



MT4

バックテストで優位性を図る



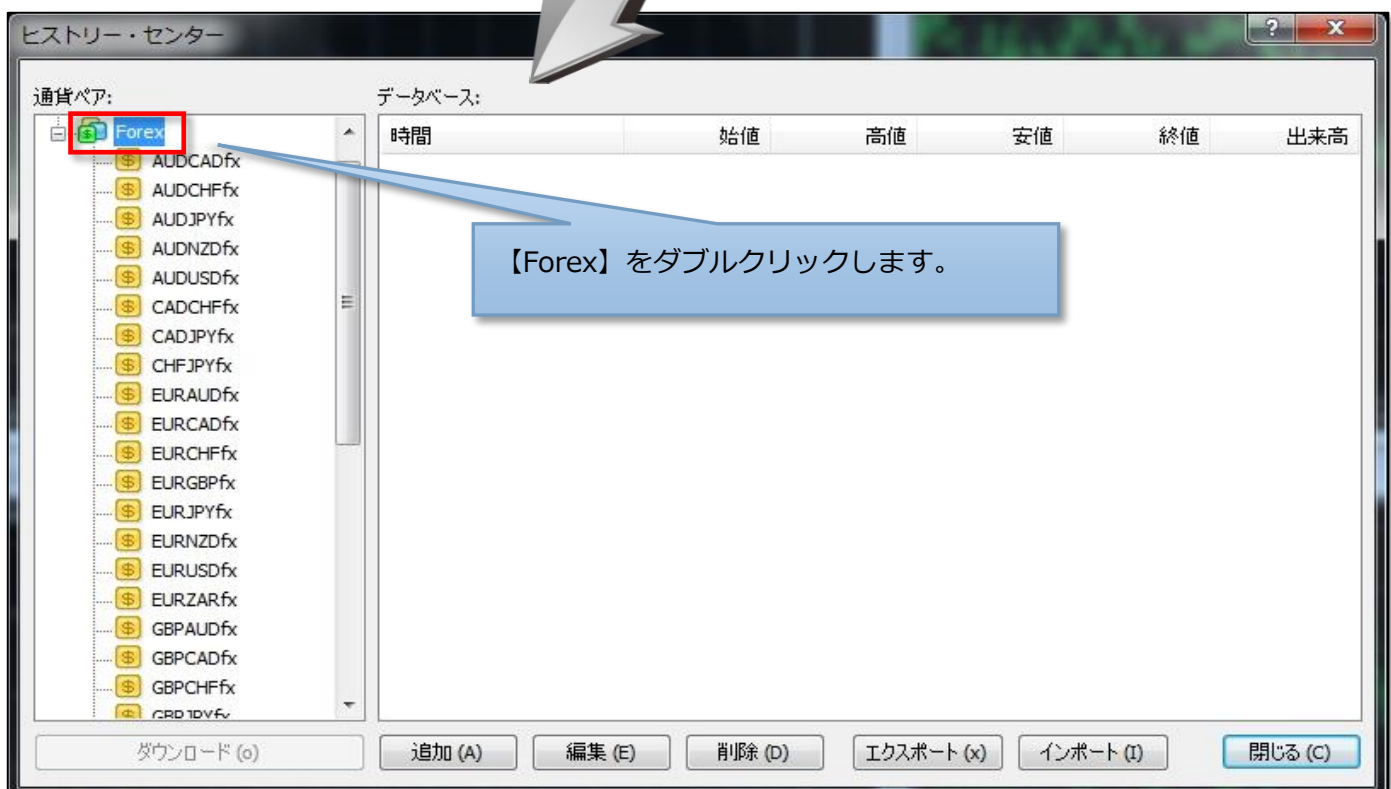
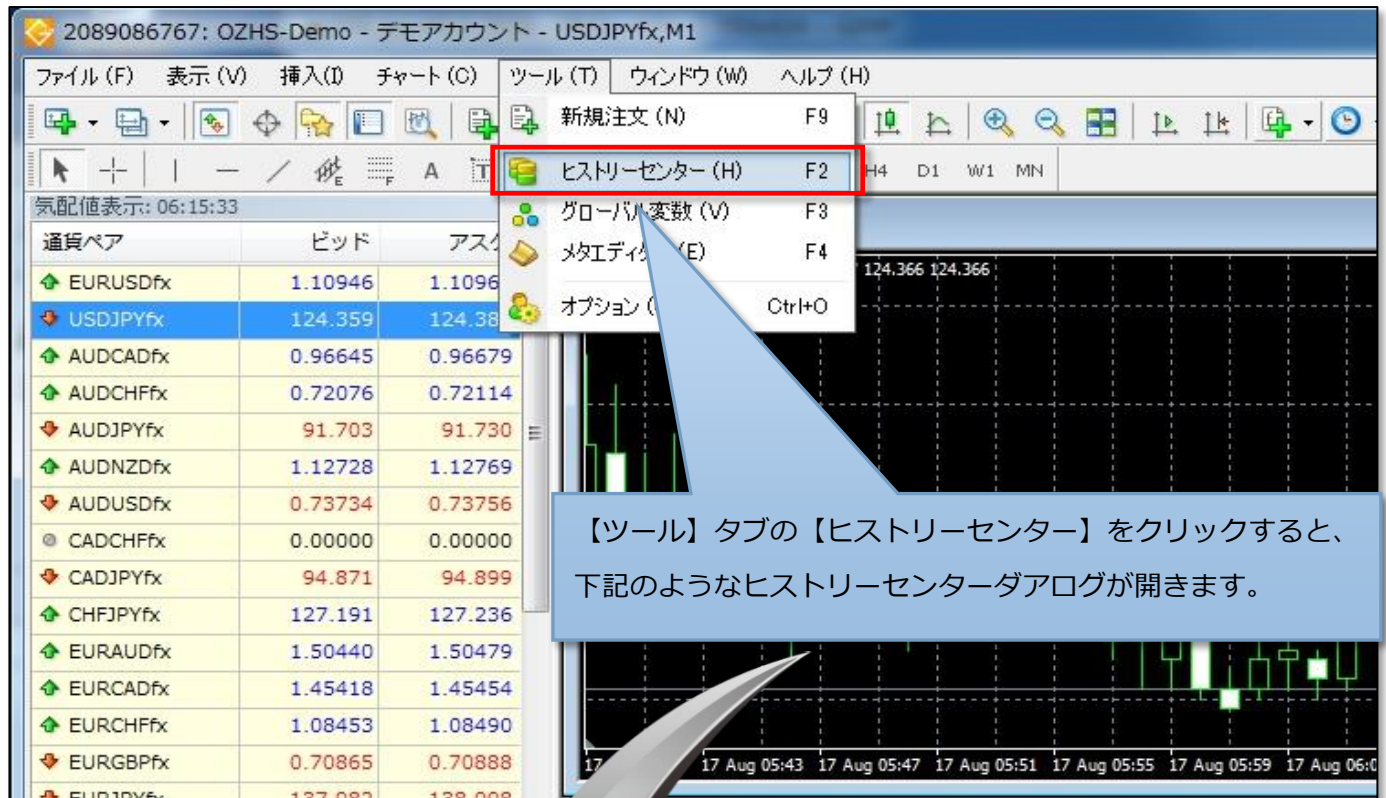
バックテストで優位性を図る

>>バックテストの準備とその方法<<

バックテストの前に、Meta Trader4 へ為替ヒストリカルデータを入れる必要があります。

バックテスト対象の時間軸データのみ入れても実行可能ですが、その結果の信憑性が損なわれます。

1 分足などタイムフレームの短いデータも出来るだけ入れると良いでしょう。



ヒストリー・センター: USDJPYfx,M1

通貨ペア: GBPCHFfx, GBPJPYfx, GBPNZDfx, GBPU\$Dfx, NZDJPYfx, NZDUSDfx, USDCADfx, USDCHFfx, USDCNHfx, USDHKDfx, **USDJPYfx**

データベース: 2259 レコード

バックテストしたい通貨ペアをダブルクリックして展開します。

時間軸別ヒストリーデータが開きます。

※より信憑性を高めるには、バックテストしたい時間軸以下の項目を全てダウンロードする必要があります。

1 Minute(M1), 5 Minutes(M5), 15Minutes(M15), 30 Minutes(M30), 1 Hour(H1), 4 Hours(H4), Daily(D1), Weekly(W), Monthly(MN)

ダウンロード (o) 追加 (A) 編集 (E) 削除 (D) エクスポート (x) インポート (I) 閉じる (C)

時間	始値	高値	安値	終値	出来高
2015.08.17 08:52	124.384	124.386	124.384	124.385	9
2015.08.17 08:51	124.385	124.385	124.380	124.383	23
2015.08.17 08:50	124.389	124.390	124.385	124.386	12
2015.08.17 08:49	124.389	124.391	124.387	124.390	12
2015.08.17 08:48	124.388	124.388	124.388	124.388	30
2015.08.17 08:47	124.388	124.388	124.388	124.388	24
2015.08.17 08:46	124.388	124.388	124.388	124.388	62
2015.08.17 08:45	124.388	124.388	124.388	124.388	44
2015.08.17 08:44	124.397	124.405	124.384	124.389	90
2015.08.17 08:43	124.389	124.394	124.385	124.392	45
2015.08.17 08:42	124.385	124.401	124.384	124.389	104
2015.08.17 08:41	124.375	124.385	124.374	124.384	23

ヒストリー・センター: USDJPYfx,M1

通貨ペア: NZDUSDfx, USDCADfx, USDCHFfx, USDCNHfx, USDHKDfx, **USDJPYfx**

ダウンロードをクリックすると以下のような警告が出ます。

ダウンロード警告

MetaQuotes Software Corp. ヒストリーセンターからデータをダウンロードしますが、あなたの口座は "Lion Sight Treasury Limited" トレードサーバに開設されています。

ダウンロードされたヒストリーデータは、トレードサーバに保存されたデータとは違います。そのため、これらのデータは、"Lion Sight Treasury Limited" の過去の価格と合致しません。それでも続ける場合はOKを押して下さい。

OK キャンセル

ダウンロード (o) 追加 (A) 削除 (D) エクスポート (x) インポート (I) **閉じる (C)**

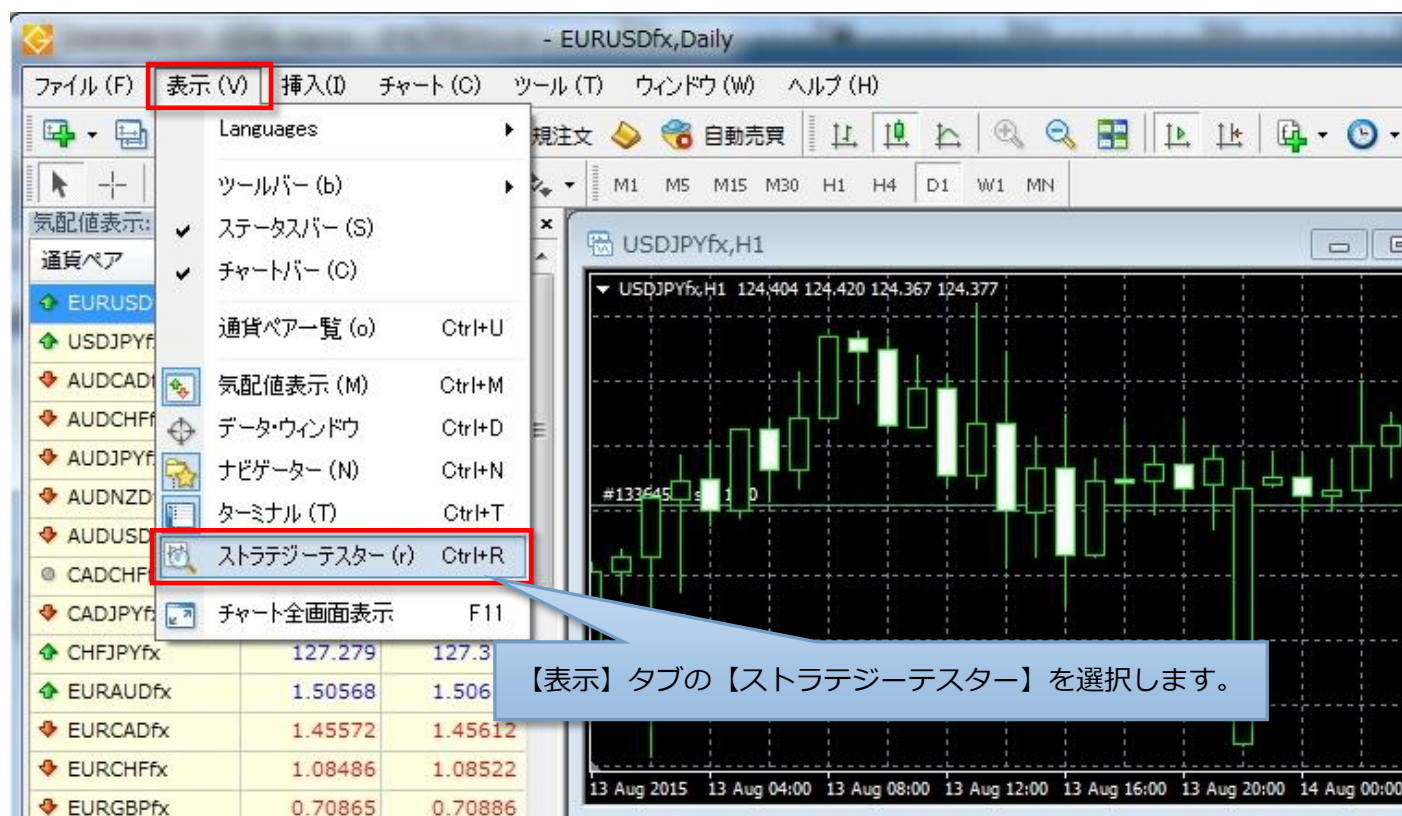
時間	始値	高値	安値	終値	出来高
2015.08.17 07:01	124.414	124.416	124.404	124.404	57
2015.08.17 07:00	124.404	124.420	124.399	124.412	73
2015.08.17 06:59	124.411	124.414	124.403	124.405	41
2015.08.17 06:58	124.407	124.412	124.406	124.410	28
2015.08.17 06:57	124.406	124.406	124.406	124.406	62
2015.08.17 06:56	124.400	124.400	124.400	124.400	41
2015.08.17 06:55	124.397	124.397	124.397	124.397	27
2015.08.17 06:54	124.385	124.385	124.385	124.385	9
2015.08.17 06:53	124.383	124.383	124.383	124.383	23
2015.08.17 06:52	124.386	124.386	124.386	124.386	12
2015.08.17 06:51	124.390	124.390	124.390	124.390	12
2015.08.17 06:50	124.390	124.390	124.390	124.390	30
2015.08.17 06:49	124.398	124.398	124.398	124.398	24
2015.08.17 06:48	124.398	124.398	124.398	124.398	62
2015.08.17 06:47	124.398	124.398	124.398	124.398	62
2015.08.17 06:46	124.392	124.392	124.392	124.392	44
2015.08.17 06:45	124.390	124.390	124.390	124.390	38
2015.08.17 06:44	124.390	124.390	124.390	124.390	67

【OK】をクリックするとダウンロードが始まります。
初めてダウンロードする時は、数分かかる場合がございます。
ダウンロード完了まで暫くお待ち下さい。

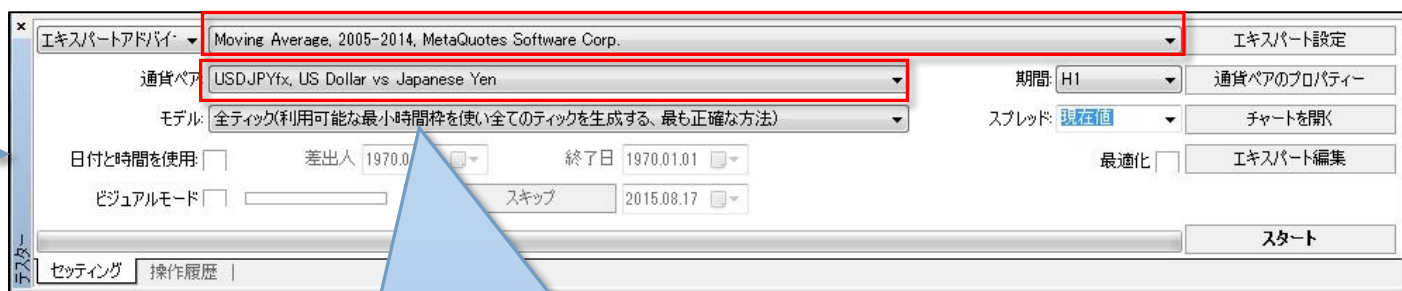
必要なデータを全てダウンロードしたら【閉じる】をクリックします。

次にダウンロードしたデータを使ってバックテストを実行します。

※バックテストしたいシステムプログラムが MT4 内に無い場合は実行できません



ターミナルウィンドウの下に【テスター】ウィンドウが開きます。



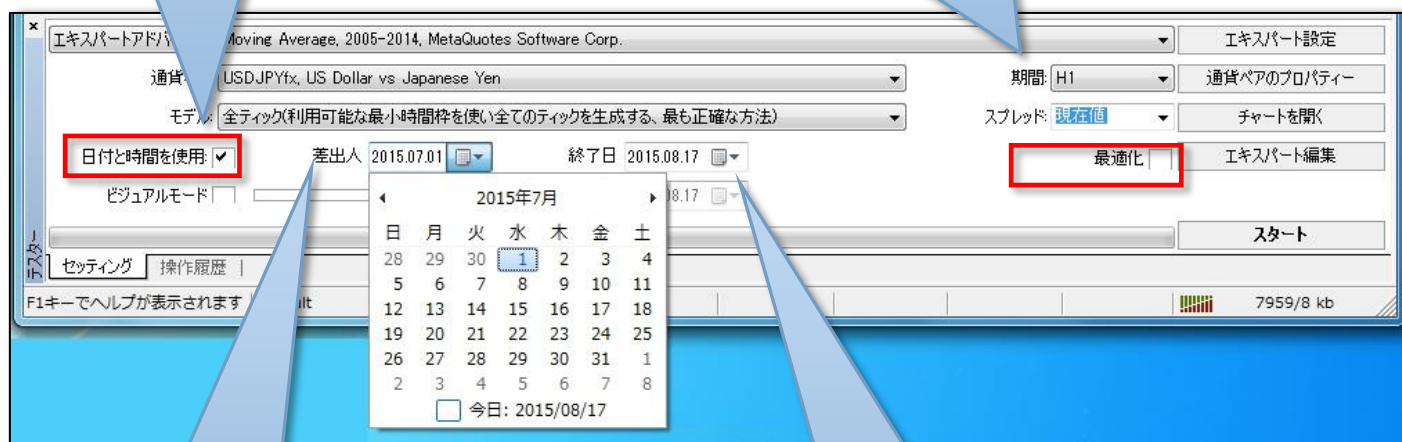
【エキスパートアドバイザー】コンボボックスを選択します。

MT4 内のシステムプログラム名がリスト表示されます。

【通貨ペア】ヒストリーデータをダウンロードした通貨ペアを選択します。

【日付と時間を使用】にチェックを入れます。

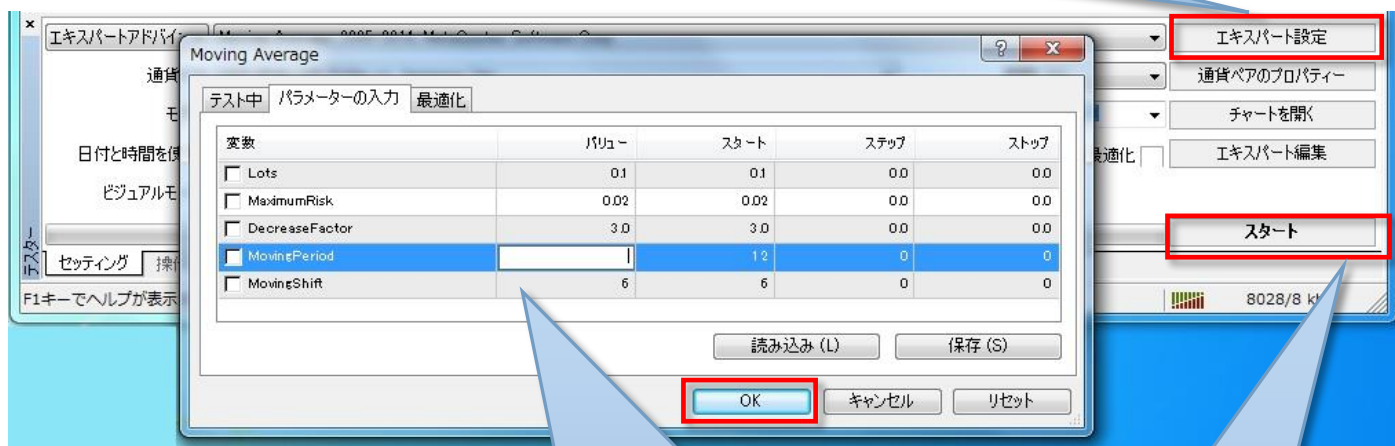
時間軸を変更したい場合は【期間】で変更します。



バックテスト開始日を選択します。

バックテスト終了日を選択します。

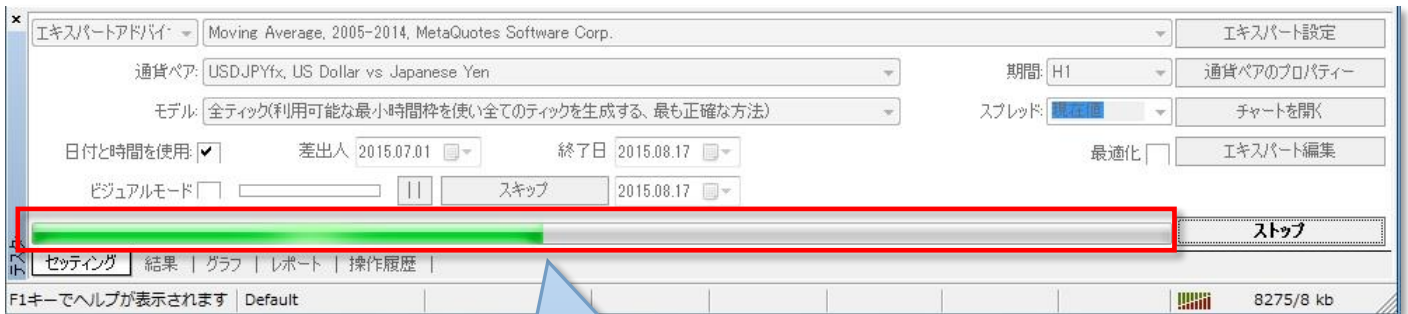
システムパラメーターが存在し、任意で設定したい場合は、
【エキスパート設定】をクリックします。



パラメーターを任意で変更して、【OK】ボタンをクリックします。

全ての設定が終わったら【スタート】ボタンをクリックします。

バックテストの完了まで数十秒かかります。期間によっては数分かかります。



バーの色が全て変わったらテスト完了です。



資産曲線を確認する場合は【グラフ】タブをクリックします。
バックテストしたシステムで運用した場合の資産曲線が表示されます。

テストバー数	1027	モデルティック数	2815621	モデリング品質	42.69%
不整合チャートエラー	0				
初期証拠金	10000.00			スプレッド	現在値 (19)
総損益	251.15	総利益	675.30	総損失	-424.15
プロフィットファクター	1.59	期待利得			
絶対ドロウダウン	14.12	最大ドロウダウン			2.98% (315.04)
総取引数	35	ショートポジション(勝率%)			16 (43.75%)
		勝率(%)	11 (31.43%)	負率 (%)	24 (68.57%)

パフォーマンスレベルを確認する場合は【レポート】タブをクリックします。
各項目パフォーマンスが表示されています。

パフォーマンスレポートを保存するには、テスター画面内で右クリックし、【レポートの保存】を選択してデスクトップに保存してください。

※パフォーマンスレポートの解説については、「パフォーマンスレポートの見方」を御覧ください。