EAバックテストマニュアル

by カワセ係長



■推奨環境

このレポート上に書かれている URL はクリックできます。できない場合は最新の AdobeReader を無料でダウンロードしてください。

http://get.adobe.com/jp/reader/



2017年5月14日	••• · 初版発行
2020年2月7日	 ・・・ 8章追加
2020年3月21日	・・・ 8章バックテスト差し替え
2020年12月1日	・・・ Period_converter_autoのURL 改定
2021年1月20日	・・・ FXDDの URL 改定
2022年12月23日	・・・ 7-5と9-6追加。8章を独立化。

■0、はじめに

本書では、私の EA バックテスト方法について解説します。バックテストは自動売買投資 家の基本となりますので、是非、マスターして欲しいと思います。

【本書のバックテスト手順】

∎1、	MT4 にログイン	4
∎2、	バックテスト前の下準備	5
∎3、	FXDD のヒストリーデータを MT4 に入れる	9
∎4、	ー度 MT4 を閉じて、再起動する	14
∎5、	1 分足データを各時間軸に展開	15
∎6、	- 度再起動後、ログオフ	18
∎7、	バックテスト	20
∎8、	バックテストのトレードを確認したい	27
∎9、	やりがちなミス	28

▲ バックテスト専用 MT4 を準備しよう

バックテストを行う MT4 には、長期間の為替データを読み込ませるので、MT4 の動 作が重くなります。

ですので、バックテスト専用の MT4 を新しく準備される事をお勧めします。

■1、MT4 にログイン

まずは、MT4 にログインします。

1-1、「ファイル」→「取引口座にログイン」をクリックします



1-2、ログインIDとパスワードを入力し、「ログイン」をクリックします

FXDD Malta	?	\times		
	取引□座0	ロログイン情報		
	ログインID:	130200027 🗸		
	パスワード:	•••••		
	サーバー:	FXDD-MT4 Demo Server		~
		☑ログイン情報を保存		
		ログイン キャンセル		

1-3、取引口座にログインできました

MT4の右下が以下のように通信状態になっているのを確認して下さい

	3/0 kb	

■2、バックテスト前の下準備

バックテストを行うための事前準備を行っていきます。

2-1、「ツール」→「オプション」をクリックします

📆 ファイル (F) 🛛 🕏	表示(V) 挿入	.(I) チャート	· (C)	ツーノ	ν (T) ウィンドウ (W)	ヘルプ (H))
🗣 • 🖶 • 🛛	. 🔶 🔂 🛛	🗖 🕅 🛛	事新	E,	新規注文 (N)	F9	₽. ł
\mathbb{N} +	- / 🖗	_F A	T	8	ヒストリーセンター (H)	F2	D1
気配値表示: 23:44:	59				グロ−バル変数 (V)	F3	
通貨ペア	Bid	Ask	1	5	メタエディター (E)	F4	
USDCHF	1.00128	1.00146	18	-			
GBPUSD	1.28832	1.28864	3	&	オプション (0)	Ctrl+O	
EURUSD	1.09299	1.09319	20				

2-2、「チャート」タブの赤枠の部分に「9」を入力できなくなるまで入力します

オプション						?	\times
音声設定	2		コミュニティ		シグナル		
サーバー チャート	ライン等の設定	取引	エキスパートアドバイザ	通知機能	E・メール	FTP	
	☑チャート上に	ポジションとオー	ダーを表示				
	ドラック	による取引変更	更に'Alt' キーを使う				
	☑ 四本値表示	ŧ					
	□ Askのライン	を表示					
	□期間区切り	表示					
	□カラー印刷						
	☑ 再表示用に	削除済チャート	を保存				
ヒストリー内の最大バ	-数 999999999999	99999 🗸	チャートの最大バー数	: 99999999999	9999999 🗸		
			ОК	++	ンセル	ヘルプ	

初期状態では、1年分くらいしかバックテスト出来ません

初期状態では、最大バー数=512000 になっています。このままでは、1 分足ベース で約 1 年分しか為替データを取り込めませんので、この作業で、読み込めるデータ容量を 増やしておく必要があります。 2-3、「エキスパートアドバイザ」タブを開き、赤枠部分にチェックを入れます

オプション					?	\times
音声設定		コミュニティ		シグナル		
サーバー チャート ライン等の設定	取引	エキスパートアドバイザ	通知機能	E - メール	FTP	
□自動売買を許可する	-					
□ □ 座が変更されたら自動売買をスト	ッフする					
□ プロファイルが変更されたら自動売買	をストップする					
□ チャートの通貨ペアまたは時間足が変	変更されたら自動	助売買をストップする				
☑DLLの使用を許可する (信頼できるアプ)	リケーションのみ	で有効)				
✓ WebRequestを許可するURLリスト:						
◎ 新しい URL を追加、例えば 'https	://www.mql5.	com' のように				
		ОК	+1	ンセル	ヘルプ	•



「ツール」→「オプション」の設定が終わったら、「OK」をクリックしてウインドウを

閉じます。

オプション							?	×
	音声設定			コミュニティ		シグナル		
サーバー	チャート	ライン等の設定	取引	エキスパートアドバイザ	通知機能	E - X-JV	FTP	
☑自動	売買を許可す	õ						
	コ座が変更され	にら自動売買をストッ	ップする					
	プロファイルが変	更されたら自動売買る	をストップする					
	Fャートの通貨^	パアまたは時間足が変	更されたら自動	助売買をストップする				
	の使用を許可す	する (信頼できるアプリ	ケーションのみ	で有効)				
🗹 Web	Requestを許す	可するURLリスト:						
0	新しい URL を	追加、例えば "https:	//www.mql5	.com' のように				
				ОК	++	ッンセル	ヘルブ	P

6 / 38 Copyright (C) カワセ係長. All Rights Reserved.

2-4、次に「ストラテジーテスター」をクリックします

🗟 ファイル (F) 🛛 🕏	モ示(V) 挿入(り <u>チャー</u> ト	(C)	ツール(T) ウィンドウ	ヽ(W) ヘルプ (H)
🖳 - 🚍 - 🔀) 🔶 🔂 🛙		新耕	킨 注文	🔶 🍓 自	動売買 [1] [1]
	- / #E	デーストラ	テジーテ	<u>ו</u> גאלי,	Ctrl+R ¹⁵ M	15 M30 H1 H4
気配値表示: 23:44:	59			×		
通貨ペア	Bid	Ask	- 1	^		
USDCHF	1.00128	1.00146	18			
GBPUSD	1.28832	1.28864	32			
EURUSD	1.09299	1.09319	20			
USDJPY	113.306	113.334	28			
USDCAD	1.37129	1.37153	24			

2-5、バックテスト用の「テスター」画面が開かれました 「ターミナル」は不要ですので、赤矢印をクリックして閉じても OK です。

¹ 37/1/µ (f) 表示 (M) 挿入(0) チヤート (C) ソール (D) オ/ンドウ (M) ヘルブ (H) ■・ ■・ ● ◆ 除 戸 肥 ● 新規注文 ◆ 傍 自動売買 [L] 10 ト ● ④ ● ■ 11 ▼ + - / 縦 票 A 団 文・ ^{M1} M5 M15 M05 HI H4 OI WI MM	▶ [k Q • ⊠•			ء _ ا م	5 ×
R型(単最示): 23:4459 84 通常ペア 通常ペア アサント デイックティート 1 オロシート 1 アログーラン × アログーラン × 中 通 FXDO-MT4Live Server 7 全社 予応に入り 1	ップデ		撒中		
 × 注文番号 / 時間 取引権別 数量 通貨ペア 	価格 決済逆指値(S/L)	決済指値(T/P)	価格 手数料	スワップ 主	員益
	エキスパート 操作履歴			「1キ3パート設定」	
通貨ペア: USDCHF, United States Dollar vs. Swiss Franc		~	期間: M5	✓ 通貨ペアのブロパティ	
モディック(利用可能な最小時間枠を使いすべてのティックを生成する、最も正確な方法)		~	スプレッド 20	→ チャートを開く	
期間を指定 マ 開始日 2007.01.01 🔍 終了日 2017.01.01				最適化 エキスパート編集	
2017.05.14					
				አቃート	
セッティング 操作履歴					
ページ選択	Default			210/2 kb	///

2-6、以下より Period_converter_auto.ex4 をダウンロードします

https://kawase-kakarichou.com/contents/035-Period_converter_auto.zip

Period_converter_auto.ex4 とは 「1 分足データ」を、5 分足や1時間足等の各時間軸に一気に展開するためのスクリプ トツールです。MQL5 サイトで公開されています。

2-7、「ファイル」→「データフォルダを開く」をクリックします



ਰ

2-8、「MQL4」→「Scripts」フォルダの中に、Period_converter_auto.ex4 を入れま

·				
1 V J 7*	1ル(F) 表示(V) 挿入(I) デヤート(C) ツール(I)			
	📙 🛃 📮 V Scripts			
気配値	ファイル ホーム 共有 表示			
通貨^ 合 USI ◆ GBI	★ 切り取り メ 切り取り 、 パスのコピー クイックアクセ コピー 貼り付け アレー 、 切り取り 、 パスのコピー ショートカットの貼り付け	参勤先 コピー先 削除 名前の 変更	「前新しい項目・ 「う ショートカット・ 新しい 「フォルダー 」	プロパティ ● 展歴 日 週
🔶 EUI	クリップボード	整理	新規	開く
	\leftarrow \rightarrow \checkmark \uparrow \bigcirc « AppData \Rightarrow Roaming \Rightarrow M	letaQuotes > Terminal > 837D9B48	BF968E821E28C5CA5FA988E2	> MQL4 > Scripts >
AU	🛃 ካለጫካ ምлካኋ	名前 ^	更新日時	種類
		Examples	2016/11/03 21:	:18 ファイル フォルダー
通貨	🐉 Dropbox	malcache.dat	2017/05/14 20	51 DAT ファイル
ナビゲー	💪 OneDrive	Period_converter_auto.ex4	2014/02/15 21:	:11 EX4 ファイル
÷	_	PeriodConverter.ex4	2017/05/14 19	:29 EX4 ファイル
	PC	4 PeriodConverter.mq4	2017/05/14 19	29 MQL4 Source File
***	🥏 ネットワーク			

8 / 38 Copyright (C) カワセ係長. All Rights Reserved.

■3、FXDDのヒストリーデータをMT4に入れる

EA のバックテストを行うためには、過去相場の値動きデータが必要です。ここでは、 2005 年からの相場データを無料でダウンロードできる FXDD の hst ファイルを用いま す。

3-1、FXDDよりヒストリカルデータをダウンロードします。 以下にアクセスし、希望通貨の過去相場データをダウンロードして下さい。

https://www.fxddtrading.com/bm/jp/resources/mt4-one-minute-data

	会社概要 トレーディング 事業提携 お役立ち情報 お問い合わせ ライブロ座を開設 ログイン 🌐 🝺
X	Metatrader 1-Minute Data
	ヒストリーデータをインストールするには:
	 ダウンロードをしたいご希望の通貨ペアをクリックし、コンピューターに保存して下さい。
	 終わりましたらダウンロードウィンドウを閉じて下さい。
	○ メタトレーダー4プラットフォームを立ち上げます。
	○ ツールからヒストリーセンターをクリックして下さい。
	○ ダウンロードされた通貨ペアをダブルクリックし、一分足 (M1) を選択して下さい。
	 インボートを遅択して下さい。
	○ 先ほどダウンロードした.hst拡張子ファイルを探し、OKをクリックして下さい。OKをクリック後、ヒストリカルセンターにファ イルがアップロードされます。
	○ そうしましたらADDを選択し、ご覧になりたい日付を入力し、OKをクリックして下さい。
	○ 次にその通貨ベアのチャートを開き、チャートをリフレッシュしましたら過去のデータをご覧頂けます。
	AUD/CAD EUR/CAD GBP/USD AUD/JPY EUR/CHE NZD/USD AUD/NZD EUR/GBP

📙 🛃 📙 🖛 hstファイル					_	o ×
ファイル ホーム 共有 表	标					~ 🕐
エコブレビュー ウィンドウ ナビゲーション ウィンドウ ウィンドウ	 ■ 特大アイコン ■ 大アイコン ■ 中アイコン ■ 中アイコン ■ 小アイコン ■ 一覧 ■ 詳細 	□ グループ化 並べ替え … 列の追加 … すべての列	▼ ▼ のサイズを自動的に変更する	 □ 項目チェックボックス ✓ ファイル名拡張子 □ 隠しファイル 	選択した項目を 表示しない	】 オプション
ペイン	レイアウト	現在	EOĽ1-	表示/非表示	t	
\leftarrow \rightarrow \checkmark \land \bullet PC \rightarrow H	ドキュメント > メタトレーダーMT4 > hstフ	ファイル >		~ Ū	hstファイルの検	索 , 2
	名前	^	更新日時	種類	サイズ	^
📌 クイック アクセス	AUDCAD.H	ist	2017/02/25 3:01	HST ファイル	184,234 KB	
🔝 Dropbox	AUDJPY.hs	t	2017/02/25 3:01	HST ファイル	184,525 KB	
	AUDNZD.	nst	2017/02/25 3:01	HST ファイル	184,071 KB	
a OneDrive	AUDUSD.h	st	2017/02/25 3:01	HST ファイル	189,436 KB	
PC	CADJPY.hs	t	2017/02/25 3:01	HST ファイル	167,800 KB	
🕹 ダウンロード	CHFJPY.hs	t	2017/02/25 3:01	HST ファイル	186, 131 KB	
デスクトップ	EURAUD.h	st	2017/02/25 3:01	HST ファイル	184,715 KB	
K+1X26	EURCAD.h	st	2017/02/25 3:01	HST ファイル	184,568 KB	
・ パーチックト	URCHF.hs	t	2017/02/25 3:01	HST ファイル	189, 146 KB	
	EURGBRhs	t	2017/02/25 3:01	HST ファイル	189,694 KB	
	EURJPY.hs	t	2017/02/25 3:01	HST J711	190,095 KB	
♪ ミューシック		st	2017/02/25 3:01	HSI J71/V	189,700 KB	
🏪 U- <i>πμ τ</i> 1λ9 (G)	GRDIDV be	۶L +	2017/02/25 3:01		100,020 ND	
👝 ローカル ディスク (D:)	GBPUSD h	ct	2017/02/25 3:01		189 769 KB	
🔿 ネットワーク	NZDUSD.h	st	2017/02/25 3:01	HST ファイル	184 810 KB	
	USDCAD.h	st	2017/02/25 3:01	HST ファイル	189,078 KB	
	USDCHF.hs	st	2017/02/25 3:01	HST ファイル	189,871 KB	
	USDJPY.hs	t	2017/02/25 3:01	HST ファイル	189,644 KB	
	XAGUSD.h	st	2017/02/25 3:01	HST ファイル	147,240 KB	
	XAUUSD.h	st	2017/02/25 3:01	HST ファイル	147,129 KB	~
23 個の項目						

3-2、過去相場データとして、「hst」という拡張子のファイルが保存されます

🚹 hst ファイルとは

- ・hst ファイルは、過去数年間の「1分足4本値データ」です。
- ・通貨ペアによっては、2005年~の物や2007年~の物があります。
- ・FXDDのhstファイルは、通常、一週間ごとに更新されます。

・当方で確認できる限り、2017年に3ヶ月間程データの更新が行われなかった事がありました(2017年2月24日にデータ更新がストップし、5月13日頃にデータ更新が再開されました)。

・hstファイルは、MT4に読み込む事で利用する事が出来ます。

3-3、「ツール」→「ヒストリーセンター」をクリック(

🗟 ファイル (F) 🛛 表	{示(V) 挿入((1) チャート	(C)	ツーノ	μ (T) ウィンドウ (W)	ヘルプ (H))
🖳 - 🚍 - 🛛) 🕂 🔂] 🛃 🛙	新	Ę,	新規注文 (N)	F9	⊈ <u>⊢</u> €, ∈
	- / #E	_F A	T	8	ヒストリーセンター (H)	F2	D1 W1 MN
気配値表示: 23:44:	59			*	グローバル変数 (V)	F3	
通貨ペア	Bid	Ask	1		メタエディター (E)	F4	
USDCHF	1.00128	1.00146	18	Ť			
GBPUSD	1.28832	1.28864	32	&	オプション (O)	Ctrl+O	
EURUSD	1.09299	1.09319	20				
USDJPY	113.306	113.334	28				
	1.37129	1.37153	24				

3-4、「ヒストリーセンター」というウインドウが出てきますので、 バックテストをしたい通貨ペアの1分足(M1)をダブルクリックします

« <i>Р</i> :		デー・ベース: 1536 レコード					
🗐 EURNZD	^	時間	始値	高値	安値	終値	出来高
EURPLN		0 2017.05.12 23:44	145.969	145.990	145.962	145.982	56
		2017.05.12 23:43	145.986	145.986	145.970	145.970	62
		2017.05.12 23:42	145.995	145.995	145.981	145.986	29
		0 2017.05.12 23:41	145.991	146.000	145.991	145.994	36
EURZAR		0 2017.05.12 23:40	145.986	145.991	145.977	145.991	29
BPAUD		0 2017.05.12 23:39	145.973	145.992	145.957	145.986	4:
(\$) GBPCAD		0 2017.05.12 23:38	145.969	145.977	145.946	145.974	60
🛞 GBPCHF		0 2017.05.12 23:37	145.959	145.969	145.948	145.969	2
GBP JPY		0 2017.05.12 23:36	145.950	145.961	145.946	145.959	33
		0 2017.05.12 23:35	145.935	145.967	145.922	145.946	5
		2017.05.12 23:34	145.951	145.957	145.935	145.935	33
		2017.05.12 23:33	145.973	145.982	145.944	145.951	5
		0 2017.05.12 23:32	145.949	145.975	145.929	145.975	34
		0 2017.05.12 23:31	145.934	145.958	145.934	145.950	4
		2017.05.12 23:30	145.942	145.973	145.928	145.936	58
— 🗐 週足(W)		2017.05.12 23:29	145.952	145.977	145.939	145.946	63
		2017.05.12 23:28	145.965	145.980	145.952	145.953	46

現時点では、1分足で1日分程度の4本値データしかありません。

 THE PROPERTY OF A								
		0 2017.05.11 21:55	146.744	146.749	146.743	146.746	41	
		0 2017.05.11 21:54	146.735	146.749	146.735	146.744	36	
		2017.05.11 21:53	146.739	146.745	146.729	146.736	74	ł
毎月 (MN)		2017.05.11 21:52	146.739	146.741	146.724	146.737	72	
 CRDN7D	*							1

3-5、「インポート」をクリックします

□ 型疋(W)	2017.05.11 2	1:53	146.739	146.745	146.729	146.736	74
● 毎月(MN)	2017.05.11 2	1:52	146.739	146.741	146.724	146.737	
ダウンロード (o)	追加 (A)	編集 <mark>(</mark> E)	削除 (D)	エクスポ	-⊦(x)	インポート <mark>(</mark> I)	閉じる (C)

3-6、続いて「参照」をクリックします

通貨ペア:	デー・ベース:	1536 レコード						
BURNZD 1	ンポート: GBPJPY,M1					?	×	出来高 ^
							+	73
S EURSEK	ファイル名: D:¥Do	cuments¥メタトレー	ダーMT4¥hstファ	イル¥USDCHF.hst	t	参照((B)	76
BURTRY	セパレーター:	23	Fw7: 0	्र हु।	0	「行	2	49
(S EURUSD	+=++	-+					8	53
🛞 EURZAR	表示移動: 0	~ 時間	□選択	したものを使用	✓ 出来	高	3	75
GBPAUD	.+	±//+	nter Jata		457+		•	57
GBPCAD	時間	阳值	尚他	安旭	統値	出来尚	2	64
GBPCHF	2017.02.24 23:45	1.008	1.008	1.007	1.007	14	1	62
GBPJPY	2017.02.24 23:44	1.008	1.008	1.007	1.007	11	3	77
	2017.02.24 23:43	1.008	1.008	1.007	1.008	25	3	148
	2017.02.24 23:42	1.008	1.008	1.008	1.008	15	7	81
	0 2017.02.24 23:41	1.008	1.008	1.008	1.008	27	5	101
	+ 2017.02.24 23:40	1.008	1.008	1.008	1.008	14	2	58
	0 2017.02.24 23:39	1.008	1.008	1.008	1.008	11	v 5	41
- E B 5							+	36
		0	K ++	シセル			5	74
	۹IN) 📮 2017.0	5.1121:52	146.739	146.741	146.	724 :	146.737	72
	·							•

3-7、ファイルの選択画面になります

FXDD からダウンロードした hst ファイルを選択し、「開く」をクリックします

.ℓ. 開く						×
← → ~ ↑ → PC	» ドキュメント » メタトレーダーN	AT4 > hstファイル >		✓ Ö hstファイ	ルの検索	Q
整理▼ 新しいフォルダー					III ▼ □	?
▲ クイック アクセス Dropbox	名前 CHFJPY.hst EURAUD.hst	更新日時 2017/02/25 3:01 2017/02/25 3:01	種類 HST ファイル HST ファイル	サイズ 186,131 KB 184,715 KB		^
C OneDrive	EURCAD.hst	2017/02/25 3:01 2017/02/25 3:01 2017/02/25 3:01	HST ファイル HST ファイル HST ファイル	184,568 KB 189,146 KB 189,694 KB		
↓ ダウンロード ■ デスクトップ	EURJPY.hst EURUSD.hst GBPCHEhct	2017/02/25 3:01 2017/02/25 3:01 2017/02/25 3:01	HST ファイル HST ファイル HST ファイル	190,095 KB 189,700 KB 185,828 KB		
 	GBPJPY.hst	2017/02/25 3:01 2017/02/25 3:01 2017/02/25 3:01	HST ファイル HST ファイル	190,094 KB 189,769 KB		
■ ヒティ ♪ ミュージック ニューカル ディスク (C	USDCAD.hst	2017/02/25 3:01 2017/02/25 3:01 2017/02/25 3:01	HST ファイル HST ファイル HST ファイル	189,078 KB 189,871 KB		
■ □-カル ディスク (D	USDJPY.hst	2017/02/25 3:01 2017/02/25 3:01 2017/02/25 2:01	HST ファイル HST ファイル	189,644 KB 147,240 KB		
עדער איזיגאי ע דארע	AGOSELINST 名(N): GBPJPY.hst	2011/02/23 5:01	nər 7,711	→/,129 KB ✓ All File	s (*.*) く(O) キャンセ	۲ ۱۳

3-8、hst ファイルが1分足に読み込まれましたので、「OK」をクリックします

ヒストリーセンター: GBPJPY,M1							?	×
通貨ペア: デー・	ベース: 1536 レコード							
EURNZD インポート: GBPJPY,M1				1	?	X	出来高	^
EURPLN						+	73	
URRUB 771ル名:	D:¥Documents¥メタト	レーダーMT4¥hst	ファイル¥GBPJPY	(.hst	参昭	(B)	76	
EURSEK STOPPET					3234411	,	49	
	, ~	スキップ: 0	▽ 列	0	~行	2	53	
● EURUSD 表示移動:	0 、時間		記したものを使	H 24	「本高	E.	35	-
EURZAR			11/10/2009 2123		17(10)	e e	/3	
GBPAUD 時間	加小店	高值	安値	终值	山本宮		57	
GBPCAD (TIB)	×-10	비미면	24110	10.16		2	64	£
GBPCHF 2005.01.10 02:3	35 195.990	195.990	195.980	195.980	5	1	62	
□ ··· · · · · · · · · · · · · · · · · ·	34 195.960	195.990	195.960	195.990	6	3	77	
1分 + 2005.01.10 02:3	33 195.960	195.980	195.960	195.960	8	3	148	
·····································	32 195.980	195.990	195.940	195.960	13	7	81	
157 0 2005.01.10 02:3	31 195.980	196.010	195.980	195.990	11	5	101	
2005.01.10 02:	30 195.990	196.010	195.980	195.980	12		58	-
16年 48年 0 2005.01.10 02:2	29 195.840	195.990	195.840	195.990	3		41	
E 85			· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·			36	-
		ОК	キャンセル			E E	74	
	017 05 11 21 52	146	720 1/46	741 14	46 704	146 727	77	
	2017.05.11 21:52	140.7	140	1.1.1.	10.721	140.737	12	Y
ダウンロード (0) ジ	追加 (A) 編集	集 (E) 肖	小余 (D)	エクスポート (x)) インボー	ŀ (I)	閉じる (C)

なかなか反映しない場合

hst ファイルの読み込みが、なかなか反映しない場合があります。その場合は、再度読 み込み作業を行ってみて下さい。それでも読み込まない場合は、MT4のデータ容量をオ ーバーしている可能性がありますので、7-5を参考に不要データを削除します。

3-9、1分足データが読み込まれました

「閉じる」をクリックして、hst ファイルの読み込みを終了します

🛞 EURCAD	^	時間	始値	高値	安値	終値	出来高
🕚 EURCHF		0 2017.05.12 23:44	145.969	145.990	145.962	145.982	56
EURDKK		2017.05.12 23:43	145.986	145.986	145.970	145.970	62
		2017.05.12 23:42	145.995	145.995	145.981	145.986	29
S FUR IPY		0 2017.05.12 23:41	145.991	146.000	145.991	145.994	36
S EURMXN		0 2017.05.12 23:40	145.986	145.991	145.977	145.991	29
EURNOK		0 2017.05.12 23:39	145.973	145.992	145.957	145.986	43
📵 EURNZD		0 2017.05.12 23:38	145.969	145.977	145.946	145.974	60
🗐 EURPLN		0 2017.05.12 23:37	145.959	145.969	145.948	145.969	29
EURRUB		0 2017.05.12 23:36	145.950	145.961	145.946	145.959	32
EURSEK		0 2017.05.12 23:35	145.935	145.967	145.922	145.946	51
		2017.05.12 23:34	145.951	145.957	145.935	145.935	32
		2017.05.12 23:33	145.973	145.982	145.944	145.951	51
GBPAUD		0 2017.05.12 23:32	145.949	145.975	145.929	145.975	34
		0 2017.05.12 23:31	145.934	145.958	145.934	145.950	42
(B) GBPCHF		2017.05.12 23:30	145.942	145.973	145.928	145.936	58
		2017.05.12 23:29	145.952	145.977	145.939	145.946	63
<mark></mark> 1分足(M1)		2017.05.12 23:28	145.965	145.980	145.952	145.953	46

13 / 38 Copyright (C) カワセ係長. All Rights Reserved.

■4、一度 MT4 を閉じて、再起動する

4-1、前章で、バックテストしたい通貨ペアの「1分足データ(hst ファイル)」を読み 込ませましたが、以下、「ファイル」→「オフラインチャート」を開いても、現時点では、 読み込んだ1分足データが反映されていません。

1771	ル(F) 表示(V) 挿入(I) チャート(C)	ツール (T) ウィント	ドウ(W) へ	ルプ (H)	
	新損手ャート(N)		規注文 💊 🤫	自動売買	<u>1</u>	<u>⊨</u> (€, €
	オフラインチャート (O)		🔩 🛨 🛛 M1 M5	M15 M30	н1 н4 с	21 W1 MN
気	チャートの冉表示	٢	×			
通	チャートの組表示	•	i ^			
•	チャートを閉じる (C)	Ctrl+F4	8			
۵	名前を付けて保存 (S)	Ctrl+S	2			
1	画像として保存 (i)		D			
			8			
			¥			
1751	(ン・チャートリスト					? ×
ヒストリー	データ	<i>15</i> -	差出人		終了	開((O)
						キャンカフル
						A YOUN

4-2、MT4を閉じて再度起動すると、「ファイル」→「オフラインチャート」に、データ が反映されます

			?	×
<i>1</i> 5-	差出人	終了	開(<mark>(</mark> 0))
4426040	2005.01.10 02:29	2017.05.12 23:44		
	バー 4426040	バー 差出人 4426040 2005.01.10 02:29	バー 差出人 終了 4426040 2005.01.10 02:29 2017.05.12 23:44	? <u>バー 洋出人 終了</u> 開X (C 4426040 2005.01.10 02:29 2017.05.12 23:44

■5、1分足データを各時間軸に展開

現時点では、3章で作った為替データは1分足のみですので、5分足や1時間足などの 各時間軸に展開していきます。

5-1、「ファイル」→「オフラインチャート」をクリックします



5-2、通貨ペアを選択して「開く」をクリックします



5-3、対象通貨のオフラインチャートが開きますので、そこに「Period_converter_auto」 をドラッグ&ドロップします



🚺 デフォルトの「Period_converter」を使ってもOK

MT4 にデフォルトで入っている「Period_converter」を使っても良いです。これは、 1 分足データから任意の一つの時間軸のみを作成してくれます。以下は、60 分=1 時間 足のみを作成する例です。



5-4、1 分足データ→各時間軸へのデータ展開が始まります

データ展開が終了したら「OK」をクリックします



5-5、これで、全時間軸の過去相場4本値データが集まりました 「ファイル」→「オフラインチャート」で確認できます

■ オフライン・チャートリスト					?	×
ヒストリーデータ	バー	差出人	終了	^	開(<mark>(</mark> 0))
GBPJPY,M1	4426038	2005.01.10 02:29	2017.05.12 23:44			
GBPJPY,M5	886258	2005.01.10 02:25	2017.05.12 23:40			
GBPJPY,M15	295760	2005.01.10 02:15	2017.05.12 23:30			
GBPJPY,M30	148086	2005.01.10 02:00	2017.05.12 23:30			
GBPJPY,H1	74240	2005.01.10 02:00	2017.05.12 23:00			
GBPJPY,H4	18751	2005.01.10 00:00	2017.05.12 20:00			
GBPJPY,Daily	3221	2005.01.10 00:00	2017.05.12 00:00		キャッカ	II.
· · · ·				¥	イヤノビ	νν.



経験上、一つの MT4 につき4 通貨ペアくらいまでにしておくのが無難です。あまりに 多くの通貨ペアを読み込ませますと、MT4 としてのデータ容量を超えてしまい、正常に バックテスト出来なくなってしまう事があります。また、動作も遅くなります。

■6、一度再起動後、ログオフ

バックテスト前の最後の下準備として、MT4を再起動し、ログオフします。

6-1、各時間軸のデータをMT4に反映させるため、一旦MT4を閉じて、再度起動します

6-2、MT4 再起動後、「ファイル」→「取引口座にログイン」をクリックします



6-3、パスワードを消去して「ログイン」します

FXDD Malta	FXDD Malta - MetaTrader 4									
	取引□座0	取引口座のログイン情報								
	ログインID:	130200027 ~								
[パスワード:									
	サーバー:	FXDD-MT4 Demo Server		~						
		ログイン キャンセル								

6-4、ログインに失敗します

🐻 ファイル (F) 表示 (V) 挿	入(1) チャート (C) ツール (T) ウインドウ (W) ヘルプ (H)	- 6 ×
🗣 • 🔂 • 💊 💊	🛐 🖳 輪視注文 💊 🍘 自動売買 🛛 Ц 坦 🗠 🔍 🤍 🔜 🔛 比 📴 - 🕥 - 🖾 -	P 🔗
▶ + - / Ø	k III A III A III A III A III AD HI HA DI WI MN	
気配1世表示: 23:44:59 通信パア Bid	× (sep)pry.m1 145.549 145.540 145.542 145.542	146.435
	3 1.00146 18	146.380
GBPUSD 1.28832	1.28664 32	146.325
EURUSD 1.09299	1.09319 20 1	
	5 113.334 28	146.270
OSDCAD 1.37129 AUDUSD 0.73869		146.215
 EURGBP 0.84824 		
通貨ペアリスト ティックチャート		146.160
ナビゲーター		146.105
EXDD Malta - MetaTrader 4	4 PUETA PARA PARA ANA ANA ANA ANA ANA ANA ANA ANA ANA	146.050
● 🚯 口座 売. 🗐 インディケータ		140.030
☆…≪ エキスパートアドバイザ		
□-□-□-□ スクリプト		145 940
Examples Deried convertor a		
Period_converter_a		145.885
	l l l l l l l l l l l l l l l l l l l	145 830
		143.430
	2 May 2017 2 May 16:41 2 May 16:41 2 May 16:45 2 May 17:18 2 May 17:51 2 May 18:23 12 May 18:25 2 May 19:57 12 May 19:59 12 May 20:51 12 May 20:51 12 May 21:51 12 May 20:51 12 May	145.775 May 22:41 12 May 23:13
全般 お気に入り	USDCHEM1 (offline) G8PJPY,M1 (offline)	()
× Tキスパートアドバイ -> Mox	ving Average ext	Tを2パート時定
通貨ペアーロSE	- DHE Ibina State Della ve Swite Franc	通貨ペアのプロパティ
モナル 王ナ	7472人时间配发展194前时在2式19人口074792至1659公、展台正幅体为达20	ナヤートを開い
期間を指定 🖌	開始日 2007.01.01 ・ 終了日 2017.01.01 ・ 最適化	エキスパート編集
ビジュアルモード 🗌 🗆	III スキップ 2017.05.14 □▼	
1		7.8-1
セッティング 操作履歴		
F1キーでヘルプが表示されます	Default	-FICE
	スタート スタート	

▲ ログインを失敗させる理由

ログインを失敗させるのは、FX 会社への通信を切るためです。MT4 がオンラインのま までバックテストを行うと、オフラインデータにオンラインデータが上書きされてしまう ケースが起こります。

オンラインデータが上書きされると、「FXDDのデータ」と「そのFX 会社の為替デー タ」が混在し、例えば「1 分足と1 時間足で為替レートが異なる」という「不整合チャー トエラー」が発生します。

■7、バックテスト

準備が整いましたので、いよいよバックテストを行います。

7-1、バックテスト画面で、以下をセットします

- EA を選択
- ・通貨ペアを選択
- ・期間(時間軸)を選択
- ・モデルを選択
- ・スプレッドを入力(POINT 入力ですので、2pips の場合は「20」と入力)
- ・「期間を指定」にチェック
- ・バックテスト期間(開始日と終了日)を指定
- ・必要に応じて「エキスパート設定」からパラメータを入力

×	エキスパートアドバイ	\sim	GSP-FLOATING_system_ver1_12.ex4	~	エキスパート設定
	通貨	ኛዎ:	GBPJPY, Great Britain Pound vs. Japanese Yen 🗸 🗸 H1	1 ~	通貨ペアのプロパティ
	÷	デル:	全ティック(利用可能な最小時間枠を使いすべてのティックを生成する、最も正確な方法) > 25	i ~	チャートを開く
	期間を指い	è 🗸	開始日 2007.01.01 ■▼ 終了日 2017.01.01		エキスパート編集
	ビジュアルモー	۲			
J.					スタート
于入外	セッティング 操作	履歴			

<<パラメータを適宜入力する>>

変数	値	値 スタート		ストップ
FLOATING_B_MagicNumber	2328102	2328102	0	0
FLOATING_C_MagicNumber	2328103	2328103	0	0
Lots	0.2	0.2	0.0	0.0
TakeProfit	500	500	0	0
MAX_StopLoss	150	150	0	0
Slippage	20	20	0	0
Retrytime_Duration	10	10	0	0
NY_Closetime_Entry_Offset	0	0	0	0

20 / 38 Copyright (C) カワセ係長. All Rights Reserved.

7-2、「スタート」をクリックします



バックテストが進んでいき・・・

	エキスパートアドバイモー	GSP-FLOATING_system_ver1_12.ex4			✓ エキスパート設定
	通貨ペア:	GBPJPY, Great Britain Pound vs. Japanese Yen	\sim	期間: H1	◇ 通貨ペアのプロパティ
	モデル・	全ティック(利用可能な最小時間枠を使いすべてのティックを生成する、最も正確な方法)	\sim	スプレッド 25	◇ チャートを開く
	期間を指定 🖌	開始日 2007.01.01 🔍 終了日 2017.01.01 🔍		最	道化 I エキスパート編集
	ビジュアルモード	□ スキップ 2017.05.14 □ マ			
	使用中 M1				
,					ストップ
于入办	セッティング 結果 :	「ラフ レポート 操作履歴			
77	ター設定ページ	Default			JEVI5-

バックテストが完了します

×	エキスパートアドバイ1~	GSP-FLOATING_system_ver1_12ex4	P-FLOATING_system_ver1_12ex4										
	通貨ペア:	GBPJPY, Great Britain Pound vs. Japanese Yen	~	期間	通貨ペアのプロパティ								
	モデル・	全ティッグ(利用可能な最小時間枠を使いすべてのティックを生成する、最も正確な方法)	~	スプレッド	25 ~	チャートを開く							
	期間を指定 🗸	開始日 2007.01.01 💷 終了日 2017.01.01 💷			最適化 🗌	エキスパート編集							
	ビジュアルモード 🗌	入ギップ 2017.05.14 □マ											
						スタート							
F7.9-	セッティング 結果 ! !												
F1	キーでヘルプが表示されます	Default											

バックテストは、重いEA ですと数時間かかりますので、気長に待ちましょう。

7-3、「レポート」 タブの上で右クリックし、「レポートの保存」 からバックテストを保存 できます



7-4、通常であれば、「ファイル」→「データフォルダを開く」の直下に htm ファイルと gif ファイルが保存されています(これがバックテストファイルです)



22 / 38 Copyright (C) カワセ係長. All Rights Reserved.

7-5、保存した htm ファイルをダブルクリックすると、以下のように開くことができま す。

Strategy Tester Report GSP-FLOATING_system_ver1_12 FXDD-MT4 Demo Server (Build 1080)



バックテストの提出について

サイト等にバックテストを提出する場合は、必ず htm ファイルを gif ファイルをセット で提出するようにしましょう。バックテストは htm と gif が必ず2つで1 セットです。



2022/12/23 16:25



fif のファイル名を変更しないように。

バックテストのファイル名変更には注意しましょう。特に、gifのファイル名を変更して しまうと、htm ファイルにグラフが表示されなくなってしまいます(htm から gif ファイ ルを読み込む仕様になっており、gifのファイル名を変えてしまうとファイルが読み込めな くなってしまう)

								→ -†1					
初期証拠畫		10000.00						スノレット			20		
純益		-25.66	総利益				0.00	総損失		-25.66			
プロフィットフ	アクタ	0.00	期待利得			-6.42							
絶対ドローダウ	シ	25.97	最大ドロ-	ーダウン		25	.97 (0.26%)	相対ドローダウン 0.26% (25					
総取引数		4	売りポジョ	ション (勝率%)			0 (0.00%)	買いポジション(勝率%) 4 (0.0					
			勝率(%)				0 (0.00%)	負率 (%)			4 (100.00%)		
		最大	勝トレート	\$		0.00 敗トレード					-8.29		
		平均	勝トレート	-			0.00	敗トレード			-6.42		
		最大	連勝(金額)			0 (0.00)	連敗(金額)			4 (-25.66)		
		最大	連勝(トレ	ード数)		0.00 (0) 連敗(トレード数)					-25.66 (4)		
		平均	連勝					連敗			4		
						Graph							
#	時間]	取引種別	注文番号	数量	価格	決	斎逆指値(S/L)	決済指値(T/P)	損益	残高		
1	2022.12.08 01:55		buy	1	0.01	1.05903		0.00000	0.00000				
2	2022.12.08 13:10		close	1	0.01	1.06075		0.00000	0.00000	-5.92	9994.08		
2				•	· · · ·	4 05750		0.00000	0.00000				

🚹 モデリング品質

5分足以上のバックテストでは、「モデリング品質=90,00%(稀に89.9%等のケース) もあり)」&「不整合チャートエラー=O」になれば、バックテストが正常に行われた事に なります。1分足の場合は、「モデリング品質=25.00%」が上限になります。 「不整合チャートエラー」に赤字数字が発生した場合は、オンラインデータが上書きさ

れる等してしまい、為替データの整合性が無くなってしまっている状態です。

その場合は、7-5を参考にデータを削除し、イチから作業をやり直してください。

7-6、ワンポイントアドバイス

バックテスト用ファイルは定期的に削除 バックテストを行うと、データフォルダの中に容量の大きなファイルが溜まっていきま す。パソコンのパフォーマンスに影響しますので、これらのファイルは定期的に削除する のが良いでしょう。 ●「tester」→「history」の中のファイルを全削除 📙 🛛 🛃 🖬 🖛 🛛 history Х ファイル ホーム 共有 表示 \sim 0 □</li 11... クイック アクセ コピー 貼り付け 💼 🔟 コピー先 🗸 📑 名前の変更 新しい T スにピン留め 7オルダー 💾 選択の切り替え 開く 新規 選択 ← → ∽ ↑ 📙 « 837D9B48BF968E821E28C5CA5FA988E2 > tester > history ✓ ひ historyの検索 ø ^ 更新日時 種類 サイズ 名前 📌 クイック アクセス GBPJPY60_0.fxt 2017/05/15 10:25 FXT ファイル 604,041 KB 😂 Dropbox ConeDrive PC 👃 ダウンロード 🔜 デスクトップ 🚆 ドキュメント 📰 ピクチャ]== | 1個の項目 ●「tester」→「logs」の中のファイルを全削除 📙 | 📝 📑 🖛 | logs П × ファイル ホーム 共有 表示 ~ 🕐 またしますがで選択 品 選択解除 クイック アクセ コピー 貼り付け 🖻 🐚 コピー先 ▼ 📑 名前の変更 スピアン留め 💾 選択の切り替え スにピン留め クリップボード 整理 選択 ← → × ↑ 📙 « 837D9B48BF968E821E28C5CA5FA988E2 > tester > logs ✓ O logsの検索 Q **^** 名前 ^ 更新日時 種類 サイズ a OneDrive 2017/05/15 0:17 テキスト ドキュメント 1,599 KB 20170514.log 💻 PC 20170515.log 2017/05/15 10:01 テキストドキュメント 448 KB 🖊 ダウンロード 📃 デスクトップ 🚆 ドキュメント 📰 ピクチャ 📑 📑 🎝 ミュージック ■ ローカル ディスク (C:) × 2個の項目



■8、バックテストのトレードを確認したい

8-1、バックテストが完了した状態で、「チャートを開く」をクリックすると、どんなト レードをしたのかチャート上で確認する事ができます



■9、やりがちなミス

バックテストをするにあたって、やりがちな間違いやミスについて解説します。

9-1、スプレッドに「2」と入力する。

ドル円やユーロドルは、一般的にスプレッド=1.5pips~2.0pips です。ですのでバック テストをする時、スプレッド入力欄に「2」と入力してしまいがちです。しかし、これは 初心者の方にありがちなミスなので注意して下さい。

通貨ペア:	EURUSD, Euro vs. United States Dollar $\qquad \qquad \lor$	期間:	M5 \sim	通貨ペアのブロパティ
モデル	全ティック(利用可能な最小時間枠を使いすべてのティックを生成する、最も ~	スプレッド:	2 ~	チャートを開く
朝間を指定 🗸	開始日 2009.07.30 ■▼ 終了E	2014.02.2]	エキスパート編集
ュアルモード	[] スキップ	2020.02.07]	

MT4 のスプレッドは、「ポイント」という表し方をします。結論から言いますと、小数 点以下 3 桁/5 桁で表される MT4 業者では、スプレッド=2pips でバックテストしたけれ ば、「スプレッド=20」と入力する必要があります。

気配値表示: 09:30:35							
通貨ペア	Bid	Ask	1				
🛧 EURUSD	1.09734	1.09751	17				
🚸 GBPJPY	142.198	142.223	25				
🚸 USDJPY	109.882	109.902	20				

1 ドル=109.882 円が、109.885 円にあがったら、「0.3pips 上昇した」と言いま す。また、この 0.3pips の「3」は「ポイント」と表現されます。

小数点以下2桁/4桁の証券会社では1pips=1ポイント 小数点以下3桁/5桁の証券会社では0.1pips=1ポイント

普段取引する分には 1pips 単位で考えれば大丈夫ですが、自動売買ソフトのバックテストという作業を行う時は、ポイントの入力単位が重要になってきます。



例えば、スプレッド=2と入力して以下の右肩上がりのバックテストになったとします。

しかし、小数点以下3桁/5桁の業者では、スプレッド2pipsでバックテストしたいなら「スプレッド=20」と入力してバックテストすべきです。上記バックテストは0.2pipsでバックテストされている事になりますので、1トレードあたり1.8pips甘く見積もられている事になります。

例えば上記のバックテストの総取引数=15,711 トレードなので、15,711 トレード× 1.8pips=28,279.8pips となり、約2万 pips 有利なバックテストという事になりま す。

スプレッド 0.2pips の業者があれば良いですが、現実にそんな業者はありませんので、 0.2pips で実施された上記バックテストは現実的ではありません(業者 HP で 0.27pips とかをうたう業者があったりしますが、実際は滑ったり不利レートでの約定が横行してる ので、0.2pips のスプレッドはあり得ません)

では、上記バックテストと同じEAを、正常なスプレッドでバックテストしてみましょう。



・・・はい。正しいスプレッドでバックテストしたら、綺麗な右肩下がりになってしまいました。さっきのバックテストは1トレードあたり1.8pipsも有利に評価されていましたので、この結果は当然と言えば当然です。

意図的かどうかは別として、「スプレッド=2(つまり 0.2pips)」と入力する等して、 良いバックテストだと見せかけて販売する業者もいます。スプレッドが甘ければ、成績が 良くなるのは当たり前ですが、実際の相場で使う事を想定していなければ何の意味もあり ません。

バックテストのスプレッドには特に注意をしましょう。

9-2、小数点以下4桁/2桁のMT4でバックテストしてしまう。

最近の FX 業者は、小数点以下 3 桁/5 桁の業者が多いです。例えば以下の場合、 EURUSD は 1.09734 で小数点以下 5 桁、GBPJPY は 142.198 で、小数点以下 3 桁 です。

気配値表示: 09:30:35							
通貨ペア	Bid	Ask	1				
EURUSD	1.09734	1.09751	17				
GBPJPY	142.198	142.223	25				
USDJPY	109.882	109.902	20				

本マニュアルの 7-1 や 8-1 で、「スプレッド=2pips の場合は 20 と入力する事」と解 説しました。しかしこれは「小数点以下 3 桁/5 桁の業者」に限ります。

上記を見るとUSDJPYの「!」に「20」と書いてあります。これはドル円のスプレッドを表しますが、実際のドル円のスプレッドは20pipsではありません。上記のレート差から計算すると、ドル円のスプレッド=109.902-109.882=0.020となり、スプレッドは20pipsではなく、実際には2pipsです。小数点以下3桁/5桁の業者のMT4では「スプレッド2pips」の場合「20」と表現されるのです。

通常の MT4 では、この部分はあまり気にする必要はありませんが、小数点以下 4 桁/2 桁の MT4 で普通にバックテストしようとすると、困った現象が起こってしまいます。

次のページのバックテストをご覧ください。

【とあるバックテスト】

初期証拠金	10000000.00										スプレッド 20						
純益	-1022362.91	総利益						412722	.77	7 総損失 -1435085.68							
プロフィットフ ァクタ	0.29	期待利得						-140).69								
絶対ドローダウ ン	1022396.72	最大ドロ-	-ダウン				1023905	5.79 (10.24	!%)	相対ド	コーダウミ	>			10.	24% (10	23905.79)
総取引数	7267	売りポジョ	ション(勝率	%)			3	634 (34.89	9%)	買いポ	ジション((勝率%)				3633	(34.54%)
		勝率(%)					2	523 (34.72	2%)	負率 (%	6)					4744	(65.28%)
	最大	勝トレー	ř					1830	.46	敗トレ・	- 15						-5790.04
	平均	勝トレー	-					163	.58	敗トレ	- 15						-302.51
	最大	連勝(金額)					12 (7060	28)	連敗(金	額)					50	(-9577.05)
	最大	連勝(トレ	- ド数)					7060.28 (12)	連敗(ト	レード数	()				-95	77.05 (50)
	平均	連勝							2	連敗							3
残高 / 全ティッ	り(利用可能な	最小時間構	ぬを使いす/	ኛርወታ	ィックを生	成する、	最も正確	な方法 <mark>)</mark> /	90	.00%_							1000914
						_											9738467
									-								9467793
													-				9197119
0 420 802	1184 150	56 1948	2330	2712	3094	3476	3858	4240 4	522	5004	5386	5768	6150	6532	6914	7296	8926444
		0488	En 2146	01	计中共	⊇. ¥h 8	a /#	s+47	2113	<u>余米将</u> 店	(6/1)	油油	15/店/〒/1		+= **		花吉
#	2005 01 11 0		月入口17里	נימ/	注义雷"	J 201	≝ 1≝	118	i / /i	비명원되었	(S/L)	沃洱	1/1)의(Bt	0	損益		7天(四)
2	2005.01.11 0	0:45	s mod	ifv		1 0.0	1 1.22	37		2.	2237		0.000	7			
3	2005.01.11 0	2:55	clo	se		1 0.0	1 1.22	29		2.	2237		0.223	7	67.63	10	000067.63
										-				•			

実はこのEAは右肩上がりのEAなのですが、バックテストをしたところ右肩下がりになってしまいました。原因は以下に隠れています。

取引種別	注文番号	数量	価格
sell	1	0.01	1.2237
1.0			

レートが 1.2237 になっており、小数点以下 4 桁の業者である事が分かります。小数 点以下 4 桁の業者で以下のように「スプレッド=20」でバックテストしてしまうと 2pips ではなく、「20pips のスプレッド」でバックテストしている状態になってしまうの で要注意です。

スプレッド	20
- 2018	

スプレッド 2pips なら普通に右肩上がりになるロジックでも、スプレッド 2Opips で右 肩上がりになるロジックなんてほとんどありません。小数点以下 4 桁/2 桁の業者で「ス プレッド=20」の設定でバックテストしていても、いつまで経っても右肩上がりになりま せんので注意して下さい。

なお、MT4をログオフとか再インストールとかしている拍子に「3桁/5桁の業者のは ずなにに、いつの間にか2桁/4桁になっていた!」という事例も報告されています。そ の場合は、一旦、口座にログインしてみるなど、3桁/5桁に戻すようにしましょう。

9-3、外付け手数料ありの口座でバックテストしてしまう

トレード条件が良いので、「普段は外付け手数料の口座でトレードする!」という方も 多いかなと思います。1 ロットあたり 700 円の手数料を払う代わりに、0.3pips とかの 極めて狭いスプレッドでトレードできる等のトレード環境を得られるのが外付け手数料口 座です。1 ロットの 0.3pips=300 円なので、700 円のスプレッドと合算すれば、 1pips 相当のスプレッドです。通常口座では 1.5pips のスプレッドだとしても、外付け手 数料口座の方がトータルコスト的には良くなるパターンが多いです。

で、通常のトレード時には外付け手数料口座を使ってもらうのは構わないのですが、バックテストをする時は注意が必要です。

バックテストに外付け手数料が加算され、以下のようなバックテストになってしまう事 があるためです。



外付け手数料口座にログインした MT4 でバックテストすると、以下のような現象が起こります。

取引種別	注文番号	数量	価格	決済逆指値(S/L)	決済指値(T/P)	損益
sell	1	0.10	119.218			
modify	1	0.10	119.218	129.218	118.818	
t/p	1	0.10	118.818	129.218	118.818	-38.34
buy	2	0.10	119.036			
modify	2	0.10	119.036	109.036	<mark>1</mark> 19.436	
t/p	2	0.10	119.436	109.036	119.436	-38.51
buy	3	0.10	119.447			
modify	3	0.10	119.447	109.447	119.847	
		0.10	110 511			

sell のポジションを見て下さい。119.218 で持った売りポジションを 118.818 で決済しています。売りポジションを持って→更に下がった所で決済しているので、トレードが大成功しているはずですが、損益を見ると「-38.34」になっています。

次の buy ポジションも同様です。119.036 で持った買いポジションを 119.447 で決済しています。買いポジションを持って→上がったところで決済しているので、トレードが大成功しているはずですが、損益を見ると「-38.51」になっています。

どちらのトレードも損益プラスになっているはずなのに、「マイナストレード」になってしまっているのです。

その理由は、外付け手数料口座でバックテストしてしまっているためです。このケースでは、「0.1 ロットにつき外付け手数料 70 円」の口座でバックテストしているのですが、 MT4 バックテストでは外付け手数料の円とドルを判別できない仕様なので、外付け手数料 70 ドルが引かれてしまっているのです。

+30 ドルの利確になったとしても 70 ドルの手数料を引かれてしまえば、どんなに上手 にトレードしても-40 ドルのマイナスになってしまいます。もちろん手数料 70 ドルのロ 座なんて存在するはずはありません。バックテストの仕様上、70 円→0.7 ドルへの手数 料換算が出来ず、70 ドルの手数料として引かれてしまうのです。

この場合の対処法は、「外付け手数料無しの口座にログインしなおす」です。バックテ ストをする時は外付け手数料無しの口座の方が何かと手っ取り早いので注意するようにし ましょう。 9-4、コントロールポイントのバックテストで満足してしまう。

バックテストの時短手段として「コントロールポイント」でのバックテストがありま す。1時間足のバックテストをする時、全ティックならば1分足の値動きデータを用いま すが、それよりも荒い30分足の時間足を使ってバックテストする手段です。

普通のEAならばコントロールポイントだけでも、バックテストのある程度の傾向は見る事ができますが、稀に、同じEAでも以下のように違いが出るケースがあります。



まったく同じEAなのに、コントロールポイントと全ティックでここまでの違いになってしまうのです。データとしての信頼性があるのは、当然ながら「全ティック」です。

時短としてコントロールポイントでバックテストする事は良いと思うのですが、必ず全 ティックでもバックテストを行い、再現性を確認するようにしましょう。ロジックによっ ては上記のような現象が発生する EA もあるので注意です。 9-5、バックテストに時間がかかり過ぎます…

【Sさんより】

バックテストを全ティックやってみたのですが、丸2日かけても10%も進まず、あま りの時間のかかりように驚き止めてしまいました。

【カワセ係長より】

これはちょっと問題ありですね。1分足だからというのもあるかと思いますが、少し時 間がかかりすぎです。

EAの仕様は「ローソク足確定時にエントリーや決済する仕様」でしょうか?稀に、ティックデータが更新されるたびに動作するEAだと、ポジションを複数保有した時等に高 負荷がかかり、バックテストに時間がかかり過ぎる事があります。

【Sさんより】

バックテストの件ですが、通常通りスタートボタンで始めるとチャートのウィンドウが 開きローソク足が描画されて進んでいきます。その場合はとても時間がかかります。

L	- デ Average - デ Bears Pow - デ Bears Pow - デ Commod - デ Commod - デ Force Ind - デ MACD - デ Moving A 全般 お気に入り	irue Range rer ty Channel Index ex ex im iwerage of Oscillator	30 Dec 2005	30 Dec 18:20 M1 (offline)	30 Dec 19:00	30 Dec 19:40 A5 USDJ	30 Dec 20:20 PY,M5 (visua	30 Dec 21:00) 30 Dec 21:4		2:20 3 Jan 08:25		- 117.435 - 117.360 - 117.285 - 117.285 - 117.210 - 117.135
×	エキスパートアドバイ・	a.ex4						_			~ [エキスパート設定	
	通貨ペア:	USDJPY, United Sta	ates Dollar vs. Jaj	panese Yen			\sim		期間:	M5	\sim	通貨ペアのプロパティ	í
	モデル	全ティック(利用可能な	(最小時間枠を使(,)すべてのティッ	ックを生成する、	最も正確な	方法) 🗸		スプレッド	20	~	チャートを開く	
	期間を指定 🕨	- 開始	\$⊟ 2006.01.01	-		終了日 2	006.10.01				最適化 🗌	エキスパート編集	
	ビジュアルモード 🕨	']			スキップ	2	020.10.29						
J.												ストップ	
Ľ,	セッティング 結果	グラフ レポート 操	作履歴										

ですが、スタートボタン左上にある最適化というところにチェックを入れて一度スタートさせ、次に最適化のチェックを外します。その後は通常通りスタートボタンでバックテストを行うと、チャートウィンドウは表示されず、とても早くテストが終わります。これですと全ティックであっても数分です。(5分かからないと思います)

【カワセ係長より】

これは良くないですね。以下の「ビジュアルモード」にチェックが入ってませんか?

通貨ペア:	USDJPY, US Dollar vs Japanese Yen	
モデル:	全ティック(利用可能な最小時間枠を使いすべてのティックを生成する、最も正確な方法)	
期間を指定 🖌	開始日 2006.01.01 ■▼ 終了日 2007.10.01 ■▼	
೮೮ュアルモード 🗹	II スキップ 2020.10.29 ■▼	

これは、バックテストを進行させながら、チャートウインドウ上でローソク足の描画を 確認するモードです。ローソク足の値動きをチャートに表示させながらバックテストが進 むので、とんでもなく時間がかかります。チャートに描画しながらバックテストしても描 画させずにバックテストしても、バックテスト結果は同じです。描画させて目視する事に 対し、基本的に意味はあまりないので、「ビジュアルモード」のチェックは外してバック テストをして下さい。

> スタートボタン左上にある最適化というところにチェックを入れて一度スタートさせ、 次に最適化のチェックを外します。

これはそういう仕様ですね。「ビジュアルモード」のチェックが、最適化バックテストを 行うと外れる仕様です。

「ビジュアルモード」のチェックは外してバックテストをして下さい。

9-6、バックテスト期間を選択する入力欄がありません。

【Hさんより】

私の MT4 は、バックテスト期間を入力する欄が無いようで、困っています。

	Momentum Moving Average of Oscillator Relative Strength Index	3 Jan 2006 3 Jan 18:25 3 Jan 19:05 3 Jan	n 19:45 3 Jan 20:25 3 Jan 21:05	1 Jan 21:45 3 Jan 22:25 3 Jan 23:05	0 3 Jan 23:45 4 Jan 00:25	
	全般」お気に入り	USDJPY,M1 (offline) USDJPY,M5				
×	エキスパートアドバイ ⁺ 。aex4			~	エキスパート設定	
	通貨ペア: USDCHF, United States	Dollar vs. Swiss Franc	\sim	期間: M5 ~	通貨ペアのプロパティ	
	モデル 全ティック(利用可能な最く	い時間枠を使いすべてのティックを生成する、最も	も正確な方法)~	ブレッド: 20 〜	チャートを開く	
J.					スタート	
テスタ	セッティング 操作履歴					

【カワセ係長より】

これはバックテストの画面枠が狭いために起こる現象です。 画面枠の縦が狭すぎて、入力欄が消えてしまっています。

以下のように、オレンジ矢印のあたりをクリックした状態で、上方向に画面を引っ張って みて下さい。

	Momentum Moving Average of Oscillator Relative Strength Index	3 Jan 2006 3 Jan 18:25 3 Jan 19:05 3 Jan 19:45 3 Jan 20:25	3 Jan 21:05 3 Jan 21:45 3 Jan 22:25 3 Jan 23:05	0 3 Jan 23:45 4 Jan 00:25
×	全般」お気に入り	USDJPY,M1 (offline) USDJPY,M5		
	ユキスパートアトバイ・マー 通貨ペア: USDCHF, United States	Dollar vs. Swiss Franc 🗸 🗸		エキスパート設定 通貨ペアのプロパティ
	モデルは全ティック(利用可能な最小	い時間枠を使いすべてのティックを生成する、最も正確な方法) >	スプレッド 20 ー	チャートを開く
J A				スタート
Ę	セッティング 操作履歴			

バックテスト期間を入力する欄や、ビジュアルモードの選択欄が出てきます。

	Momentu Movina Av	m verage of Oscillator →	3 Jan 2006	3 Jan 18:25	3 Jan 19:05	3 Jan 19:45	3 Jan 20:25	3 Jan 21:05	3 Jan 21:45	3 Jan 22:25	3 Jan 23:05	3 Jan 23:45	0 4 Jan 00:25
	<u>全般</u> お気に入り		USDJPY,	M1 (offline)	USDJPY, N	/15							
×	エキスパートアドバイ・〜	aex4									~	エキスパ	一下設定
	通貨ペア:	USDCHF, United State	s Dollar vs. Si	wiss Franc			~		期間	M5	\sim	通貨ペア(Dプロパティ
	モデル:	全ティック(利用可能な最	小時間枠を使	いすべてのティ	ックを生成する、	最も正確な	;方法)〜		スプレッド:	20	~	チャー	トを開く
	期間を指定 ✔	開始日	2006.01.01	-		終了日	2006.10.01			1	最適化 🗌	エキスパ	一卜編集
	ビジュアルモード]		11	スキップ		2020.10.29						
J.												スタ	! - F
テスら	セッティング 操作履歴												