



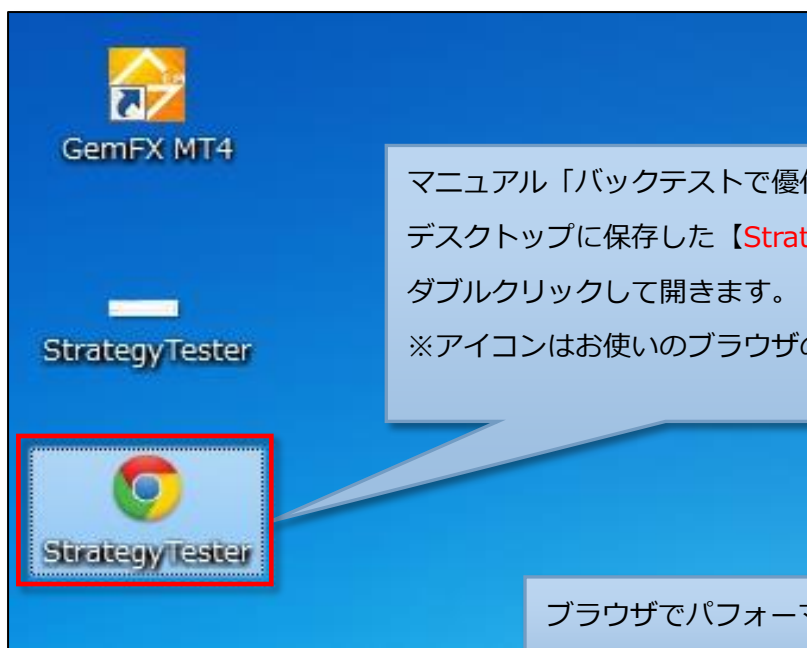
MT4

パフォーマンスレポートの見方



パフォーマンスレポートの見方

>> パフォーマンスレポートの見方 <<



マニュアル「バックテストで優位性を図る」で
デスクトップに保存した【Strategy Tester】を
ダブルクリックして開きます。

※アイコンはお使いのブラウザの物となります。

ブラウザでパフォーマンスレポートが開きます。

テストした通貨ペアシンボル名

Strategy Tester Report

テストしたシステム名

Moving Average
OZHS-Demo (Build 840)

通貨ペア	USDJPYfx (US Dollar vs Japanese Yen)
期間	1時間足 (H1) 2015.07.01 00:00 - 2015.08.16 23:00 (2015.07.01 - 2015.08.16)
モデル	全ティック (利用可能な最小時間枠による最も正確な方法)
パラメーター	Lots=0.1; MaximumRisk=0.02; DecreaseFactor=3; MovingPeriod=12; MovingShift=6;

テスト時間軸と検証期間

Tickレベルでの検証

テストバー数	1027	モデルティック数	2815621	モデリング品質	74.099%
不整合チャートエラー					
初期証拠金	スプレッド				
総損益	現在値 (22)				
プロフィットファクター	1.55	期待利得	6.80	総損失	-432.86
絶対ドローダウン	14.61	最大ドローダウン	322.28 (3.05%)	相対ドローダウン	3.05% (322.28)
総取引数	35	ショートポジション(勝率%)	19 (21.05%)	ロングポジション(勝率%)	16 (43.75%)
		勝率(%)	11 (31.43%)	負率(%)	24 (68.57%)
		最大 勝トレード	307.77	負トレード	-59.77
		平均 勝トレード	60.99	負トレード	-18.04
		最大 連勝(金額)	3 (114.83)	連敗(金額)	11 (-216.07)
		最大化 連勝(トレード数)	389.61 (2)	連敗(トレード数)	-216.07 (11)
		平均 連勝	2	連敗	3

検証に設定した各パラメータ値



#	時間	取引種別	注文番号	数量	価格	S / L	T/P決済指値	損益	残高
1	2015.07.02 14:00	sell	1	0.20	123.108	0.000	0.000		
2	2015.07.03 06:00	close	1	0.20	123.108	0.000	0.000	0.00	10000.00
3	2015.07.03 10:00	sell	2	0.20	123.040	0.000	0.000		
4	2015.07.06 08:00	close	2	0.20	122.659	0.000	0.000	62.12	10062.12
5	2015.07.06 10:00	sell	3	0.20	122.569	0.000	0.000		
6	2015.07.07 01:00	close	3	0.20	122.686	0.000	0.000	-19.07	10043.05

Strategy Tester Report

Moving Average

このライン以下にバックテストパフォーマンス詳細が表記されます。

テスト開始時の口座資金

1時間足 (H1) 2015.07.02 14:00 - 2015.07.03 00:00 (2015.07.01 - 2015.08.17)	
全ティック (利用可能) 最も正確な方法)	
Lots=0.1; MaxOrderLots=10; DecreaseFactor=3; MovingPeriod=12; MovingShift=6;	
テスト回数 1027 モデルタイプ	2815621 モデリング品質 42.69%
不適合エラー	

初期証拠金	10000.00								
総損益	238.06	総利益	670.92	総損失	-432.86				
プロフィットファクター	1.55	期待利得	6.80						
絶対ドローダウン	14.61	最大ドローダウン	322.28 (3.05%)	相対ドローダウン	3.05% (322.28)				
総取引数	35	ショートポジション(勝率%)	19 (21.05%)	ロングポジション(勝率%)	16 (43.75%)				

- プロフィットファクターとは -

■ 数値を算出する数式 (総利益 ÷ 総損失)
で表され、数値が1を切っている場合はバックテストの結果、
資産が減っている事になります。
一般的に良いとされている数値は1.5～2.5と云われており、
それ以上の数値は最良であると言えるでしょう。

#	時間	価格	注文	数量	損益	手数料	税金	残高
1	2015.07.02 14:00	sell	1	0.20	123.108	0.000	0.000	
2	2015.07.03 06:00	close	1	0.20	123.108	0.000	0.000	10000.00
3	2015.07.03 10:00	sell	2	0.20	123.040	0.000	0.000	
4	2015.07.06 08:00	close	2	0.20	122.659	0.000	0.000	10062.12
5	2015.07.06 10:00	sell	3	0.20	122.569	0.000	0.000	
6	2015.07.07 01:00	close	3	0.20	122.686	0.000	0.000	10043.05

総トレード回数

総取引数	35	ショートポジション(勝率%)	19 (21.05%)	ロングポジション(勝率%)	16 (43.75%)
勝率 (%)		11 (31.43%)	負率 (%)	24 (68.57%)	
最大 勝トレード		307.77	負トレード	-59.77	
平均 勝トレード		60.99	負トレード	-18.04	
最大 連勝(金額)		3 (114.83)	連敗(金額)	11 (-216.07)	
最大化 連勝(トレード数)		389.61 (2)	連敗(トレード数)	-216.07 (11)	
平均 連勝		2	連敗	3	

- 総トレード回数について -

検証期間内でのトレード回数を表します。

バックテスト結果は将来のシステムパフォーマンスを保証するものではありません。
しかしながら、このトレード回数が多ければ多いほど、大数の法則により信憑性が高くなります。
検証する期間にも左右されますが、得られた結果の信憑性を図る意味では
少なくとも100回以上のトレードがあると良いでしょう。

Strategy Tester Report

Moving Average

OZHS-Demo (Build 840)

テスト品質

90%が最高値です。バックテストに使用したヒストリカルデータにエラーが多い場合は数値が低くなります。その場合、もう一度ダウンロードしてみてください。

23:00 (2015.07.01 - 2015.08.17)

正確な方法)

Color=3; MovingPeriod=12; MovingShift=6;

2815621 モデリング品質

42.69%

純利益

純損失

238.06	総利益	670.92	総損失	-432.86
1.55	期待利得	6.80		
14.61	最大ドローダウン	322.28 (3.05%)	過去最大ドローダウン	322.28)
35	ショートポジション(勝率%)	19 (21.05%)	ロングポジション(勝率%)	16 (43.75%)
	勝率 (%)	11 (31.43%)	負率 (%)	24 (68.57%)
	最大 勝トレード	307.77	負トレード	-59.77
	ショートエントリー回数 (ショートのみの勝率)	0.99	ロングエントリー回数 (ロングのみの勝率)	
	最大 連勝(金額)	3 (114.83)	連敗(金額)	11 (-216.07)
	最大化 連勝(トレード数)	389.61 (2)	連敗(トレード数)	-216.07 (11)
	平均 連勝	2	連敗	3

- 過去最大ドローダウンについて -

検証期間内で最も大きな資産減少幅の金額を表します。

最大ドローダウンはどのシステムにも必ず存在し、勝率などその他の項目とは無関係に訪れます。

この数値の主な使い方として、実運用における取引量の設定や、

システムの調子が悪くなった際の運用停止判断の見極めに使います。

口座資金全体の20%程が、過去最大のドローダウン金額になるように取引量を設定すれば

ローリスクの運用となるでしょう。実運用当初はあまり無理をしない運用を心がけましょう。

また、実運用の成績が思わしくない場合、バックテストで得られた過去最大ドローダウンを更新してしまっていないかも調べましょう。更新している場合、一度運用を停止するのも一つの手です。

238.06	総利益	670.92	総損失	-432.86
1.55	期待利得	6.80		
14.61	最大ドローダウン	322.28 (3.05%)	過去最大ドローダウン	322.28)
35	ショートポジション(勝率%)	19 (21.05%)	ロングポジション(勝率%)	16 (43.75%)
	勝率 (%)	11 (31.43%)	負率 (%)	24 (68.57%)
	最大 勝トレード	307.77	負トレード	-59.77
	平均 勝トレード	60.99	負トレード	-18.04
	最大 連勝(金額)	3 (114.83)	連敗(金額)	11 (-216.07)
	最大化 連勝	1 トレード最大利益	連敗(トレード数)	16.07 (11)
	平均 連勝	2	連敗	3

勝ちトレード回数 (勝率)

負けトレード回数 (負け率)

1 トレード最大利益

1 トレード最大損失

238.06 総利益	670.92 総損失	-432.86
1.55 期待利得	6.80	
勝ちトレード平均利益	322.28 (3.05%) 相対ドローダウン	負けトレード平均損失 (28)
35 ショートポジション 勝率 (%)	19 (21.05%) ロングポジション(勝率 %)	(43.75%)
勝率 (%)	11 (31.43%) 負率 (%)	24 (68.57%)
最大 勝ちトレード	307.77 負けトレード	-59.77
平均 勝ちトレード	60.99 負けトレード	-18.04
最大 連勝(金額)	3 (114.83) 連敗(金額)	11 (-216.07)
最大化 連勝(トレード数)	389.61 (2) 連敗(トレード数)	-216.07 (11)
平均 連勝	2 連敗	3

- 損益レシオの算出 -

■ 損益レシオを算出する数式 (勝ちトレード平均利益 ÷ 負けトレード平均損失)

損益レシオはシステムの能力を知る上で重要な項目の一つです。

数値が1を切ると、平均的に勝つ金額よりも負ける金額が上回っている事になります。一般的に良いと云われている数値は1.5～ですが、1を割っていなければ勝つ金額の方が大きくなる期待が持てます。また、損益レシオは勝率に反比例する性質を持ち、勝率の高いシステムほど損益レシオが低くなる傾向にあります。したがって「平均利益 < 平均損失」の性質を勝率がカバーし、結果的に利益を伸ばす場合もあるため数値が低くとも全体を見る必要があります。

目安として勝率が50%以上であり損益レシオが1以上であれば
実運用において利益を出す可能性があるといえるでしょう。

238.06 総利益	670.92 総損失	-432.86
1.55 期待利得	6.80	
14.61 最大ドローダウン	322.28 (3.05%) 相対ドローダウン	3.05% (322.28)
35 ショートポジション 勝率 (%)	19 (21.05%) ロングポジション(勝率 %)	(43.75%)
勝率 (%)	11 (31.43%) 負率 (%)	24 (68.57%)
最大 勝ちトレード	307.77 負けトレード	-59.77
平均 勝ちトレード	60.99 負けトレード	-18.04
最大 連勝(金額)	3 (114.83) 連敗(金額)	11 (-216.07)
最大化 連勝(トレード数)	389.61 (2) 連敗(トレード数)	-216.07 (11)
平均 連勝	2 連敗	3

平均連勝数

平均連敗数

資産曲線



#	時間	取引種別	注文番号	数量	価格	S / L	T/P:決済指値	損益	残高
1	2015.07.02 14:00	sell	1	0.20	123.108	0.000	0.000		
2	2015.07.03 06:00	close	1	0.20	123.108	0.000	0.000	0.00	10000.00
3	2015.07.03 10:00	sell	2	0.20	123.040	0.000	0.000		
4	2015.07.06 08:00	close	2	0.20	122.659	0.000	0.000	62.12	10062.12
5	2015.07.06 10:00	sell	3	0.20	122.569	0.000	0.000		
6	2015.07.07 01:00	close	3	0.20	122.686	0.000	0.000	-19.07	10043.05
7	2015.07.07 11:00	sell	4	0.20	122.548	0.000	0.000		
8	2015.07.07 21:00	close	4	0.20	122.548	0.000	0.000	-13.05	10030.00
9	2015.07.07 23:00	close	5	0.10	122.510	0.000	0.000		
10	2015.07.08 00:00	close	5	0.10	122.510	0.000	0.000	-4.98	10025.02
11	2015.07.08 02:00	sell	6	0.10	122.330	0.000	0.000		
12	2015.07.09 18:00	close	6	0.10	121.337	0.000	0.000	81.84	10106.86
13	2015.07.09 19:00	buy	7	0.20	121.375	0.000	0.000		
14	2015.07.14 07:00	close	7	0.20	123.272	0.000	0.000	307.77	10414.63
15	2015.07.14 22:00	buy	8	0.20	123.403	0.000	0.000		
16	2015.07.15 00:00	close	8	0.20	123.339	0.000	0.000	-10.38	10404.25
17	2015.07.15 03:00	buy	9	0.20	123.431	0.000	0.000		

検証期間トレードリスト

パフォーマンスレポートの見方は以上です。

バックテスト結果は未来のトレード結果を保証するものではありませんが、
この結果が良いほど未来において利益を出す可能性は高くなるといえるでしょう。