019.04.02 00:33	close	35	0.02	1.04784	0.00000	0.00000	11.56	1437.86