

システムトレード基礎講座

バックテストに必要なもの

バックテストに必要なもの

証券アナリストで、システムトレードに関するセミナー講師を担当しています、フェアトレード株式会社の西村剛（にしむらつよし）です。本講座では、ご覧頂いた皆さまが基礎から「システムトレード」を理解できるように、やさしい言葉とやさしい表現で解説していきます。ぜひ、最後までお付き合い頂ければと思います。今回のテーマは「バックテストに必要なもの」です。では、中身に入りましょう。

「システムトレードとは？」の講座では、システムトレードがどのような投資法であるのかを簡単にお話ししました。世の中には様々な投資法を実践されている方々がいらっしゃいます。これらの手法それぞれで、安定的に利益を上げている方も数多くいらっしゃることでしょう。私自身もシステムトレードだけが、絶対無敵の投資法だとは考えていません。

ただし、「過去のデータで有効性が認められている」という部分は、他の投資法にはない大きな強みではないでしょうか。

本講座の目的は、できるだけ多くの方にシステムトレードへの興味を持ってもらうということです。もしくは、まだシステムトレードを実践したことがない皆さんが、実際にシステムトレードを実践するようになれば、大変喜ばしいことだと思っています。もちろん、そのまますぐ使えるルール（手法）を聞けば、一時的に利益を得ることはできるかもしれませんが、しかし、他人のルールを真似ても、もし儲かったときには「なぜ儲かったのか」、逆に損をしたときには「なぜ損をしたのか」という根本的な原因をつかむことは難しくなります。

もし、その根本的な原因をつかむことができなければ、**長期間にわたって運用を続けていくのは精神的にも困難なのではないでしょうか。**

このような背景もあるので、最終的には是非とも皆さんに、ご自身の手でバックテスト（過去のデータを使った検証）を行っていただき、自分の作り上げたルールで自信を持ってトレードをしていただきたいと思います。

前置きが長くなりましたが、今回の本題に入ります。今回は、いざシステムトレードを始めようと思ったときに皆さんが考えるべき選択肢についてお話しします。

システムトレードというからには、**有効な売買ルールを見つけるために当然、過去の株価データ（株の場合）を使ってバックテスト（検証）を行う必要があります。**バックテストをするにあたり、理想はバックテストをするためのソフトを自分自身で作ってしまうことです。

ただし、プログラミング初級者の方がゼロからソフトを作るためのプログラムを勉強するのは大変な手間と時間がかかります。

そこで、妥協点としていくつかの現実的な選択肢をあげると下記の2つがあげられます。

1. Excel (エクセル) を使用する
2. 市販のソフトウェアを購入する

まず、「1. Excel (エクセル)」から、解説します。「1. Excel (エクセル)」高額なソフトウェアを購入する必要がないのがメリットです。つまり、導入コストが安いということです。

※エクセルを持っていない場合は別途、Microsoft Office などを購入する必要がありますが、比較的low価格で入手可能です

ただし、エクセルのもともとの機能はシステムトレード用ではなく、表計算ソフトですので、多少の関数などの勉強が必要になることが、デメリットとして、挙げられます。また、扱えるデータの量に限界がありますので、約4000銘柄もある株をすべて検証するのは非常に困難です。よって、「日経225先物 (miniも含む)」や「FX」などの単一または少数の商品を検証するのに向いているといえるでしょう。

ちなみにエクセルによる検証を学ぶには、こちらがお勧めです。

【自分で検証できるシステムトレーダーになろう！ 斉藤正章のシステムトレードアカデミー】

>> <http://www.fairtrade.co.jp/saitomasaaki/academy/>

次に「2. 市販のソフトウェア」を解説します。市販のソフトには、いくつかの種類があります。比較的有名なソフトウェアとしては、トレーディングテック社の「パイロン」等があります。価格帯ですが、いずれソフトウェアも十数万円と高額です。または、一括で購入するタイプではなく、月々の費用を支払って使用するタイプのソフトウェアもあります。

例えば、ひまわり証券の「トレードシグナル」というものがあります。(初月は無料でその後は月々約2万円です)

「トレードシグナル」の詳細はこちら <http://systemtrade225.com/himawari.html>

皆さんがトレードしたい商品によっても変わりますが、個人投資家としての中立的な評価をすれば、株のトレードなら「検証くん」、日経225先物や日経225miniのトレードなら「トレードシグナル」がおすすめです。

また、無料で使用できるソフトとして、トレーダーズ証券の「トレードスタジアム」というものもあります。しかし、こちらは日経225先物、日経225miniの専用ソフトであり、株のバックテストはできません。ただし、それなりに評価は高いようです。よって、まずはお金をかけずに日経225miniのシステムトレードを体験したいということであれば、選択肢としては良いかもしれません。

特に、トレードシグナルについてはシステムトレードという機能以外もあり、重宝されています

す。売買の発注まで完全自動化できる「自動売買機能」が搭載しています。日経 225mini のトレードでは非常に良いかもしれません。

これらのソフトはたしかに高額ではありますが、一度購入してしまえば月々の費用はわずかなデータの更新料だけです。また「トレードシグナル」については初月が無料なので、試しに使ってみるといいでしょう。また、日経 225 先物か、日経 225mini だけをトレードするのであれば、トレードシグナルの代わりにトレーダーズ証券の「トレードスタジアム」を使うのも選択肢の1つです。

これからシステムトレードを本格的に始める場合には、もちろん何らかのソフトを入手していただくのが理想なのです。しかし、高額なソフトを皆さんに購入していただくのは個人的に心苦しいということもあります。そこで、これらのソフトを購入しなくても、「システムトレードでどのようなことができるのか」、「具体的にどのようにしてルールを構築していくのか」など、私自身が皆さんへ検証結果をお見せする形で丁寧に解説していく予定です。他のテーマの講座で公開していますので、ぜひそちらもご覧になっていただければ幸いです。

フェアトレード株式会社

西村 剛

<著者プロフィール>



西村 剛 (にしむら つよし) 日本証券アナリスト検定会員

1997年国際投信委託株式会社(国際投信投資顧問株式会社)入社。国内株中小型株アナリスト兼ファンドマネージャーとして株式運用に携わる。年間200社程度の企業調査を行い、株式ファンドを運用。2005年独立し投資教育事業を行うフェアトレード株式会社設立 代表取締役就任。2009年初心者でもプロのトレーダーと同じ運用が出来るソフトウェア「システムトレードの達人」をリリース。

システムトレードでの運用を行う傍ら、日本経済新聞、ヤフーファイナンス、オールアバウト、ネットマネーなどのマスメディアで執筆を行う。現在もヤフーファイナンスにて「株式戦略マル秘レポート」を連載中。また、大阪証券取引所主催セミナーや名古屋証券取引所主催セミナーで講師も勤める。すでに2000名以上が購読する無料メールセミナー講師も行う。

著書：実戦 空売りトレード (明日香出版社)、大証 FX 入門 (明日香出版社)

本レポートについて、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）

システムトレード基礎講座 「バックテストに必要なもの」

 フェアトレード株式会社

2011年2月17日発行

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