

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

と手仕舞いで色が変わります。

➢ 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
 - 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 1.5 σ (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。



取引マーク

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。

NU	銘柄A	i	诸柄B	J	防鉄 負	け数	利益		損		損益		「スキャン	」を実行	すると	與益内副	び表示
1 3 4 5 6 7 8 9 10 11 12 13	KパシJ塩伊小商ヤKヤサ」 リンズンジ 新築田船マロファイ リンズンジ 新築 第二 サレ レー レー レー レー レー レー レー レー レー レー レー レー レー	楽シアイ美ヤアADDD芙楽天手ルオロマン〇IIS留天	ズパンリハリKCCGリ スパンリハリKCCGリ ス		2 3 1 2 1 2 1 1 1 2 1 2 1 2 1 2 1 2 1 2 1 2		731,900 402,600 214,000 712,500 360,100 372,200 404,000 370,000 403,800 403,800 404,700 389,000 402,700		113,700 32,200 10,300 51,300 44,800 31,200 5,500 25,700		618,200 370,400 203,700 593,000 308,800 308,800 404,000 404,000 404,000 404,700 388,800 404,700 383,500 377,000	÷	されます。 も「スキャ スキ 平均利益 平均損益	最新の ×ン1 	(情報)に 行してく 40,959 30,326 27,374	更新した ださい。 スパ 勝率(X) PF POR	に1場合 ドャン2 1 80 「5.1 「1.2
		全銘柄ペア	合計捐益	326	2 766	133,	609,240) 23,	290,480	110	318,760				□ \$	因	□ 縮小 - 20000
	全銘柄ペア合	计损益	• ビーク :	5,000,48	•	最大下口	ーダウン	≿ 1,213,8	50	3	法名柄べ7	~슴計	捐益:110.:	18,760		00 /00	20000)
╈															10-78	x 0 07 20	150007
																	100007
+																	
																	5000-1
+									~								500075

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

POR(ハイオ フレシオ):平均利益を平均損で割つに値です。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・・・仕掛け中マーク
- 青色・・・手仕舞いマーク

アイ	(F)	-1-	サー設定(U)	諸柄ペア作	⊧bx(P) :	元與別	₹1+(J)	25	ッノ表示(G) //i) (н)
No.	[A]市	AD-F.	[A]銘柄	[A]単価	[A]株数	A住	[B]市	B3-h'	[B]銘柄	[B]単
31	東1	6762	TDK	0	100		東1	6676	치니그	
32	東1	8002	丸紅	0	1,000		東1	8058	三菱商事	
33	東1	8404	みずほ信	0	5,000		東2	8585	オリコ	
34	東1	8815	東急不	0	1,000		東1	8804	東建物	
35	東1	6301	עדב	0	300		東1	6471	日本精工	
36	東1	4324	電通	0	200		東1	4205	日ゼオン	
37	東1	7201	日産自	0	600		東1	7230	日信工業	
38	東1	7201	日産自	0	600		東1	7296	FCC	
39	東1	6703	OKI	0	6,000		東1	6791	СССЕРИЕ	
40	東1	6479	ミネベア	0	1,000		東1	6481	THK	
41	東1	6301	עידב	0	300		東1	6448	ブラザー	
42	東1	7270	富士重	0	1,000		東1	7272	ヤマハ発	
43	東1	6367	ダイキン	0	100		東1	6301	コマツ	
44	東1	4061	電化	0	1,000		東1	4217	日立化成	
45	東1	9532	大ガス	0	2,000		東1	9502	中部電力	
46	東1	8233	高島屋	0	1,000		東1	8267	イオン	
47	東1	5411	JFEHD	0	100		東1	5444	大和工	
48	東1	6471	日積工	0	1,000		東1	6363	屢島製	
49	東1	6366	千代建	0	1,000		東1	6302	住友重	
50	東1	7267	ホンダ	0	200		東1	7230	日信工業	

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。

肉間	557	自計	利益	10	궤료	相關論計	相関干均	サヤ長実動	77	サヤ長平均	不均畫率	サヤカロ類	サウルの数字	47 O	対び徳宇
	5	3	402;500	138,300	264,300	0912	0878	21	181,400	25,145	1.90	156,255	11.20	68,211	22
	-4	3	109,800	53,200	56,600	0.956	0976	1.2	-111,200	-76,873	7.62	-34,327	-3.40	18,282	-19
	-4	0	207,000	0	207,000	0,996	0,922	15	2,500	14,783	1.59	-12,283	-1.32	26,457	-0.4
	- 4	0	106,000	0	106,000	0.919	0,936	1.2	31,000	18,700	2.22	12,300	1.46	32,964	03
	-4	2	188,100	63,900	124,200	0.919	0.948	1.8	151,200	88,647	6.85	62,553	4.83	48,768	12
	5	2	235,400	26,200	209,200	0913	0910	27	53,000	12,297	1.13	40,703	3.74	25,339	16
	- 4	1	180,300	27,600	152,700	0.900	0.942	26	-32,700	-15.629	1.64	-17,072	-1.79	25,001	-06
	5	0	237,000	0	237,000	0.965	0.924	1.8	91,800	69,314	6.42	22,486	2.08	28,912	07
	5	1	356,000	178,000	178,000	0.843	0.913	1.4	140,000	4,227	0.32	135,773	10.32	41,494	32
	4	1	118,500	29,000	89,500	0.872	0.959	09	69,500	49,765	4.26	19,735	1.69	33,781	05
	5	0	162,000	0	162,000	0.943	0.913	1.9	1,200	-20,593	250	29,793	2.60	28,536	10
	4	0.	121,400	0	121,400	0.982	0833	1.6	-113,300	-57,637	609	-55,663	-5.98	27,294	-20
	-4	2	120,500	50,200	70,300	0.818	0.923	24	23,200	22,473	384	727	0.10	15,284	0.0
	4	1	206,000	37,000	171,000	0.830	0.892	1.9	-12,600	-8,624	1.04	-3.976	-0.48	22577	-01
	4	1	82,400	4,600	77,800	0.919	0.999	11	1,200	33,767	258	-32567	-2.49	16,268	-20
	4	2	279,800	63,900	216,000	0.966	0.962	1.4	-32,200	20,959	1.19	-63,159	-3.02	38,466	-17
	3	2	78,000	33,500	44,500	0.907	0.917	25	-38,600	-42,699	669	4,099	0.64	15,321	02
	-4	1	318,600	48,200	270,400	0.813	0.886	22	57,800	97,384	6.48	-39,584	-263	58,713	-06
	5	2	384,000	173,000	211,000	0.827	0.998	23	373,000	162,973	7:59	210,027	9.91	49,517	43
	4	- 2	192,800	62 200	120.600	0.835	0.902	16	-28.200	-51 152	4.07	22.982	1.82	22.025	10

[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内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 きい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 注意願います。

[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