

ストラテジーテスター/オプティマイザー

本機能を使う事で、チャートトレーダーに付属している自動売買機能のトレーディングシステムを利用前にテストして頂けます。トレーディングシステムそれ自体においても、設定した後に稼働させなければシグナルを発するだけですので有効性の検証はして頂けますが、本機能では過去のデータを元に想定される差損の計算や、どういう値が適切なのか？を検証して頂く事ができます。

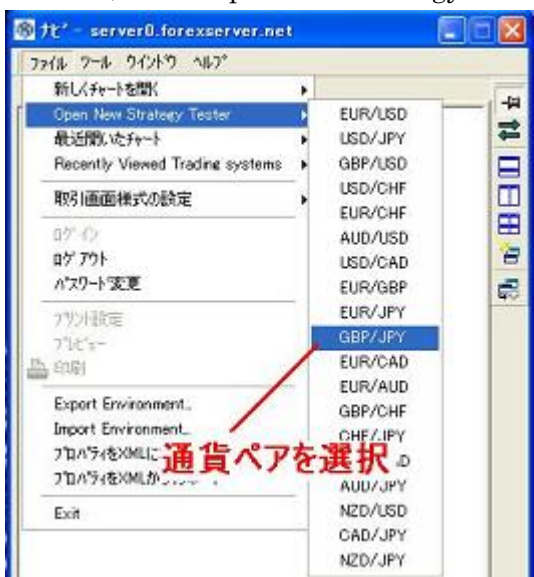
*この機能は、携帯電話では利用できません。

1. 「ストラテジーテスター」の表示

ストラテジーテスターを表示させるには下記 A,B2 通りの表示方法があります。

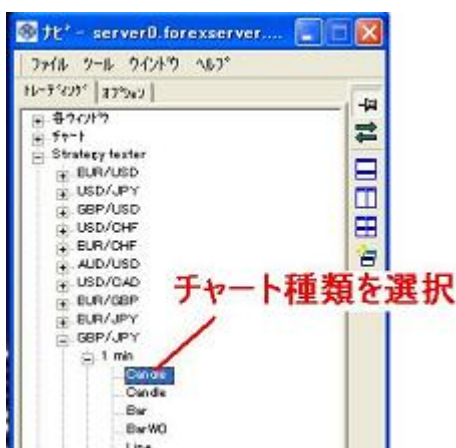
A

ナビ>ファイル>Open New Strategy Tester>通貨ペア



B

ナビ>トレーディングタブ>Strategy Tester>通貨ペア>表示時間枠>チャートの種類

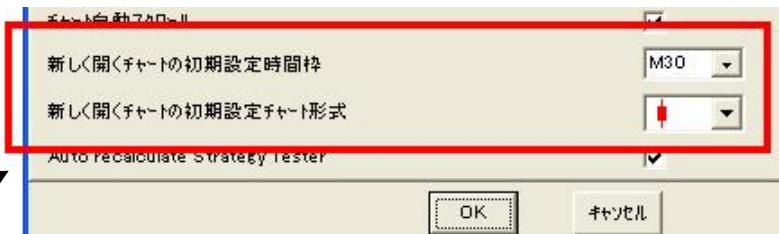
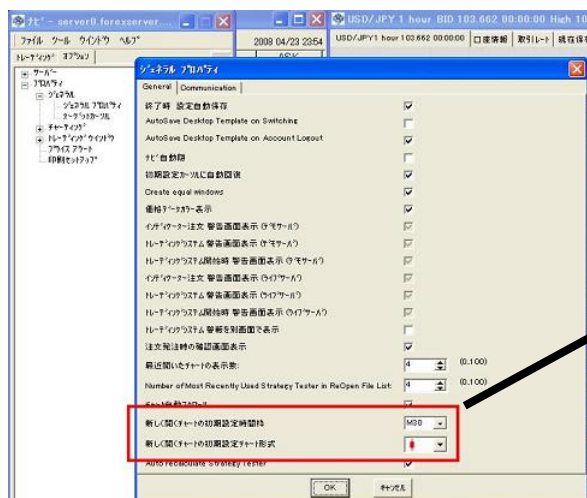


Aの方法では時間枠、チャート種類の選択はありません。

初期設定では 30 分足のローソク足で表示されます。

初期設定の変更は以下の手順で行います。

ナビ>オプションタブ>プロパティ>ジェネラル>ジェネラルプロパティ>ジェネラルタブ



注意: 「ストラテジーテスター」では以下の選択ができません。

- 表示時間枠のティック
- チャートの種類の Heikin-Ashi candlesticks と Point figure

2. 「ストラテジーテスター」画面



Settings	
Result	
Trading system	
Bollinger Bands of Ultimate Oscillator System	
Testing in one pass	
名前	値
-	
Bollinger Bands Periods	20
Bollinger Bands Deviation	2
Bollinger Bands MA Type	Simple
-	
Ultimate Oscillator MA Period	8
Ultimate Oscillator MA Type	Simple

◎Settings タブ-トレーディングシステムの各種パラメータを変更・実行できます。

◎Result タブ-テスト結果が一覧表示されます。

注意: 通常チャートと比べ「ストラテジーテスター」のチャートでは以下のコマンドは使用できません。

- ・成行注文、指値注文、逆指値注文、プライスアラート
- ・トレーディングシステムの追加・設定
- ・高値/安値線
- ・チャートタブ設定画面表示

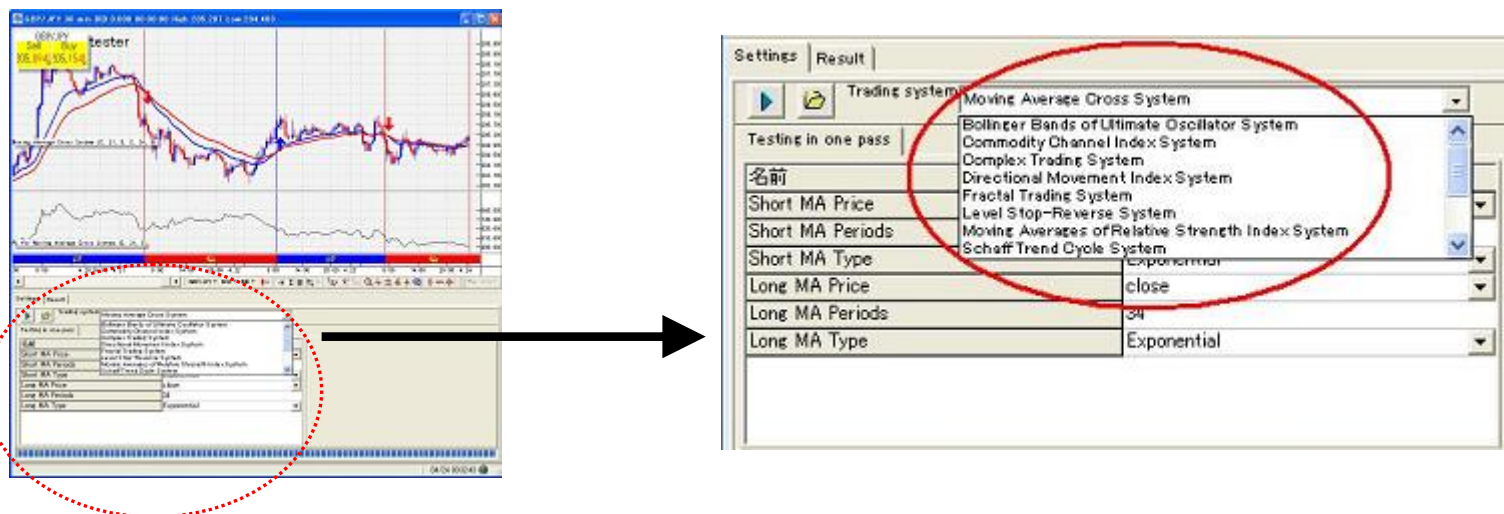
2.1 テスト設定

テストを行う前に設定すべき項目は以下の通りです。

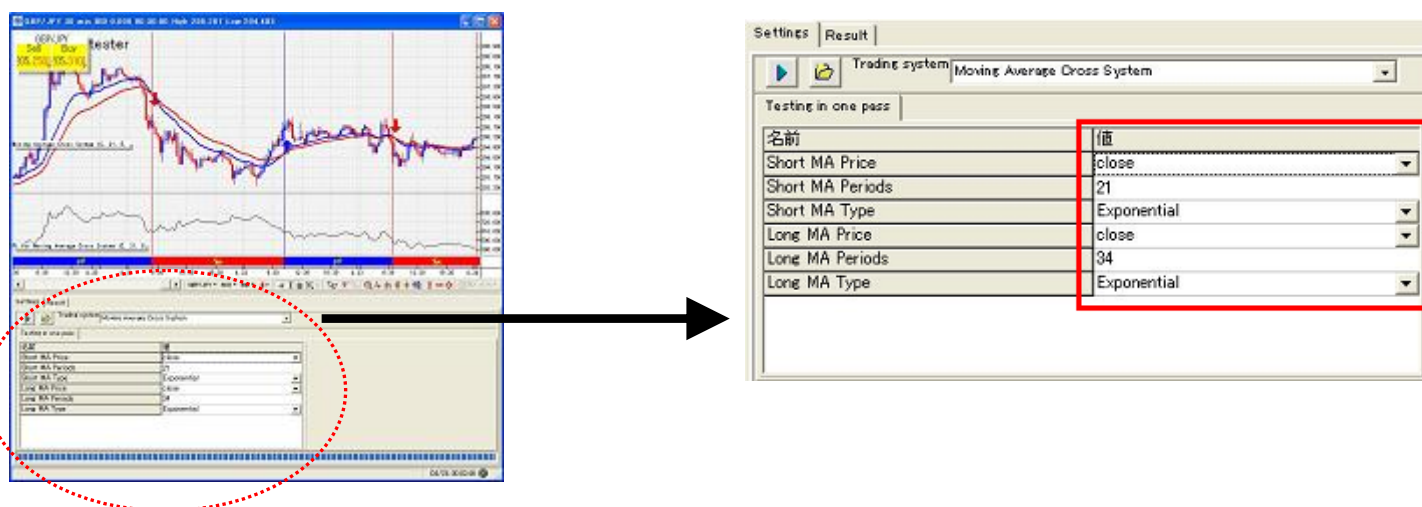
- ・トレーディングシステムの選択およびパラメータの設定
- ・通貨ペアと表示時間枠の設定
- ・履歴期間の設定 (参照: 2.3 履歴期間の設定)

2.1.1 トレーディングシステム及びパラメータ

Settings タブで Trading System からトレーディングストラテジー（分析ツール）を選択します。

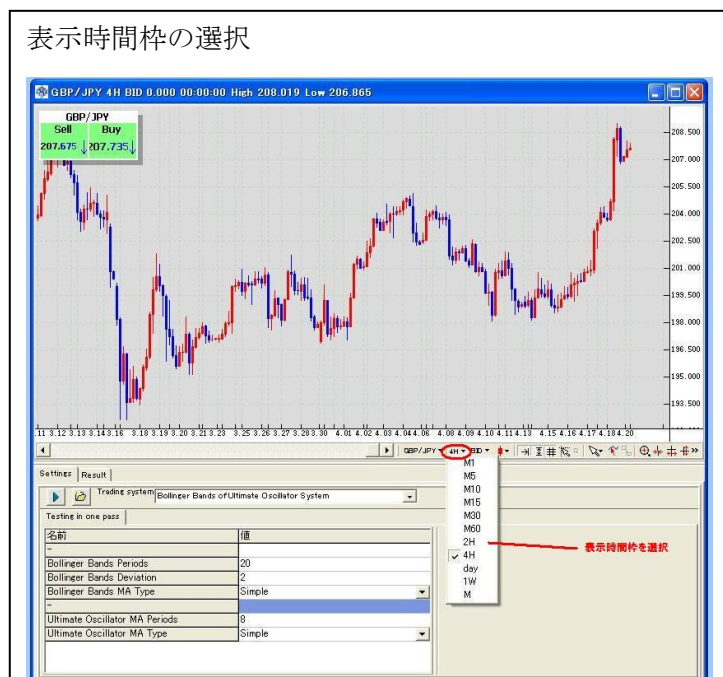


Settings タブでトレーディングシステムを選択すると、初期設定のパラメータで計算が為され、"Result" タブに計算結果が表示されますが、任意の値の入力/選択するには今一度"Settings"タブをクリックし値を変更/選択します。



2.1.2 通貨ペアおよび表示時間枠の選択

チャート下の通貨ペアおよび表示時間枠を選択します。データは自動的に更新されたものが表示されます。



2.2 注文について

ストラテジーテスターでは、成行注文の“買い”と“売り”の検証のみ可能です。リミット・ストップはできません。“買い”および“売り”のシグナルは、ローソク足がクローズした時に表示され、取引は設定したパラメータによる理論値に基づき計算されます。

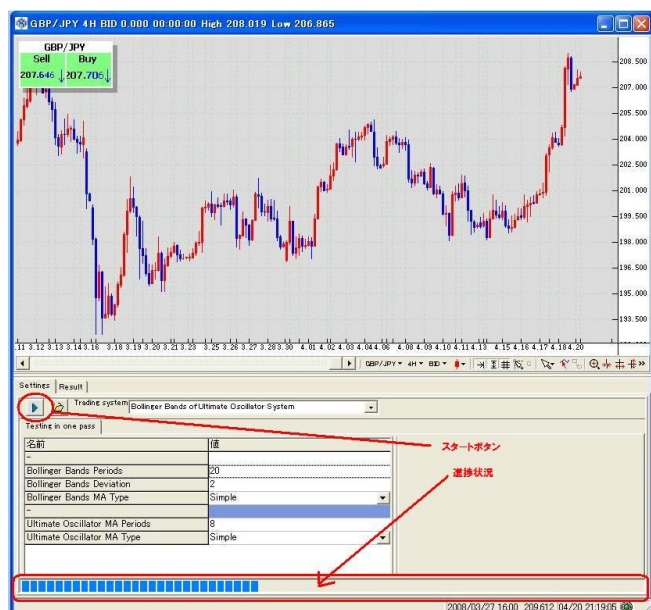
2.3 履歴期間の設定

下記の手順で、履歴期間（足の数）を変更できます。

ナビ>オプションタブ>プロパティ>ジェネラル>ジェネラルプロパティ>Communication タブ>履歴期間（100～2000）>OK

2.4 トレーディングシステムのテスト

通貨ペアと表示時間枠およびパラメータの変更後、スタートボタンを押して、トレーディングシステムの計算をします。同時にテストの算出結果が“Result”タブに時系列で表示されます。



2.5 テスト結果の表示



2.6 テストの算出結果

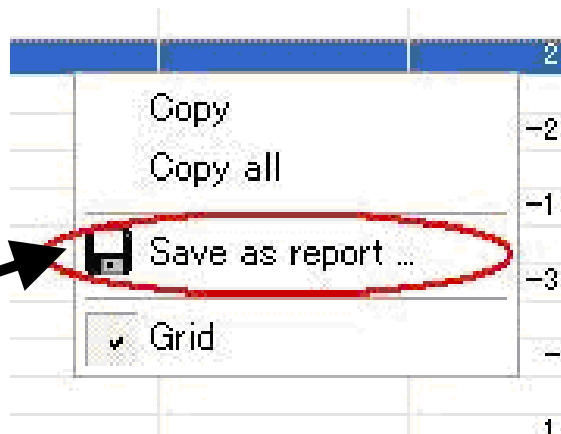
“Result” タブにテストの算出結果が表示されます。



各項目の説明：

- N – 取引番号
- Time – 取引日時
- Type – 新規/決済 売買の別
- Order – 注文回数
- Volume – 取引数量
- Price – 約定値
- Stop Loss – 使用不可
- Take profit – 使用不可
- Profit – 差損益
- Balance – 残高

テスト結果をファイルもしくはクリップボードに保存できます。“Result” タブ内を右クリックして、“Save as report ...” を選択します。

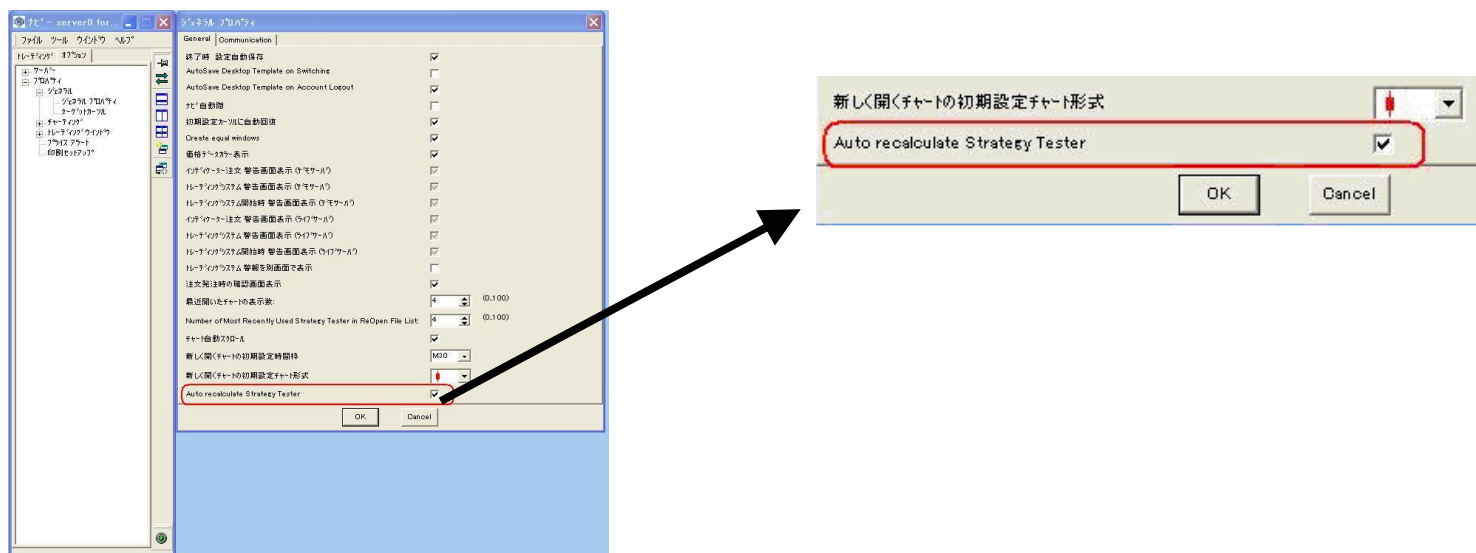


テスト結果は、Internet Explorer, Mozilla, Opera などのブラウザーでも、表示できます。

Strategy Tester Report									
Bollinger Bands of Ultimate Oscillator System									
Chart Trader									
Build 1.7.11.47 QA - 2008042100									
Instrument	GBP/JPY								
Interval	4 Hours (4H) 12.28.2007 20:00:00 04.22.2008 00:00:00								
Parameters	Bollinger Bands Periods = 20, Bollinger Bands Deviation = 2, Bollinger Bands MA Type = 0, Ultimate Oscillator MA Periods = 8, Ultimate Oscillator MA Type = 0;								
Total net profit	461.60	Gross profit	3121.80	Gross loss	-2660.20				
Total trades	32	Profit trades	14	Loss trades	18				
		% of profit trades	43.75%	% of loss trades	56.25%				
		Long position	16	Short position	16				
		% of won long position	37.50%	% of won short position	50.00%				
		Largest profit trade	577.10	loss trade	-350.00				
		Average profit trade	222.99	loss trade	-147.79				
N	Time	Type	Order	Volume	Price	Stop Loss	Take Profit	Profit	Balance
1	01.04.2008 04:00:00	Open Buy	1	1.00	215.56999				
2	01.09.2008 20:00:00	Close Buy	1	1.00	215.39000			-18.00000	-18.00000
3	01.09.2008 20:00:00	Open Sell	2	1.00	215.39000				
4	01.11.2008 16:00:00	Close Sell	2	1.00	213.23999			215.00000	197.00000
5	01.11.2008 16:00:00	Open Buy	3	1.00	213.23999				
6	01.14.2008 20:00:00	Close Buy	3	1.00	211.13000			-211.00000	-14.00000
7	01.14.2008 20:00:00	Open Sell	4	1.00	211.13000				
8	01.17.2008 04:00:00	Close Sell	4	1.00	212.23000			-110.00000	-124.00000
9	01.17.2008 04:00:00	Open Buy	5	1.00	212.23000				
10	01.20.2008 20:00:00	Close Buy	5	1.00	208.73000			-350.00000	-474.00000
11	01.20.2008 20:00:00	Open Sell	6	1.00	208.73000				

新たなパラメータでテストする場合は、“Setting” タブで設定を変更して、“Start” ボタンを押します。前回のテスト結果は消去され更新されます。

尚、自動再計算機能は、下記の “Auto recalculate Strategy Tester” のチェックマークのオン・オフで設定できます。
ナビ>オプションタブ>プロパティ>ジェネラル>ジェネラルプロパティ>General タブ>Auto recalculate Strategy Tester >OK



オプティマイザー（トレーディングシステムの最適化）


Optimization とはトレーディングシステムの最適なパラメーター設定を検証するためのツールです。ここでは”Moving Average Cross System”例に Optimization 機能を紹介します。

“Moving Average Cross System”とは二つの移動平均線を用いてシグナルを出すという仕組みになっており、その場合、どの数値で設定された移動平均線が最適なものなのかを検証します。

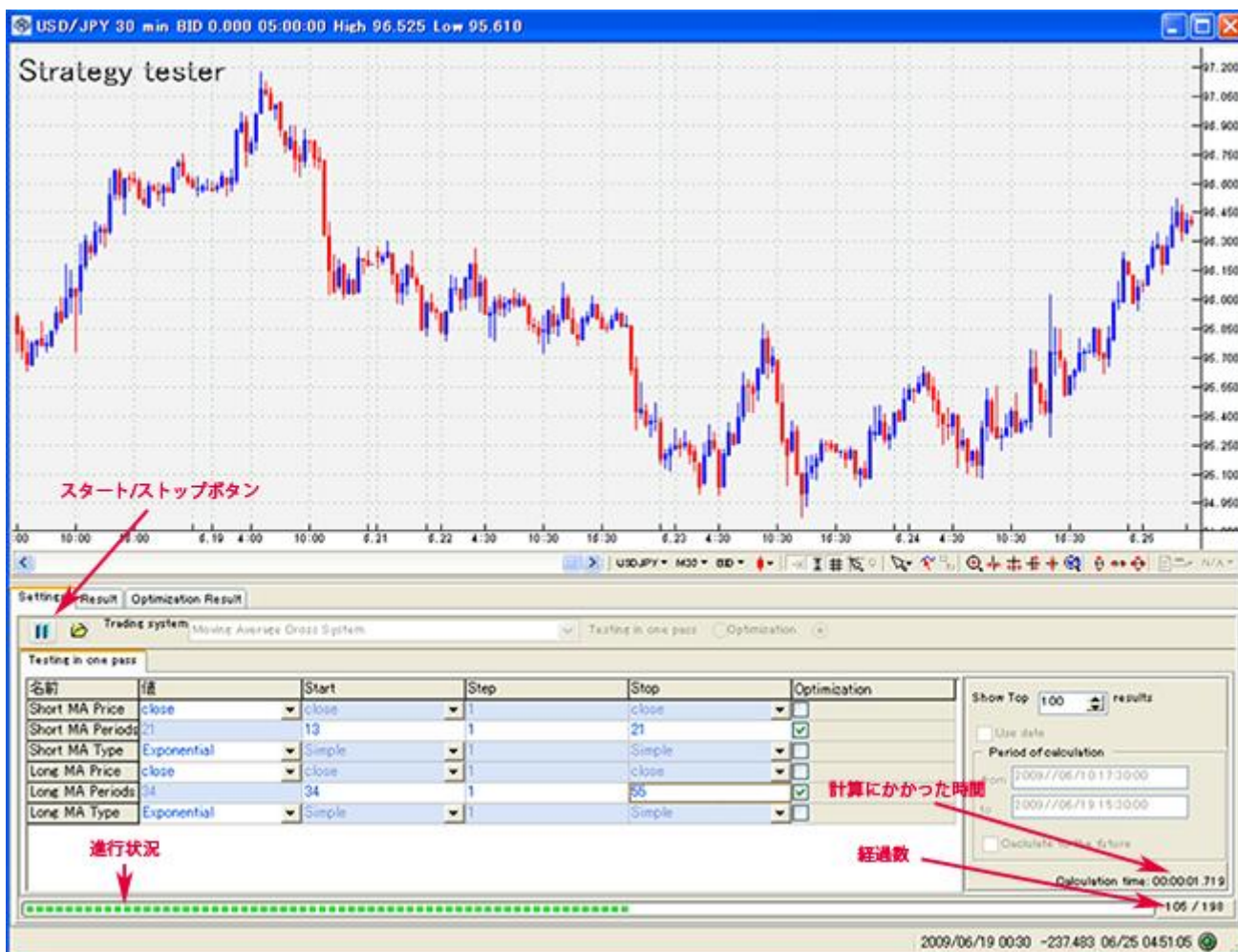
結果は Profit(差損益)、Total trades(総トレード数)、インプット(検証した値)が表示されます。

使用方法

“Moving Average Cross System”では”Short MA Period”, “Long MA Period”のパラメーターを設定していきます。

パラメーター設定後、 をクリックすると、過去のデータを元にしたトレーディングシステムの計算が開始されます。

画像参照



計算が終了しますと、設定した条件で計算された結果が1から100まで表示されます。

“最も少ないトレード数で最も高い利益を得られること”が検証の基準となります。

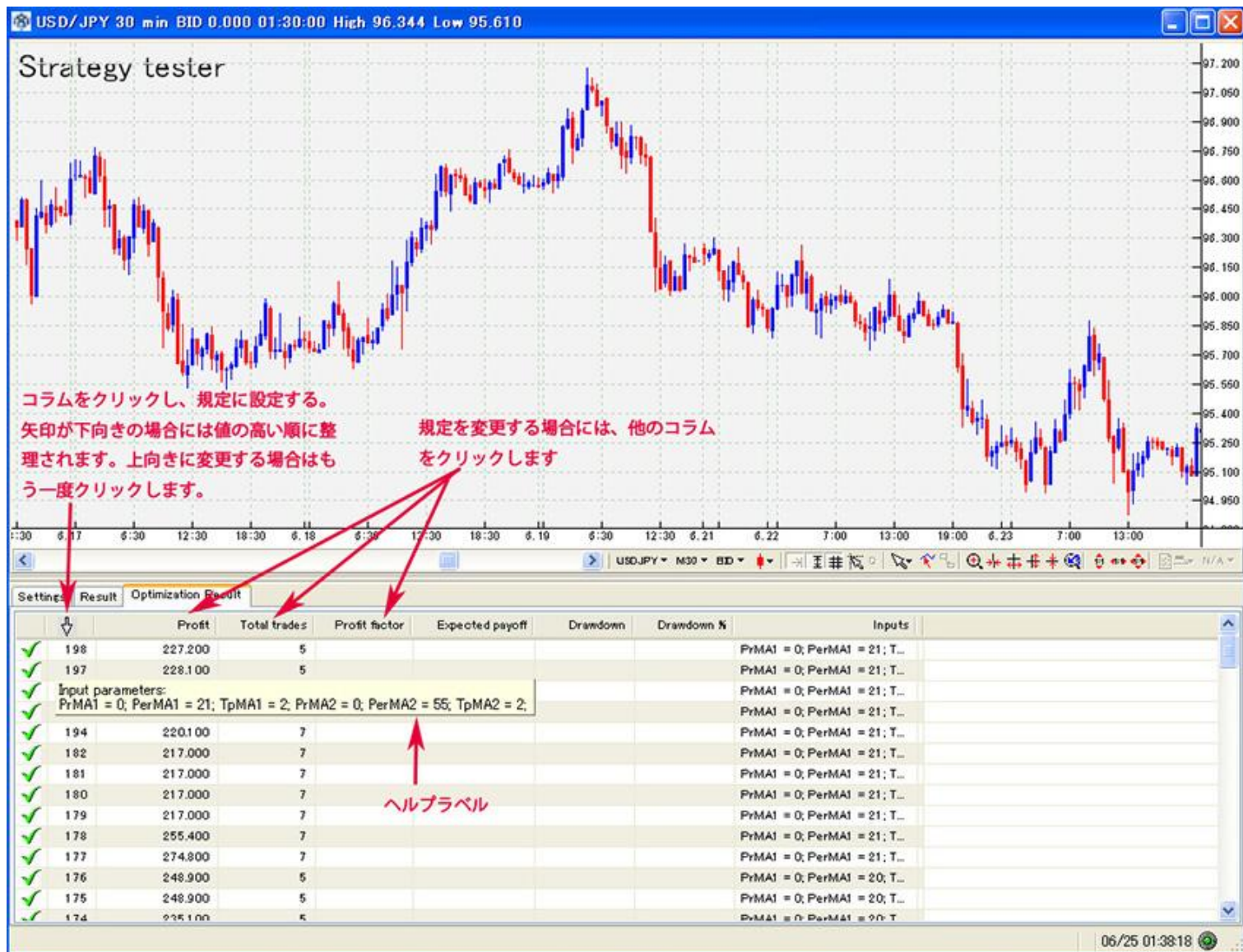
結果参照

Optimizationの結果では、“コラム”(Profit, Total Trades, Input)が表示されます。

例：“Profit”のコラムをクリックすると矢印が表示されます。結果は”Profit”の値が高い順から表示され、逆に矢印が下向きの場合、結果は”Profit”の高い順に表示されます。

“Profit”以外の値を基準とする場合は、他のコラムをクリックします。

画像参照



結果コラムの概要

N	経過数
Profit	P/L (損益)
Total Trades	トレード数の合計
Profit Factor	(現在機能作成中)
Expected Payoff	(現在機能作成中)
Drawdown	(現在機能作成中)
Drawdown%	(現在機能作成中)
Inputs	インプットされたパラメータ(CTL プログラミングのフォーミュラ形式)

初期設定では表示数が”100”になっていますが、下記箇所より表示数を変更することができます。

画像参照

Settings | Result | Optimization Result

Trading system: Moving Average Cross System | Testing in one pass | Optimization

Testing in one pass

Name	Value	Start	Step	Stop	Optimization
Short MA Price	close	close	1	close	<input type="checkbox"/>
Short MA Periods	21	13	1	21	<input checked="" type="checkbox"/>
Short MA Type	Exponential	Simple	1	Simple	<input type="checkbox"/>
Long MA Price	close	close	1	close	<input type="checkbox"/>
Long MA Periods	34	34	1	55	<input checked="" type="checkbox"/>
Long MA Type	Exponential	Simple	1	Simple	<input type="checkbox"/>

Show Top 100 results

Use date period

Period of calculation

from 2007..08.31 16:00:00

to 2008..06.26 00:00:00

Calculate to the future

Calculation time: 00:00:10.532