

【参考資料】 バックテスト合格ラインの目安

この資料の使い方

この資料は、リアルトレードに移行する為の基準として、合格ラインとなるバックテスト結果の値を表にしたものです。

システムトレード初心者が始めて戦略を作成する場合、注目する項目及び、合格ラインの目安があることで、戦略の改善も効率的に実施されやすいと思い作成しました。
(その為、システムトレード初心者向けの資料となっております。)

リスクが違う3つのパターンを用意しましたので、ご自身の戦略に合わせて参考にして頂ければと思います。

※バックテストの実施方法については、「iTRADE 操作説明」マニュアルをご確認ください。

<http://itrade.tokyo/download/itrade-function.pdf>

注目する項目及び、目標値

【前提条件】

- ・資金300万単利運用でバックテストした場合。
- ・戦略バスケット全体の成績。

項目	ローリスク・ ローリターン	ミドルリスク・ ミドルリターン	ハイリスク・ ハイリターン
累積ネット損益%(年間)	15%	30%	50%
総取引回数(年間)	20回以上	50回以上	100回以上
平均損益%	2%以上	1%以上	0.6%以上
最大DD%	15%以内	30%以内	40%以内
平均スターリングレシオ	0.6%以上	0.6%以上	0.6%以上

項目の説明

	ALL	gyakubari15	gyakubari16	gyakubari17	gyakubari18	gyakubari19
当初運用資産額	2,000,000	1,000,000	1,000,000	1,000,000	1,000,000	1,000,000
運用資産額	2,000,000	1,000,000	1,000,000	1,000,000	1,000,000	1,000,000
累積ネット損益	+12,985,967	+2,674,090	+2,322,983	+3,503,098	+3,592,436	+893,360
累積ネット損益%	+649.30%	+267.41%	+232.30%	+350.31%	+359.24%	+89.34%
総利益	+23,846,510	+4,337,800	+5,169,230	+6,745,200	+6,109,700	+1,484,580
総損失	-9,967,941	-1,521,945	-2,633,345	-2,988,036	-2,292,345	-532,270
PF(ProfitFactor)	2.39	2.85	1.96	2.26	2.67	2.79
勝率	72.10%	73.15%	65.99%	73.00%	73.92%	77.34%
総取引回数	1,932	298	441	526	464	203
利益取引回数	1,393	218	291	384	343	157
損失取引回数	539	80	150	142	121	46
POR(PayOffRatio)	0.96	1.06	1.03	0.86	0.96	0.86
平均損益%	+4.79%	+5.92%	+3.61%	+4.52%	+5.12%	+5.63%
利益取引平均%	11.16%	12.37%	11.00%	10.85%	10.95%	11.01%
損失取引平均%	-11.68%	-11.67%	-10.72%	-12.61%	-11.40%	-12.74%
平均ポジション保有日数	3.57	3.38	3.80	3.62	3.56	3.22
最大DD日付	2008/10/27	2011/03/15	2008/10/27	2008/10/27	2008/10/27	2008/10/10
最大DD	1,578,072	272,872	379,392	511,277	468,074	132,310
最大DD%日付	2008/10/27	2011/03/15	2008/10/27	2008/10/27	2008/10/27	2008/10/10
最大DD%	78.90%	27.29%	37.94%	51.13%	46.81%	13.23%
平均DD回復日数	22.86	38.87	39.73	26.10	26.72	37.75
最長DD回復日付	2015/08/26	2011/03/18	2016/01/25	2015/08/27	2015/08/26	2011/08/09
最長DD回復日数	232	280	453	233	232	594
期間スターリングレシオ	8.229	9.800	6.123	6.852	7.675	6.752
平均スターリングレシオ	0.789	0.924	0.583	0.663	0.740	0.656

累積ネット損益%

累積ネット損益を当初運用資産額に対する%で表した指標。

累積ネット損益 ÷ 当初運用資産額 × 100[%]

※表は年間の値を記載。

総取引回数

利益取引回数 + 損失取引回数 + 損益0取引回数。

※表は年間の値を記載。

平均損益%

全取引を平均したもの(累積ネット損益%を取引回数で割ったものではない)。

最大DD%

累積ネット損益%が最大のところから最小への下落率。

最大累積ネット損益% - 累積ネット損益%の最小

平均スターリングレシオ

年平均収益率に対するスターリングレシオ。

年平均収益率 ÷ 最大DD%

免責事項

この資料は参考としての一例をご紹介するというものですので、その正確性や完全性等について保証するものではありません。実際の投資はお客様のご判断・ご責任で行って頂くものであり、弊社は、お客様の投資におけるいかなる利益も保証するものではなく、また、お客様の投資によるいかなる損害に対しても補償を行うものでもありません。本書の内容に関する一切の権利は当社にありますので、当社の事前の書面による了解なしに転用・複製・配布することはできません。内容に関するご質問・ご照会等にはお応え致しかねますので、あらかじめご容赦ください。