

■バックテストとフォワードテスト

売買シミュレーションにはバックテストとフォワードテストがあります。
目的に応じて使い分けてください。

バックテスト……基準日より前(過去)のシミュレーション

フォワードテスト……基準日より後(未来)のシミュレーション

※基準日とは銘柄ペアの作成と売買条件を設定した日を指します。

【過去1年間のバックテストの作業手順】

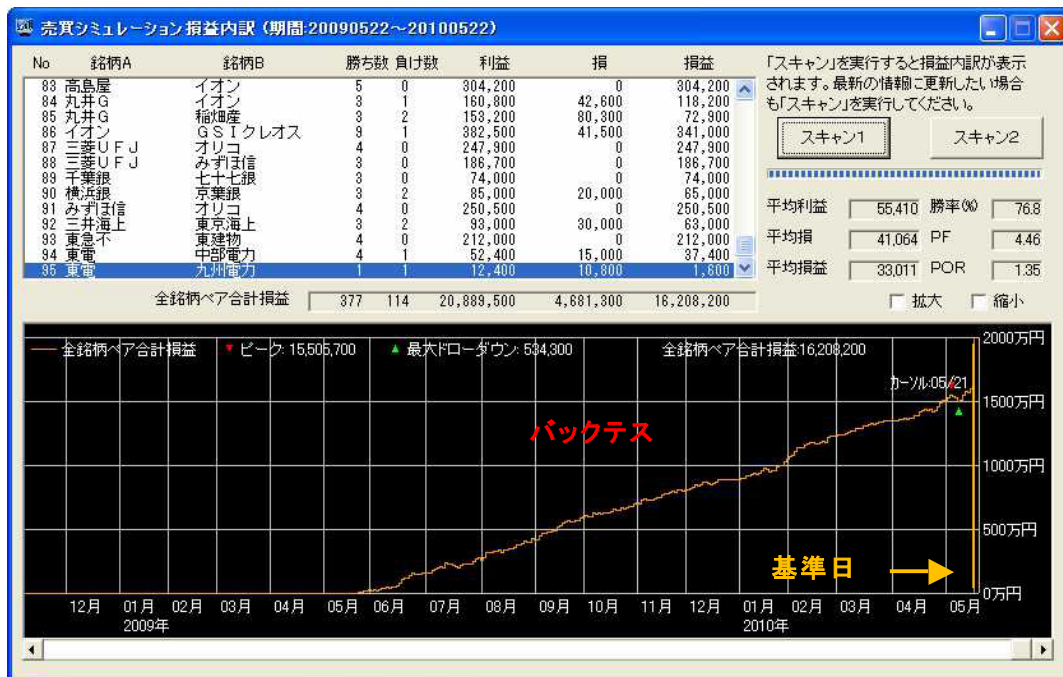
直近の過去データを利用して、利益が最大になるよう銘柄ペアの作成と売買条件を決定します。

スキャン1を実施します。

1年前から現在までの損益カーブが表示されます。

右肩上がりのカーブになります。

運用開始時点で本来分かるはずのない未来のデータを見ているので、カンニングによる効果により本来よりも良い結果(利益が多い結果)を示しますのでご注意ください。



【過去1年間のフォワードテストの作業手順】

まず基準日を1年前に設定します。

基準日を1年前に設定するにはグラフをスクロールして最も右端の日付が1年前の日付になるようにします。

直近の1年間のデータは隠れて見えない状態になります。

シミュレーション期間を2年前から1年前までに設定します。

この状態で銘柄ペアの作成と売買条件を設定します。

銘柄ペアの作成と売買条件の設定が完了したらグラフのスクロールを戻します。

シミュレーション終了日が当日になるよう確認、修正します。

スキャン1を実施します。

表示された直近1年間の損益カーブはフォワードテストの成績です。

一般的にはフォワードテストはバックテストより悪い成績になります。



[バックテストの目的]

バックテストの目的は過去のデータを利用して、投資成績が最も良くなる銘柄ペアと売買条件(売買ルール)を見つける事です。

バックテストを何度も繰り返して最良の条件を決定します。

実際の取引を開始する前に実施します。

通常はバックテストの後、実際の取引を開始する訳ですが、実際の取引をしないでシミュレーションを継続しても構いません。

この状態はリアルタイムシミュレーションであり、バックテストで決定した銘柄ペアと売買条件で実際に利益を生むかどうかをリアルタイムで監視する作業になります。

[フォワードテストの目的]

フォワードテストの目的は、作成した銘柄ペアと売買条件が未来の相場で利益を生むかどうかを確認する事です。

フォワードテストでは基準日より未来のデータを利用してシミュレーションしますのでカンニング効果が排除され本来の投資成績が表示されます。

実際の運用に近いシミュレーションと言うことができます。

フォワードテストの結果がよければバックテストで作成した銘柄ペアと売買条件が適切であったという事になります。