



バックテスト及びオプティマイズ



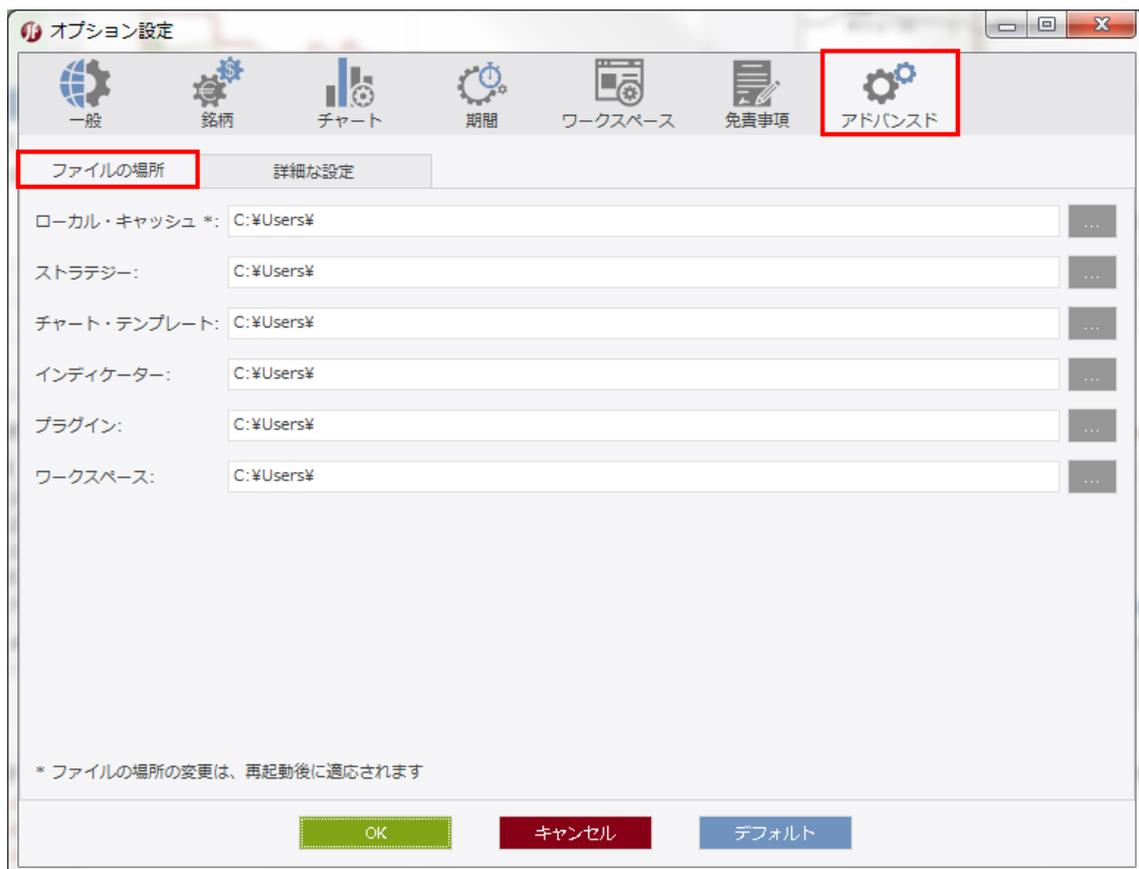
1. バックテスト

JForex は、Java プログラミング言語でプログラミングしたストラテジー（自動売買プログラム）の自動取引が利用いただけます。ストラテジーの動作や性能は、ヒストリカル・データを使用し、バックテストいただけます。バックテストで得られる結果は、ヒストリカル・データにもとづく過去の結果です。バックテストで得られた結果を将来にわたって保証するものではありません。

※ストラテジー（自動売買プログラム）は、お客様ご自身で用意ください。

1.1 ストラテジーの保存先を確認します。

- 1 JForex 画面左上のメニューバーから「設定」内の「オプション設定」を選択します。
- 2 オプション設定画面の「アドバンス」内の「ファイルの場所」を選択します。
- 3 ファイルの場所は、ストラテジーやインディケータの保存先です。（ここでは保存できません。）

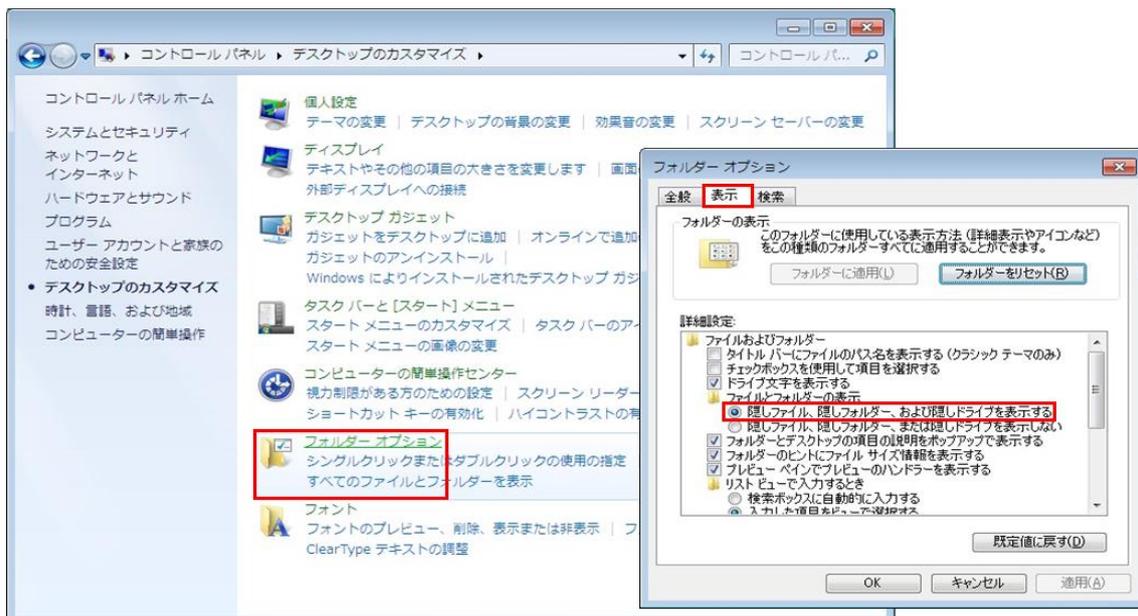


補足、「AppData」フォルダの表示方法

初期のファイルの場所（ストラテジーやインディケーターの保存先）は、「AppData」フォルダです。

「AppData」フォルダは、隠しフォルダです。フォルダ・オプションで表示する必要があります。

- ① 「スタート・メニュー」から「コントロールパネル」を選択します。
- ② コントロールパネル画面の「フォルダ・オプション」を選択します。
- ③ フォルダ・オプション画面の「表示」内の「隠しファイル、隠しフォルダ、および、隠しドライブを表示する」のラジオ・ボタンを選択します。



1.2 ストラテジーを保存します。

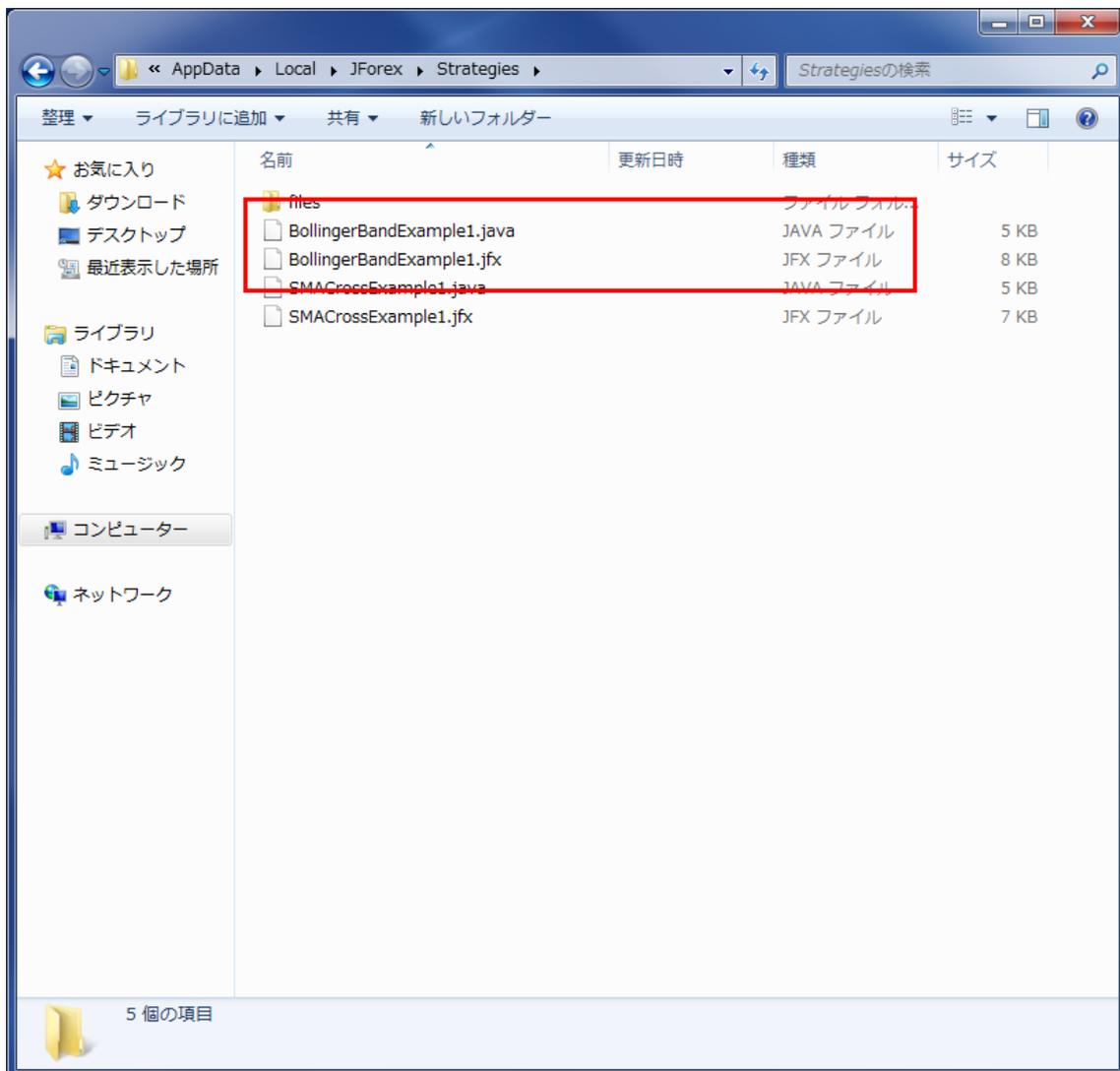
例、ストラテジーの「BollingerBandExample1」

ストラテジーの拡張子は、「.java」と「.jfx」です。

「.java」拡張子は、プログラムファイル（ソースコード）です。

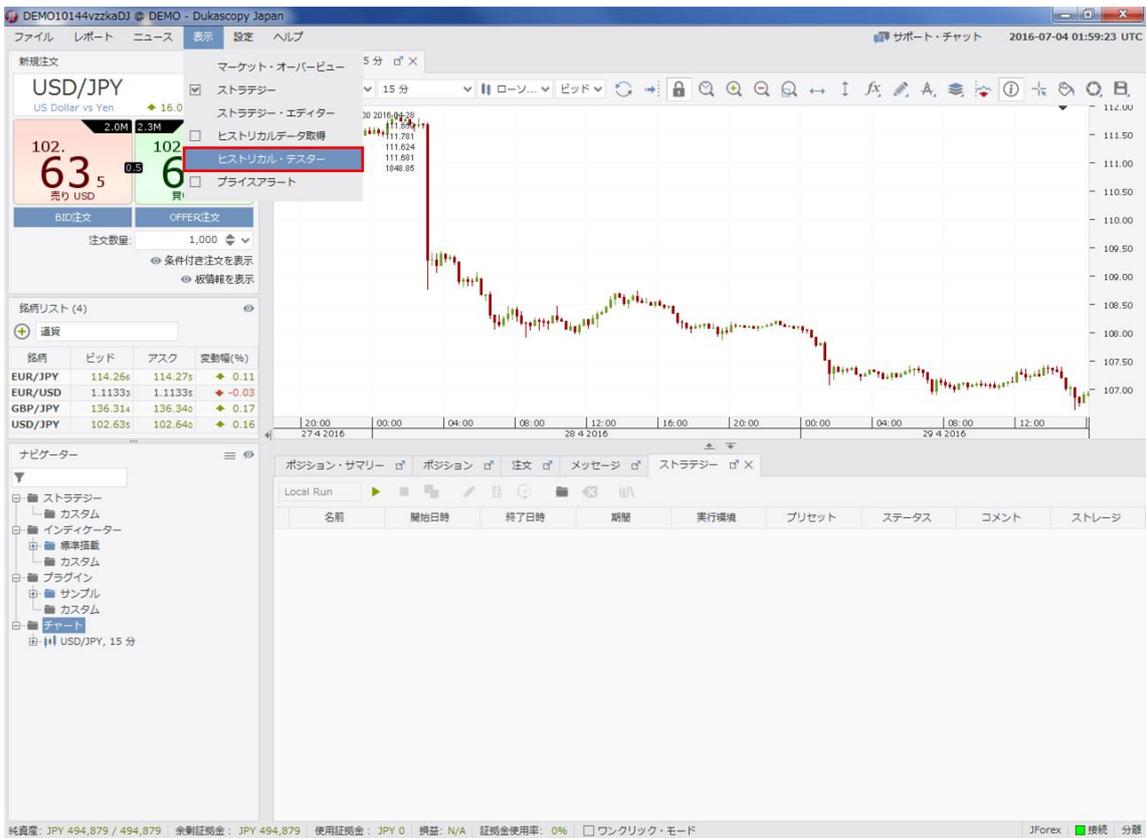
「.jfx」拡張子は、実行ファイルです。

確認した保存先にストラテジーを保存します。



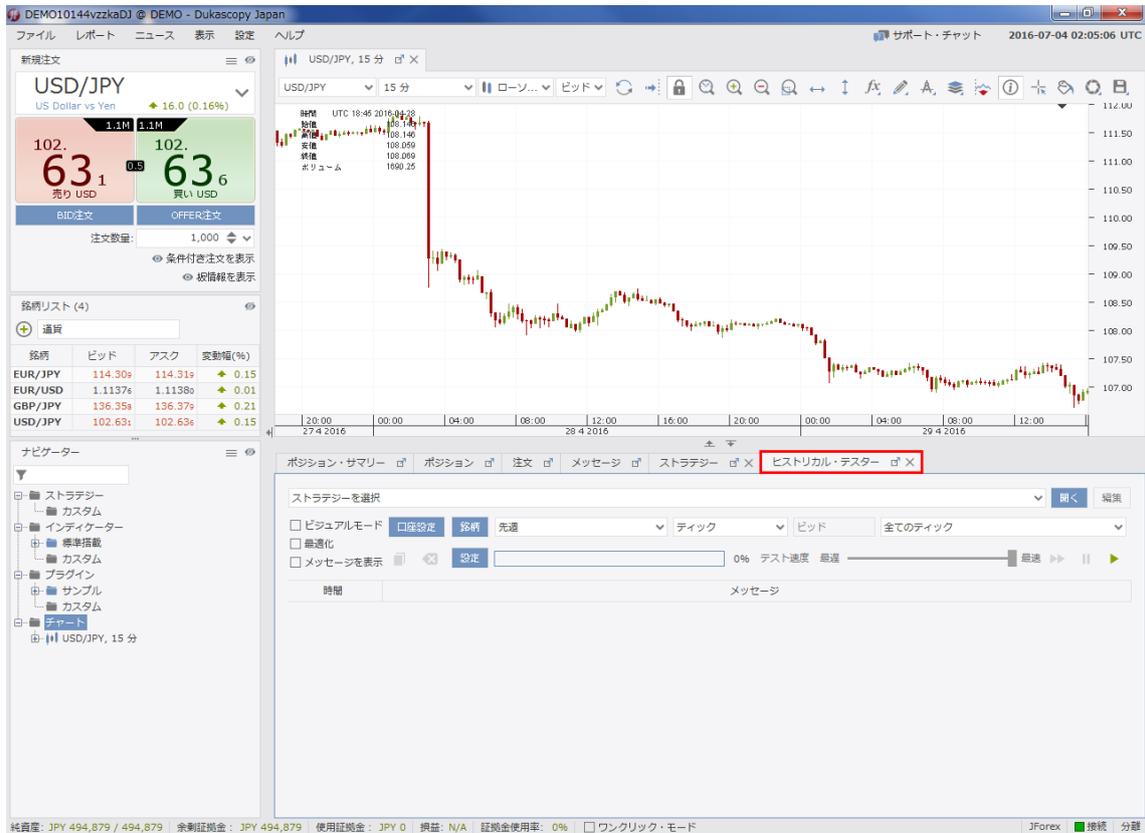
1.3 ヒストリカル・テスターを開きます。

- 1 JForex 画面左上のメニューバーから「表示」内の「ヒストリカル・テスター」を選択します。
- 2 「ヒストリカル・テスター」タブが表示されます。

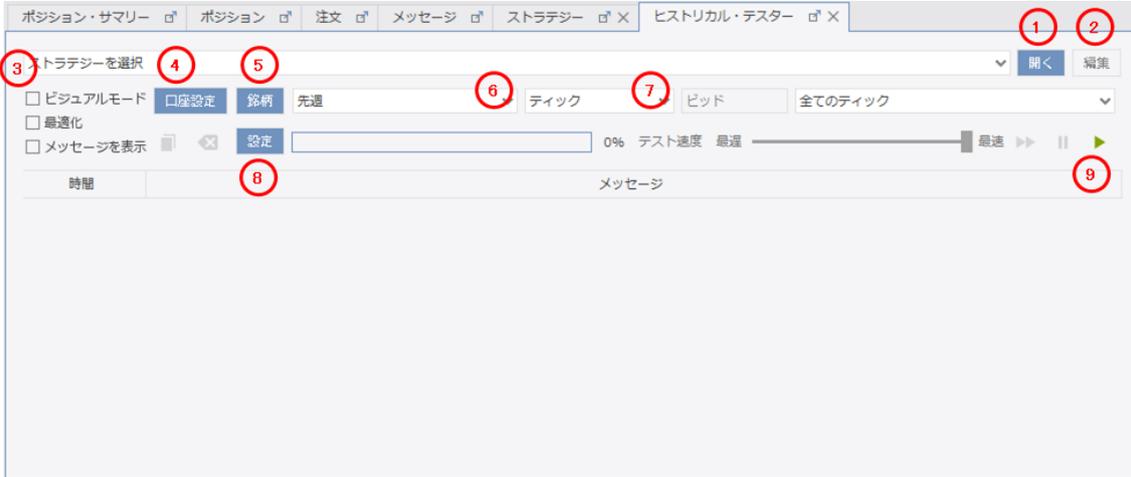


The screenshot displays the JForex trading platform interface. The main window title is "DEMO10144vzkaDj @ DEMO - Dukascopy Japan". The top menu bar includes "ファイル", "レポート", "ニュース", "表示", "設定", and "ヘルプ". The "表示" (View) menu is open, showing options like "マーケット・オーバービュー", "ストラテジー", "ストラテジー・エディター", "ヒストリカルデータ取得", "ヒストリカル・テスター" (highlighted with a red box), and "プライスアラート". The main chart area shows a candlestick price chart for USD/JPY with a 15-minute timeframe. The left sidebar contains a "新規注文" (New Order) section for USD/JPY, a "銘柄リスト (4)" (Instrument List) table, and a "ナビゲーター" (Navigator) section. The "ナビゲーター" section shows a tree view with "ヒストリカル・テスター" selected. The bottom status bar displays account information: "総資産: JPY 494,879 / 494,879", "余剰証拠金: JPY 494,879", "使用証拠金: JPY 0", "損益: N/A", "証拠金使用率: 0%", and "JForex 接続 分".

銘柄	ビッド	アスク	変動幅(%)
EUR/JPY	114.266	114.275	▲ 0.11
EUR/USD	1.11333	1.11336	▲ -0.03
GBP/JPY	136.314	136.340	▲ 0.17
USD/JPY	102.635	102.640	▲ 0.16



1.4 「ヒストリカル・テスター」を起動します。



①開く

保存したストラテジーを呼び出します。

②編集

①のストラテジー・エディターを呼び出します。

③ビジュアルモード

バックテスト時、チャートを開き、バックテスト結果を描画します。

最適化

ストラテジーのパラメータを最適化します。

メッセージを表示

メッセージを表示します。

④口座設定

初回入金額：想定入金金額を入力します。

口座通貨：日本円を選択します。

レバレッジ：レバレッジを入力します。

※個人口座のレバレッジは、25 倍までです

MC（マージンカット）：100

※証拠金使用率 100%以上で強制ロスカットです。

MC Equity：2000

※強制ロスカットのほか、お客様ご自身で純資産額にロスカット水準を設定できます。初期設定は 2,000 円です。

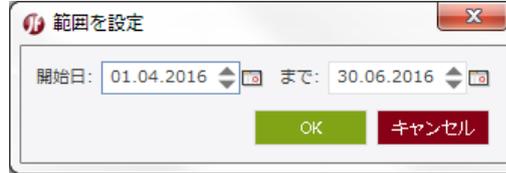
⑤銘柄

バックテストする銘柄を選択します。

⑥バックテストの期間

バックテストする期間を選択します。

イントラデイ（当日）、昨日、先週、先月、過去3ヶ月、過去6ヶ月、
昨年のほか、期間をカスタマイズできます。



⑦ヒストリカルデータの期間

バックテストに使用するヒストリカルデータを選択します。

期間：ティック、1分、1時間、1日

ビッド/アスク：ビッドまたはアスク

モデル：ティックのフィルタリング

期間：ティック選択時



期間：1分、1時間、1日選択時



⑧設定

ビジュアルモード時の純資産/残高/損益の表示、ビジュアルモード時
のチャート時間枠等を設定します。

⑨▷（スタート・ボタン）

バックテストを開始します。

1.5 バックテストを開始します。

① 「ヒストリカル・テスター」の「▷ (スタート・ボタン)」を押下します。

② 「ストラテジー」のパラメーターを入力します。

※ ストラテジーによって、「パラメーター」が異なります。

※ 「BollingerBandExample1」のパラメータは、以下の通りです。

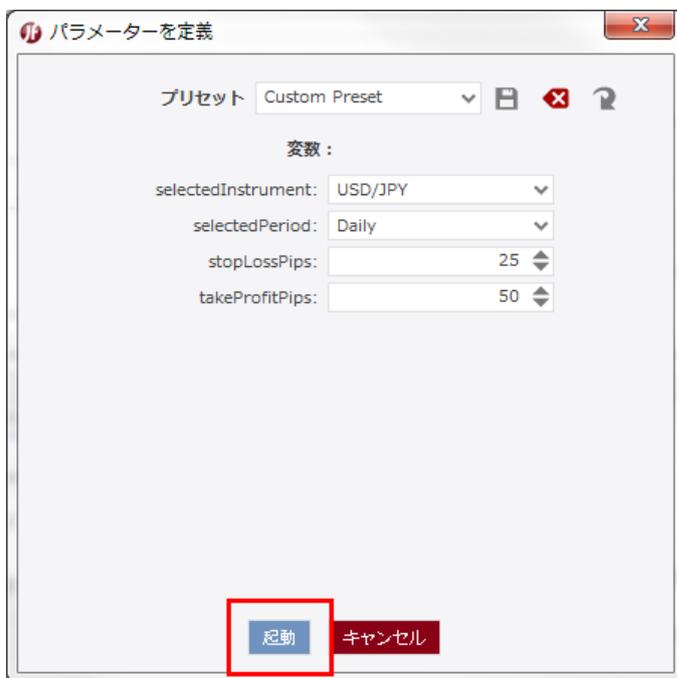
selectInstrument : 銘柄

selectedPeriod : バックテストの時間枠

stopLossPips : ストップロスのピップス

takeProfitPips : テイクプロフィットのピップス

③ 「起動」を押下します。



1.6 「レポート」



BollingerBandExample1 strategy report for USD/JPY instrument(s) from 2016-06-01 00:00:00 to 2016-07-01 00:00:00

Account Currency	JPY
Initial deposit	200000
Final deposit	175157.98
Turnover	189470653
Commission	929.24

Parameters

selectedInstrument	USD/JPY
selectedPeriod	Daily
stopLossPips	25
takeProfitPips	50

Instrument USD/JPY

First tick time	2016-06-01 00:00:00
First tick bid value	11094
First tick ask value	11094.8
Last tick time	2016-06-30 22:59:58
Last tick bid value	10309
Last tick ask value	10308
Positions total	2
Closed positions	2
Orders total	2
Bought	0.09
Sold	0.09
Turnover	189470653
Commission	929.24

Opened orders:

Label	Amount	Direction	Open price	Profit/Loss at the end	Profit/Loss at the end in pips	Open date	Comment
-------	--------	-----------	------------	------------------------	--------------------------------	-----------	---------

Closed orders:

Label	Amount	Direction	Open price	Close price	Profit/Loss	Profit/Loss in pips	Open date	Close date	Comment
IVF20160606,00000082749130	0.046527	BUY	107.464	107.204	-12097.02	-26.0	2016-06-07 00:00:00	2016-06-07 14:55:54	
IVF20160628,00000080187774	0.045623	BUY	102.701	102.442	-11816.36	-25.9	2016-06-29 00:00:00	2016-06-29 00:08:11	

Processing statistic:

Function	Time	Calls	Percent
Ticks/Bars internal processing	1m 49s 518.76ms	1119227	34.03%
onTick method calls	1m 39s 745.66ms	980327	30.55%
Ticks/Bars/Account info data writing for charts	1m 30s 448.26ms	2396659	28.1%
Account information calculations	10s 874.97ms	1477755	3.38%
onBar method calls	8s 648.44ms	258200	2.69%
Conditional orders processing	1s 837.85ms	32952	0.0%
Order changes processing "on server side"	282.36ms	2	0.02%
Margin call/cut checks	191.10ms	1051548	0.06%
Indicator calculations	128.83ms	30	0.04%
Historical data calls (including indicators data calls)	63.68ms	30	0.02%
onAccount method calls	31.28ms	358500	0.01%
onStart method calls		1	0%
onStop method calls		1	0%
onMessage method calls		6	0%
Ticks/Bars data reads		0	0%
User tasks (Control asyncio task) processing		0	0%
Other operations		0	0%

Event log:

Time	Event type	Event text
2016-06-01 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-02 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-03 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-06 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-07 00:00:00	Order submitted	Order [IVF20160606,00000082749130, USD/JPY, BUY, 100000.0 at 0.0] submitted by the strategy
2016-06-07 00:00:00	Order filled	Order [IVF20160606,00000082749130, USD/JPY, BUY, 46527.0 at 107.464] filled
2016-06-07 14:55:54	Order closed	Order [IVF20160606,00000082749130, USD/JPY, BUY, 46527.0 at 107.464] closed by stop loss event, amount 46527.0 at 107.204
2016-06-07 21:00:00	Commissions	Commissions [4.47]
2016-06-08 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-09 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-10 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-13 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-14 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-15 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-16 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-17 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-20 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-21 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-22 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-23 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-24 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-27 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-28 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-06-29 00:00:00	Order submitted	Order [IVF20160628,00000080187774, USD/JPY, BUY, 100000.0 at 0.0] submitted by the strategy
2016-06-29 00:00:00	Order filled	Order [IVF20160628,00000080187774, USD/JPY, BUY, 45623.0 at 102.701] filled
2016-06-29 00:08:11	Order closed	Order [IVF20160628,00000080187774, USD/JPY, BUY, 45623.0 at 102.701] closed by stop loss event, amount 45623.0 at 102.442
2016-06-29 21:00:00	Commissions	Commissions [4.57]
2016-06-30 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]
2016-07-01 21:00:00	Commissions	Commissions [0.0]