

日本株専用

システムトレードの達人

バックテスト機能 (マルチモード)

マニュアル



- I. マルチモードへの切り替え方法
- II. バックテスト機能 (マルチモード) 解説
- III. バックテスト結果画面 (マルチモード) 解説

I .マルチモードへの切り替え方法	3
II . バックテスト機能(マルチモード)解説	7
1. ストラテジーの個別設定	8
1-1. ストラテジーの選択	8
1-2. 資金管理	9
2. ストラテジーの全体設定	10
3. バックテストの開始方法	11
III . バックテスト結果画面(マルチモード)解説	14



バックテスト機能 (マルチモード)

マニュアル

I. マルチモードへの切り替え方法

I. マルチモードへの切り替え方法

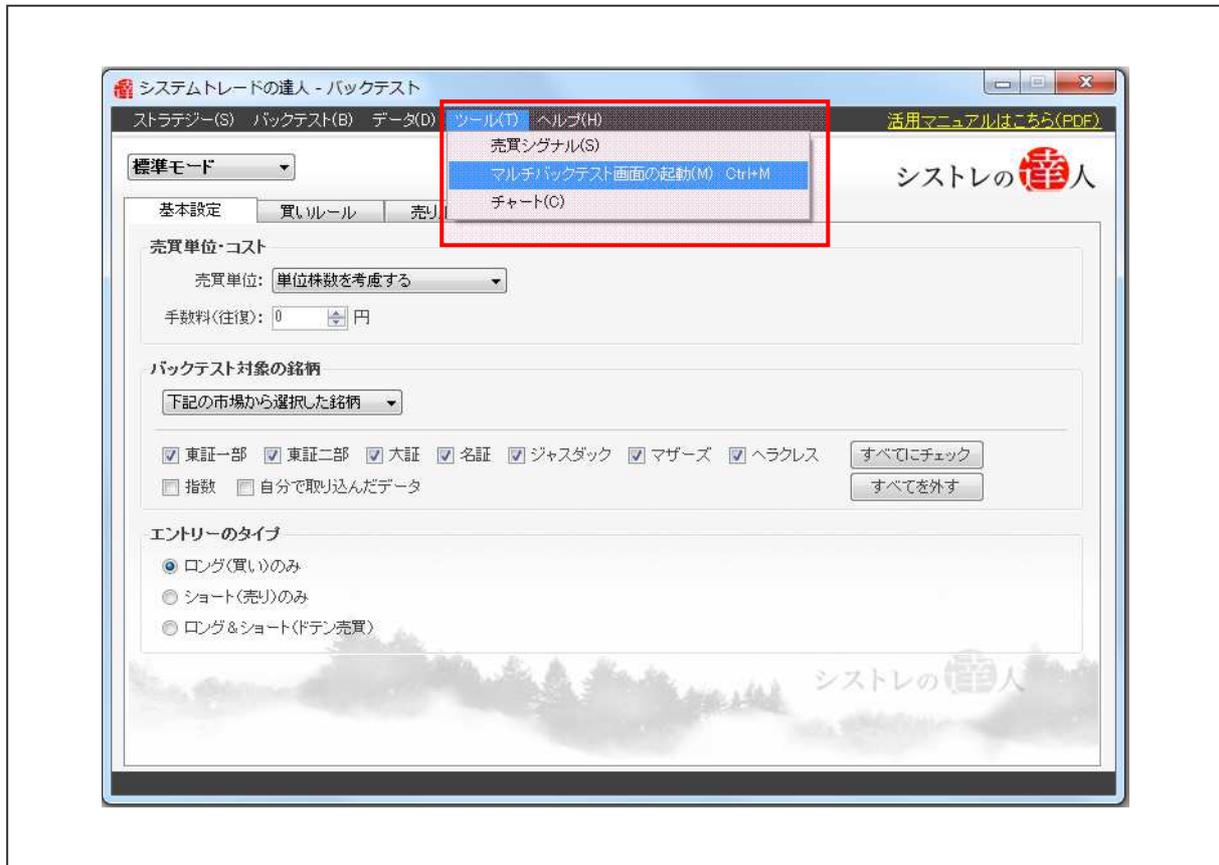
II. バックテスト機能(マルチモード)解説

III. バックテスト結果画面(マルチモード)解説

I. マルチモードへの切り替え方法

ここでは、複数の売買ルールを同時に運用するマルチストラテジーの検証をするための「マルチモード」への切り替え方法を解説します。マルチモードに切り替えるには、以下の操作を行います。

「バックテスト」画面の「ツール(T)」から「マルチバックテスト画面の起動(M)」を選択します。



「マルチバックテスト画面の起動(M)」を選択すると、以下のような画面が表示されます。以下のように、「システムトレードの達人 - マルチストラテジー・バックテスト」という表示が出ればマルチモードへの切り替えは完了です。





バックテスト機能 (マルチモード)

マニュアル

II. バックテスト機能解説 (マルチモード)

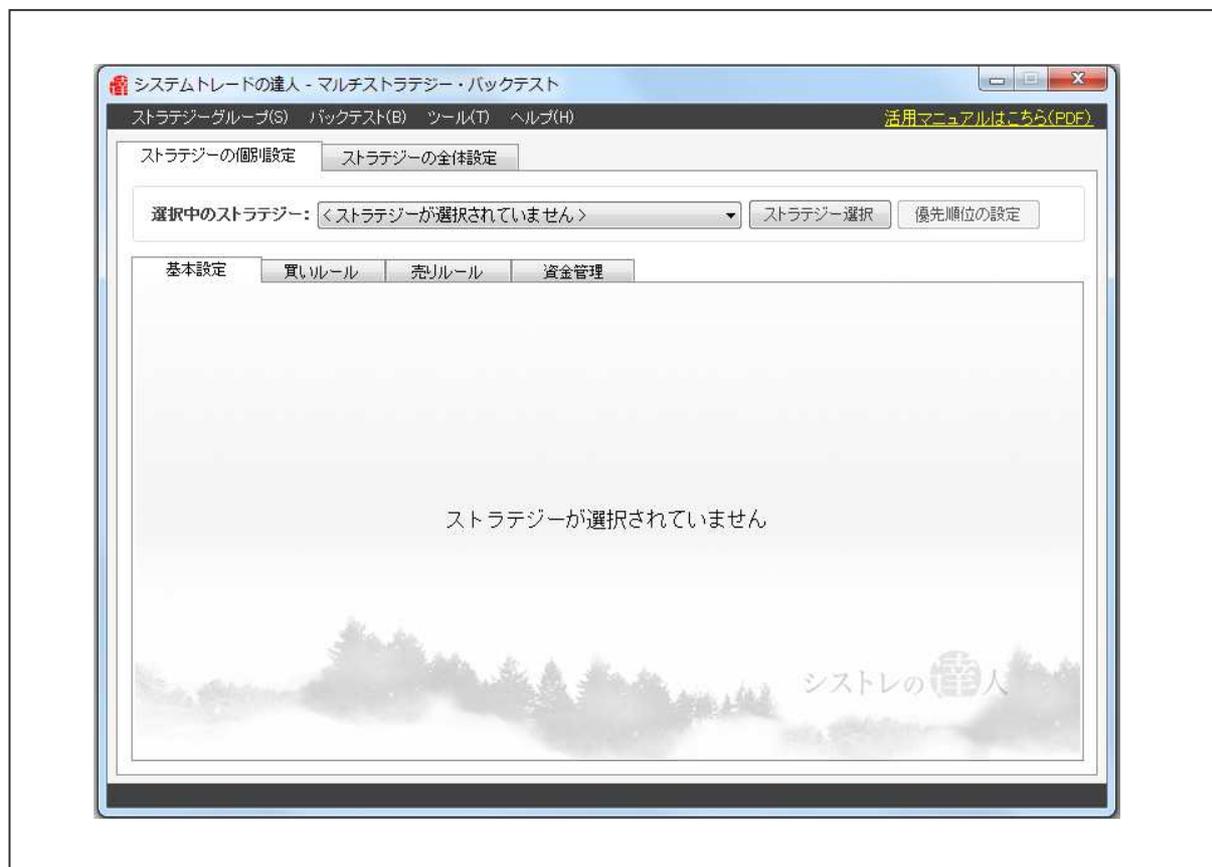
I. マルチモードへの切り替え方法

II. **バックテスト機能**(マルチモード)解説

III. **バックテスト結果画面**(マルチモード)解説

II. バックテスト機能(マルチモード)解説

ここでは、「マルチモード」でのバックテストの具体的な手順を解説します。バックテストは、以下のような6つ手順で進めていきます。



「マルチモード」でのバックテスト手順の概略

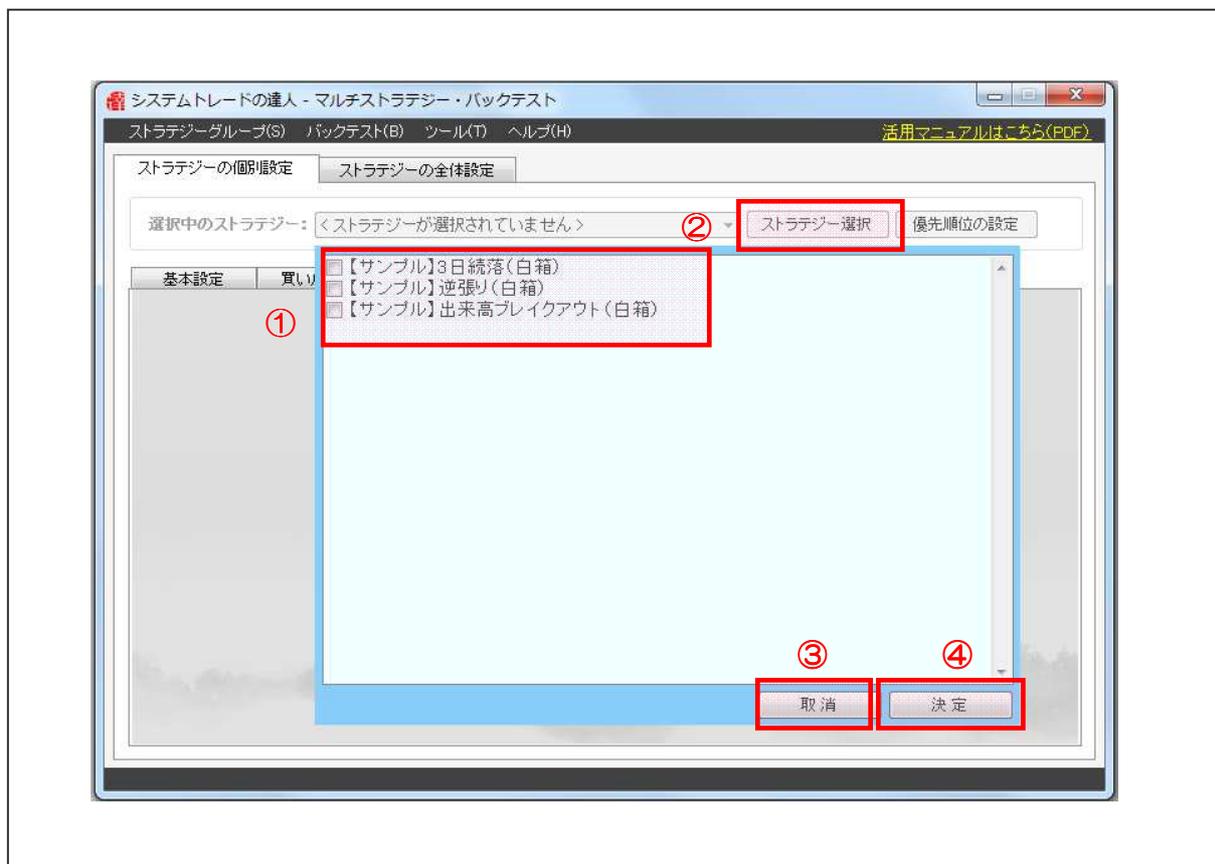
1. ストラテジーの選択
- ↓
2. ストラテジーごとの資金管理の設定
- ↓
3. ストラテジー優先順位の設定
- ↓
4. ストラテジーの全体設定
- ↓
5. バックテスト期間等の選択
- ↓
6. バックテスト開始

1. ストラテジーの個別設定

ここでは「マルチモード」によるバックテストで使用する「ストラテジーの個別設定」の機能設定について解説します。

1-1. ストラテジーの選択

以下は、「ストラテジーの個別設定」の設定画面です。(マルチモード)



① 「ストラテジー一覧」の表示

このボタンを押すと、上図のようにストラテジー一覧が表示されます。この中からマルチストラテジーに組み込むストラテジーを選択することができます。

② 「組み合わせたいストラテジー」の設定

ストラテジー名の左側にあるチェックボックスにチェックを入れ、マルチストラテジーで運用したいストラテジーを選択することができます。

③ 「組み合わせ内容」の取り消し

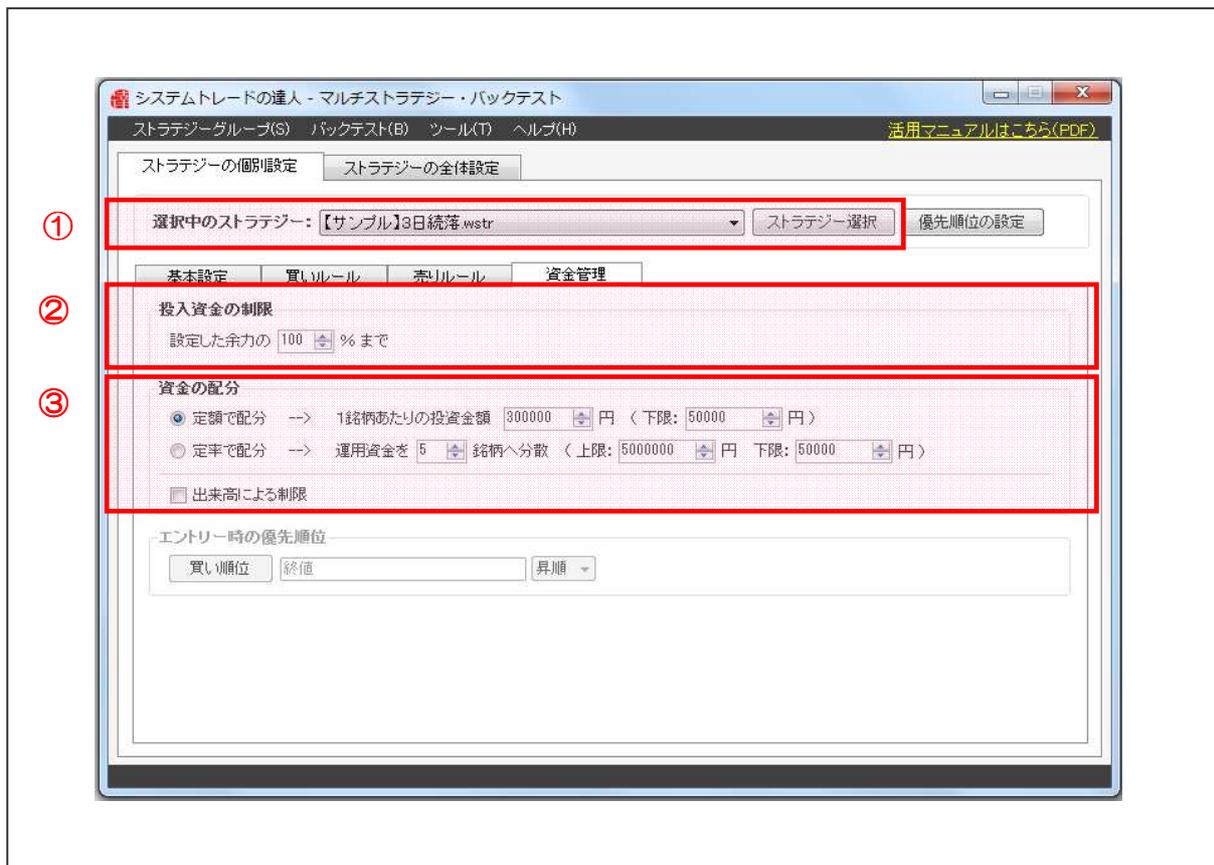
マルチストラテジーで運用したいストラテジーを選択後、全て取り消すことができます。

④ 「組み合わせ」の決定

マルチストラテジーで運用したいストラテジーを決定することができます。

1-2. 資金管理

以下は、「ストラテジーの個別設定」の設定画面です。(マルチモード)



① 「選択中のストラテジー」の切り替え

ここでマルチストラテジーに組み込んだ、ストラテジーを選択し切り替え、個別に資金管理を設定することができます。

② 「投入資金の制限」の設定

マルチストラテジー全体で使用する資金（または余力）のうち、何%を選択中のストラテジーに投入するか設定することができます。

③ 「資金配分」の設定

「定額で配分」では、投資金額を指定した 1 銘柄あたりの投資金額の範囲内でバックテストします。「定率で配分」では、バックテスト期間中に変化する資産に応じて、指定した銘柄数を基本として、設定した金額の範囲内にてバックテストします。これらをマルチストラテジーに組み合わせたストラテジーごとに設定することができます。「出来高による制限」では、シグナルが発生した当日の出来高の割合に応じて 1 銘柄あたりの投資金額の上限設定ができます。

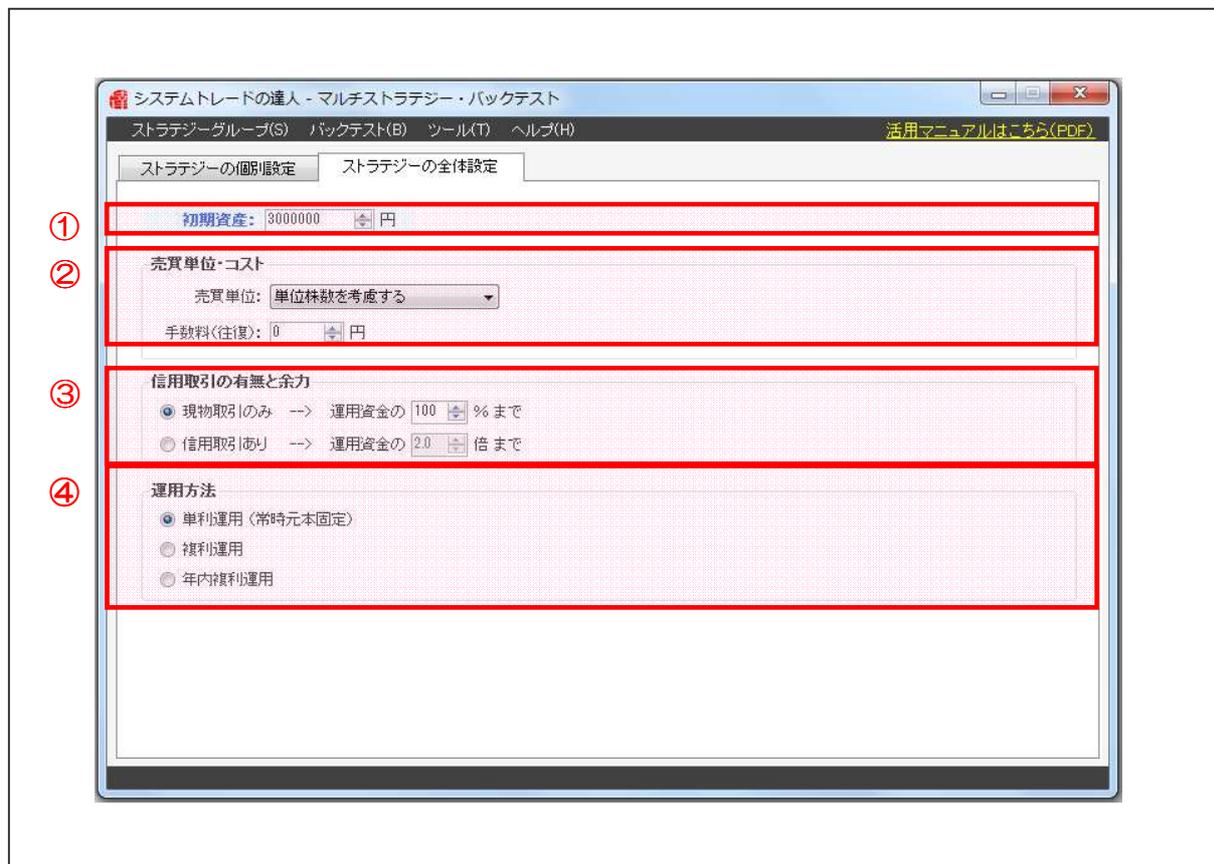
※ 「エントリー時の優先順位」について

ソフトウェアの都合上、表示はされていますが、マルチモードでは利用できなくなっています。

2. ストラテジーの全体設定

ここでは「マルチモード」によるバックテストで使用する「ストラテジーの全体設定」の機能設定について解説します。

以下は、「ストラテジーの全体設定」の設定画面です。(マルチモード)



① 「初期資産」の設定

マルチストラテジーで運用する際の初期に投資する投資金額を入力します。

② 「売買単位・コスト」の設定

単位株で取引した場合で検証する「単位株数を考慮する」、または取引金額を指定し、取引金額で単位株数を無視して取引する「金額を固定(単位株数を無視)」を選択します。「金額を固定(単位株数を無視)」では、株価や単位株数による投資金額の大小に影響されない、売買ルールの検証結果を得ることができます。

③ 「信用取引の有無と余力」の設定

「現物取引のみ」または「信用取引あり」を選択します。「現物取引のみ」を選択した場合、運用資金の1～100%の範囲で現物取引にて投資した際の検証ができます。「信用取引あり」を選択した場合、運用資金の1.0～3.3倍の範囲で現物取引および信用取引を含めて投資した際の検証ができます。

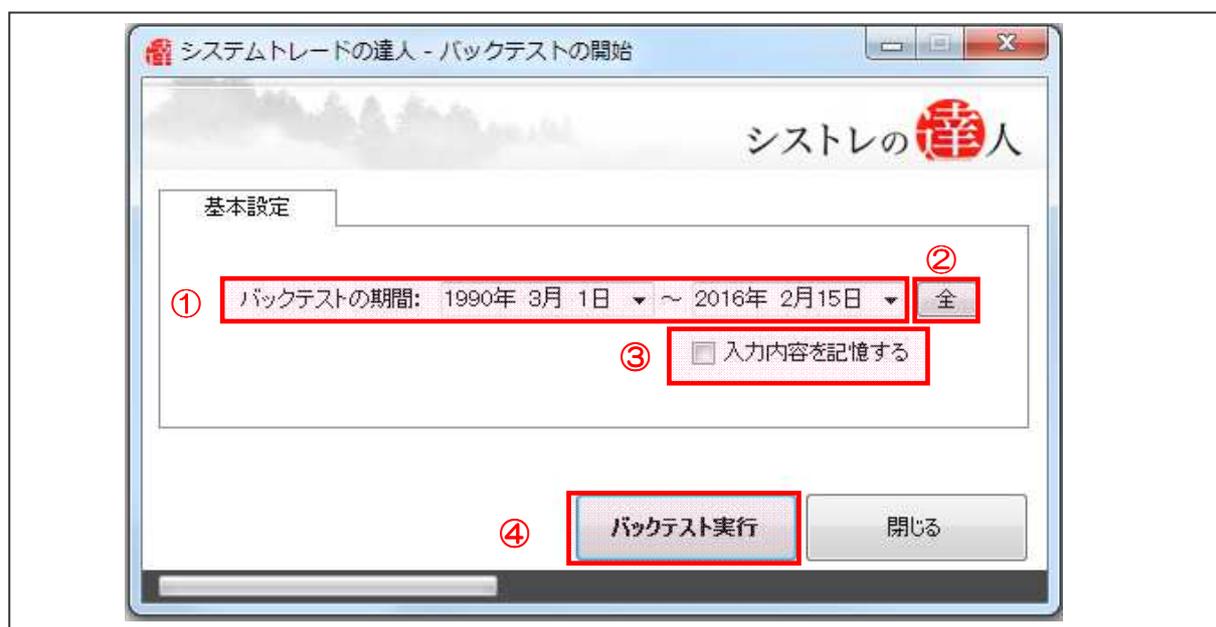
④ 「運用方法」の設定

単利で運用した検証結果を得るための「単利運用」と、複利で運用した検証結果を得るための「複利運用」、年内は複利で運用した検証結果を得るための「年内複利運用」があります。

3. バックテストの開始方法

ここでは「マルチモード」でのバックテストの開始方法について解説します。

バックテストの開始を行なうと、以下の画面が表示されます。



「基本設定」の入力

① 「バックテストの期間」の入力

バックテストの期間を入力します。

② 「全」の選択

「全」を選択すると、①「バックテストの期間」がワンクリックで前回までに取り込んだ株価データの全期間に変更されます。

③ 「入力内容を記憶する」の選択

チェックボックスにチェックを入れることで、①「バックテストの期間」で入力した期間を記憶し、次回以降、同じ期間で表示されます。

③ 「バックテスト実行」の選択

ボタンを選択するとバックテストを開始します。

バックテスト機能 (マルチモード)

マニュアル

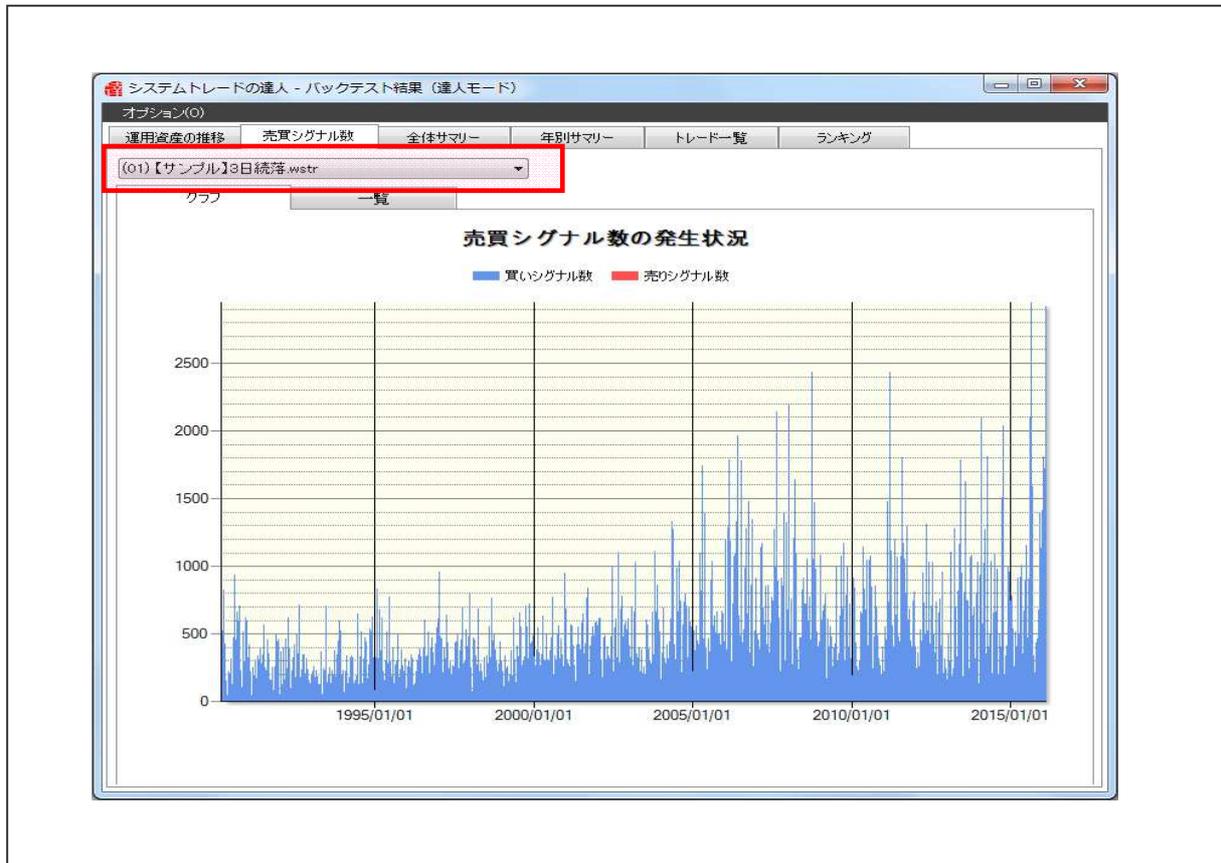
Ⅲ. バックテスト結果画面 (マルチモード) 解説

- Ⅰ. マルチモードへの切り替え方法
- Ⅱ. バックテスト機能(マルチモード)解説
- Ⅲ. **バックテスト結果画面(マルチモード)解説**

Ⅲ. バックテスト結果画面(マルチモード)解説

ここでは、マルチモードでのバックテスト結果について解説します。

基本的なバックテスト結果は、「達人モード」と同様です。ただし、下図の四角で囲まれた部分を選択すると、マルチストラテジーに組み込んだ個別のストラテジーの検証結果を確認することができます。



「システムトレードの達人」のご使用方法について、ご質問・ご不明な点などございましたら、下記サポートセンターまでご連絡下さいますようお願い致します。

「システムトレードの達人」サポートセンター

電 話： 03-6280-4580

E-mail： support@sys-tatsu.com

受付時間：10:00～19:00（土日祝日を除く）

システムトレードの達人

バックテスト機能(マルチモード) マニュアル

fiフェアトレード株式会社

発行人 西村 剛（にしむら つよし）

発行所 東京都中央区八丁堀4-11-3 金谷ビル3F

Email: info@fairtrade.co.jp

TEL: 03-3555-3260

FAX: 03-6280-4656