

はじめに

M.trading は、単純なシステムから極めて複雑なシステム構築まで対応可能です。そのため、設定可能な項目が数多くあります。最初は、シンプルなシステム構築で練習し、徐々に機能を理解しつつオリジナルのシステムを創り上げるのが良いでしょう。

テクニカル指標はワークシート単位（とワークシート[P]のパラメータ部分）で構築していますから、組み込み・削除が簡単にできます。

テクニカル指標だけではなく、なんらかのアイデアをシステムに組み込み試してみたい、という場合もテクニカル指標と同様に M.trading では扱うことができます。ワークシート単位でアイデアを構築しバックテストを行うことができますから、そのアイデアが機能しなかったらそのワークシート（とワークシート[P]のパラメータ部分）を削除すれば元に戻ります。

Excel でのシステム開発は、最初から上手に設計し構築しないと、アイデアを数式にする労力・数式を追加することで発生するバグを修正する労力・検証の労力など、アイデアが機能するかどうか判るまでに大変な時間と労力とがかかります。M.trading の利用で、このような時間と労力とを減らすことができます。

この手引き書では、基本的な使い方から高度な使い方まで、図入りで詳細に説明をしています。

凡例

[オレンジ] パラメータ名・シグナル名・ボタン名など、主に名前を示します。例：[前場開始 A]

[水色] ワークシート名を示します。例：ワークシート[P]

1 紫色の数字は、設定された時刻を示します。
この手引き書では、デイトレード用の時刻設定として、

- 1 [前場開始]
- 2 [前場終了前]
- 3 [前場終了]
- 4 [後場開始]
- 5 [後場終了前]
- 6 [後場終了]
- 7 [夕場開始]
- 8 [夕場終了前]
- 9 [夕場終了]

を前提にしています。

用語

クリアと削除 クリア(Clear) は、値や書式を消すこと。削除は、行・列・セル・チェックボックスそのものを消すこと。

注意事項

掲載されている図は、最新バージョンの画面とは異なる場合があります。

この手引き書に記載されている情報は、予告無く変更される場合があります。

使い方の基本

基本的な M.trading の使い方は以下の順序になります。基本的な使い方の範囲では、チェックボックスのチェックを変更したりパラメータの数字を打ち込んだりするだけで、Excel の関数を入力したりすることはありません。

1. ワークシート[A]に、テストする銘柄の、[日付][時刻][始値][高値][安値][終値]を設定します。

日付	時刻	始値	高値	安値	終値
2006/12/1	9:00:00	16310	16330	16260	16280
2006/12/1	9:15:00	16280	16280	16250	16260
2006/12/1	9:30:00	16270	16280	16240	16250
2006/12/1	9:45:00	16260	16300	16250	16290
2006/12/1	10:00:00	16290	16300	16270	16300
2006/12/1	10:15:00	16300	16380	16300	16350

2. ワークシート[P]の、パラメータ[分足数][前場開始]~[夕場終了]までを設定します。

どてん買	どてん売	分足数
FALSE	FALSE	20

時刻	前場開始A	前場開始B
1 前場開始 9:00:00	0.374305556	0.375694444
2 前場終了前 10:45:00	0.447222222	0.448611111
3 前場終了 11:00:00	0.457638889	0.459027778
4 後場開始 12:30:00	0.520138889	0.521527778
5 後場終了前 14:45:00	0.613888889	0.615277778
6 後場終了 15:00:00	0.624305556	0.625694444
7 夕場開始 16:30:00	0.686805556	0.688194444
8 夕場終了前 18:45:00	0.780555556	0.781944444
9 夕場終了 19:00:00	0.790972222	0.792361111

3. ワークシート[P]の、使用するチェックボックスにチェックを入れたり[OR構築][エントリー停止構築]を行ったりし、数式を作成します。

再計算	フォーム表示	損益合計	勝ち数合計	負け数合計	取引回数合計	1日平均取引回数	日数
		7160	235	390	625	2.638244	236.9
数式明示	パラメータ数とその数式	And					
	買Entry	1	モメンタムA = +1				
OR構築	売Entry	1	モメンタムA = -1				
	買Exit	1	モメンタムA = -1				
エントリー停止構築	売Exit	1	モメンタムA = +1				
		And				OR	
ワークシート名	シグナル名	買いEntry	売りEntry	買いExit	売りExit	1	-1
	OR 4 Short						
モメンタム	モメンタムA	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>		
	モメンタムB	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>		

4. ワークシート[S]で、使用するワークシート名にチェックを入れて、四本値の最終行に合わせます。

チェックしたワークシートに対して		未チェックのワークシートに対して	
<input checked="" type="checkbox"/> 最終行に合わせる	<input checked="" type="checkbox"/> 数字10行を合わせる	<input type="checkbox"/> 黄色のセルより下をクリアする	
[OR]フィルダウンが必要	FALSE		チェックボックス
[停止]フィルダウンが必要	FALSE	1070	<input checked="" type="checkbox"/> 全てチェックする <input type="checkbox"/> 全てクリアする

ワークシート名	行	計算	処理時間
<input checked="" type="checkbox"/> A	5738	ON	1分14秒
<input type="checkbox"/> OR	Clear	OFF	0分00秒
<input type="checkbox"/> 停止	Clear	OFF	0分01秒
<input checked="" type="checkbox"/> モメンタム	5738	ON	0分06秒
<input type="checkbox"/> サイコロ	Clear	OFF	0分01秒
<input type="checkbox"/> RCI	Clear	OFF	0分00秒

5. ユーザフォーム[パラメータ設定]を表示して、パラメータを変更し[再計算]を行い、バックテストを行います。

フォーム表示	損益合計	勝ち数合計	負け数合計	取引回数合計	1日平均取引
<input checked="" type="checkbox"/>					

パラメータ設定

再計算

エンベロープ: HL ピボット: MACD MA

初期: 特定時刻 A: モメンタム サイコロ

モメンタムA: モメンタムB:

6. ワークシート[R]で[パラメータ探索]を行い、表を作成し、堅牢なパラメータ設定を探索します。

	名前	開始	終了	ステップ	回数
numA	モメンタムA	2	50	2	25
numB					
numC					

numA,B,Cが対等。

numA<numB numAの数字より常にnumBが大きい。

numB<numC numBの数字より常にnumCが大きい。

numA<numB<numC numAの数字より常にnumBが大きい。かつ、numBの数字より常にnumCが大きい。

<input checked="" type="button" value="実行"/>	<input type="button" value="中断"/>	<input type="button" value="テスト実行"/>
--	-----------------------------------	--------------------------------------