

2. 売買シミュレーション

売買条件に基づいた模擬取引が表示されます。

1. 売買シミュレーションの表示

ペアグラフの「売買シミュレーション」にチェックを付けると、売買シミュレーションの結果が表示されます。



期間は、通常最新の日付から過去 1 年間になっています。

- 開始時期・・・1 年前の今日
- 終了時期・・・今日

※期間は、任意で変更することも可能です。変更した場合は「グラフ更新」をクリックしてください。

2. 取引マーク(ペアグラフ)

売買条件に基づいた、取引マークが表示されます。取引マークは仕掛けと手仕舞いで色が変わります。

- 赤マーク・・・仕掛け位置を示しています。
- 緑マーク・・・手仕舞い位置を示しています。

取引マークの初期設定

▼仕掛けマーク

サヤチャートのサヤボリンジャーバンド 1.5σ (ピンク色の線)の外に出たら表示されます。

▼手仕舞いマーク

利食い・・・予定利益の 80%のプラスで表示されます。

損切り・・・予定利益の 80%のマイナスで表示されます。

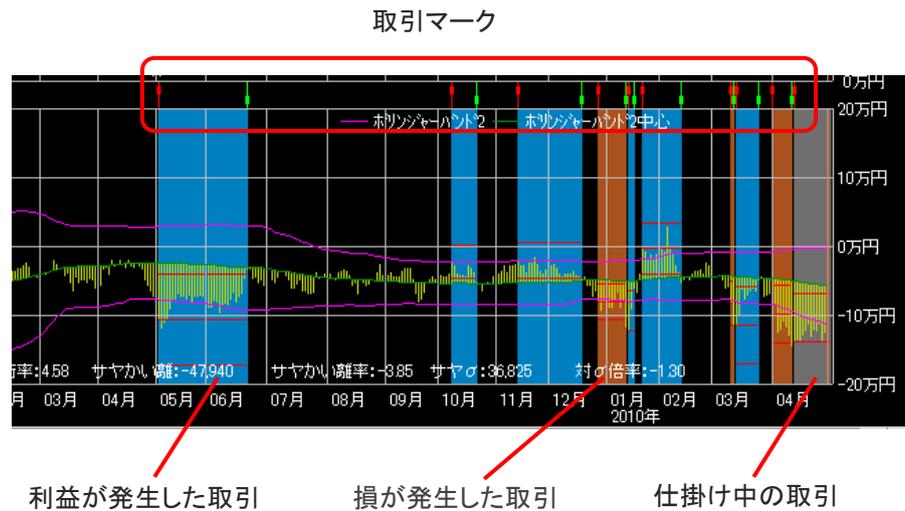
手仕舞い期限(無条件で手仕舞いする期限)・・・仕掛け日から 30 日で表示されます。

過去分の取引マークは、終値に対して発生します。

当日分の取引マークは、取引時間中は、リアルタイムで更新されています。

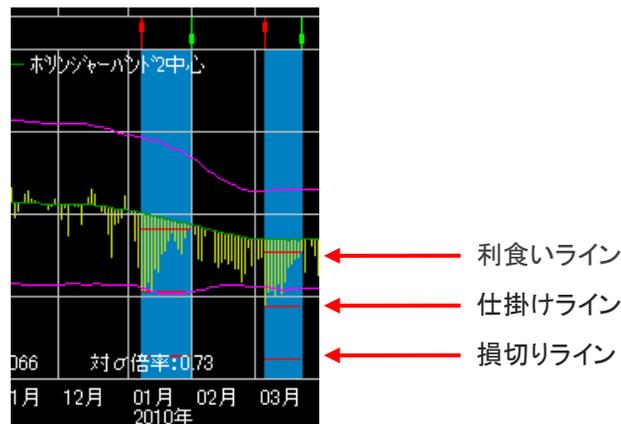
取引マークの下の着色部分は、仕掛けから手仕舞いまでの期間を示しています。損益の区別によって色が変わります。

- 青色・・・利益が発生した場合を示します。
- オレンジ色・・・損が発生した場合を示します。
- 灰色・・・仕掛け途中で手仕舞いしていない場合を示します。



3. 仕掛けライン・利食いライン・損切りライン

仕掛けマークに対して、下記のラインが表示されます。



- 仕掛けライン・・・仕掛けマークが発生した時点のサヤの値でラインが引かれます。
- 利食いライン・・・利食いによる手仕舞いマークが発生するサヤの値でラインが引かれます。
- 損切りライン・・・損切りによる手仕舞いマークが発生するサヤの値でラインが引かれます。

サヤが利食いラインに達すると、利食いによる手仕舞いマークが表示されます。サヤが損切りラインに達すると、損切りによる手仕舞いマークが表示されます。

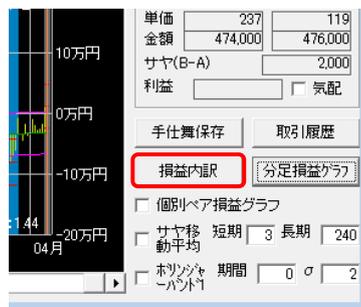
現在、サヤがどの位置に位置しているかを把握することができます。仕掛けマークがサヤの山で発生した場合とサヤの谷で発生した場合で利食いラインと損切りラインの上下位置が変わります。

※利食いラインと損切りラインの位置は「売買条件詳細設定」画面で設定した値(予定利益に対する割合)によって変わります。

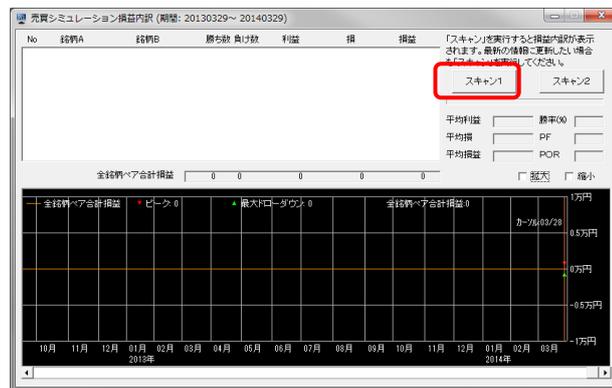
4. 売買シミュレーション損益内訳(スキャン 1)

銘柄ペアリストに登録されている全ペアを、売買シミュレーションして、各ペアの損益情報や全ペアの合計損益情報を表示します。

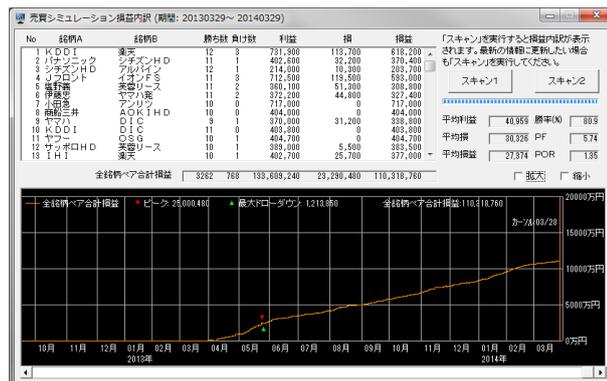
「損益内訳」ボタンをクリックすると「売買シミュレーション損益内訳」画面が表示されます。



情報を表示するには「スキャン 1」をクリックしてください。



銘柄ペアに対し順番に売買シミュレーションが実行されます。



期間内における、取引マーク通り運用したと仮定した場合の、各銘柄ペアの損益と全銘柄ペアの合計損益が表示されます。各損益は仕掛け中の評価損益も含んでいます。

- ・各銘柄ペアの勝ち数、負け数、利益、損、損益
- ・全銘柄ペアの合計の勝ち数、負け数、利益、損、損益
- ・全銘柄ペアの利益平均、損平均、損益平均
- ・全銘柄ペアの合計の勝率とPF、POR

PF(プロフィットファクター): 合計利益を合計損で割った値です。1.0を超えていれば利益が発生していることになります。

POR(ペイオフレシオ): 平均利益を平均損で割った値です。1.0以上が望ましいですが、1.0未満でも勝率が高ければ利益になります。

この画面で、銘柄ペアを選択するとペアグラフ画面も同じ表示になります。

「売買シミュレーション損益内訳」に表示されている情報は、自動更新はされません。最新の情報をみたい場合は再度「スキャン1」を実行してください。

5. 取引マーク (ペアリスト)

売買シミュレーションが実行されると、銘柄ペアリストに取引マークが表示されます。仕掛けと手仕舞いは色分けされています。

- 赤色・・・仕掛けマーク
- 黄色・・・仕掛け中心マーク
- 青色・・・手仕舞いマーク

No.	[A]市	[A]コード	[A]銘柄	[A]単価	[A]株数	[A]仕	[B]市	[B]コード	[B]銘柄	[B]単価
31	東1	6762	TDK	0	100	東1	6676	丸紅	0	0
32	東1	8002	丸紅	0	1,000	東1	8069	三菱商事	0	0
33	東1	8404	みずほ信	0	5,000	東2	8585	オリエント	0	0
34	東1	8815	東急不	0	1,000	東1	8804	東建物	0	0
35	東1	6301	コマツ	0	300	東1	6471	日本精工	0	0
36	東1	4324	電通	0	200	東1	4265	日ゼン	0	0
37	東1	7201	日産自	0	600	東1	7230	日信工業	0	0
38	東1	7201	日産自	0	600	東1	7296	FCC	0	0
39	東1	6703	CKI	0	6,000	東1	6791	コムエナジー	0	0
40	東1	6479	ミネベア	0	1,000	東1	6481	THK	0	0
41	東1	6301	コマツ	0	300	東1	6448	フザー	0	0
42	東1	7270	富士重	0	1,000	東1	7272	ヤマハ発	0	0
43	東1	6367	ダイデン	0	100	東1	6361	コマツ	0	0
44	東1	4061	電化	0	1,000	東1	4217	日立化成	0	0
45	東1	9532	六ガス	0	2,000	東1	9502	中部電力	0	0
46	東1	8233	高島屋	0	1,000	東1	8267	イオン	0	0
47	東1	5411	JFEHD	0	100	東1	5444	大和工	0	0
48	東1	6471	日精工	0	1,000	東1	6363	西島製	0	0
49	東1	6366	千代達	0	1,000	東1	6302	住友重	0	0
50	東1	7267	ホンダ	0	200	東1	7230	日信工業	0	0

銘柄ペアリストの取引マークは、「スキャン1」を実行した場合に更新されます。また、「スキャン1」実行時以外は、銘柄ペアをカーソルで指定した場合に更新されます。

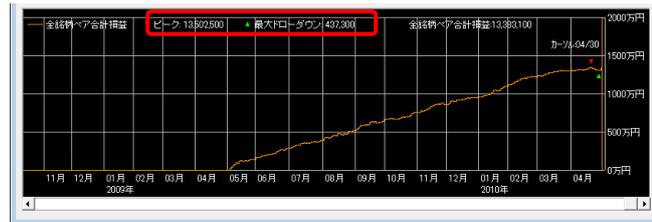
銘柄ペアリストを右方向へスクロールすると、銘柄ペアの勝敗と損益等が表示されます。

No.	[A]市	[A]コード	[A]銘柄	[A]単価	[A]株数	[A]仕	[B]市	[B]コード	[B]銘柄	[B]単価
31	東1	6762	TDK	0	100	東1	6676	丸紅	0	0
32	東1	8002	丸紅	0	1,000	東1	8069	三菱商事	0	0
33	東1	8404	みずほ信	0	5,000	東2	8585	オリエント	0	0
34	東1	8815	東急不	0	1,000	東1	8804	東建物	0	0
35	東1	6301	コマツ	0	300	東1	6471	日本精工	0	0
36	東1	4324	電通	0	200	東1	4265	日ゼン	0	0
37	東1	7201	日産自	0	600	東1	7230	日信工業	0	0
38	東1	7201	日産自	0	600	東1	7296	FCC	0	0
39	東1	6703	CKI	0	6,000	東1	6791	コムエナジー	0	0
40	東1	6479	ミネベア	0	1,000	東1	6481	THK	0	0
41	東1	6301	コマツ	0	300	東1	6448	フザー	0	0
42	東1	7270	富士重	0	1,000	東1	7272	ヤマハ発	0	0
43	東1	6367	ダイデン	0	100	東1	6361	コマツ	0	0
44	東1	4061	電化	0	1,000	東1	4217	日立化成	0	0
45	東1	9532	六ガス	0	2,000	東1	9502	中部電力	0	0
46	東1	8233	高島屋	0	1,000	東1	8267	イオン	0	0
47	東1	5411	JFEHD	0	100	東1	5444	大和工	0	0
48	東1	6471	日精工	0	1,000	東1	6363	西島製	0	0
49	東1	6366	千代達	0	1,000	東1	6302	住友重	0	0
50	東1	7267	ホンダ	0	200	東1	7230	日信工業	0	0

[各項目説明]

- 勝数・・・利益が発生した取引の回数を示しています。
 - 負数・・・損が発生した取引の回数を示しています。
 - 利益・・・勝った取引の利益の合計金額を示しています
 - 損・・・負けた取引の損の合計金額を示しています。
 - 損益・・・利益から損を引いた合計金額を示しています。
- その他の項目はサヤチャート内に表示される項目と同じです。

全銘柄ペアの損益グラフに最大ドローダウンが表示されます。



損益グラフにおいて利益の落ち込みが発生した時、それまでの最大値(ピーク値)からの減少幅をドローダウンといいます。シミュレーション期間中に、発生したドローダウンの中で最も大きいドローダウンが最大ドローダウンです。

グラフにはピーク値と最大ドローダウンのそれぞれの数値(金額)とグラフ上の位置が表示されます。ピーク値は最大ドローダウン発生以前における利益の最大値です。(シミュレーションの全期間中の最大値ではありません。)

資産運用において勝ち続けるということは無理なので、ある程度のドローダウンは避けられません。最大ドローダウンが大きいと、心理的負担が大きくと同時に運用資金の減少により運用を中止せざるを得なくなる場合があります。逆に最大ドローダウンが小さければ心理的負担が小さく安心して運用を続けることができます。最大ドローダウンは、小さければ小さいほど良い訳です。シミュレーションによって表示された過去の最大ドローダウンは、将来発生するであろうドローダウンの目安となるでしょう。

直近のデータを利用して銘柄ペアリストを作成した場合、過去のシミュレーション結果はカンニングの効果で、本来より良い結果を示しますのでご注意ください。

[ご注意]

売買シミュレーションは、一定金額以上サヤが開いたら仕掛け、サヤが閉じたら手仕舞うという取引方法で、過去の取引回数等を調べるものです。システムトレードのロジックとは異なり、サヤ取りに適した、ペアの選定を行うためのものです。

◎チュートリアル

2. 売買シミュレーション

<http://youtu.be/8p1jIDHcVZ4>