

2007年7月25日 KFシステムクリエイター[拡張版]の概要

KFシステムクリエイター[拡張版]では、ほとんどの操作をサマリーから行なえるようになりました。株価データを読み込んだ後(サマリーシートから開いても大丈夫です)、サマリーの起点日にテスト開始日、終点日にテスト終了日を入力し、テスト対象を指標の一覧から選択します。その後、従来版と同様に最適化演算を行なってパラメータを設定すれば、サマリーの内容が更新されます。

指標やチャートの種類・内容等につきましては、[ここからサンプルシートをダウンロード](#)してご確認ください。なお、これはあくまで仕様のサンプルであり、データは全て結果の値のみが入力されています。システムシートの内容につきましても、チャートを表示するための最低限のデータに限っています。

サマリーシートに記載された評価項目は、全て最適化演算の対象にできます。そして最適化演算の結果決定されたパラメータを設定することにより、全ての指標がリアルタイムで更新されます。サマリーのテスト開始日、テスト終了日は、実際に最適化演算を行なったテスト期間であり、その後の運用場面では、起点日と終点日を指定します。

全ての指標は、この起点日から終点日までの期間で計算されます。これらを変更することで、任意の期間におけるバックテストやフォワードテストが可能となります。テスト開始日とテスト終了日に入力する日付は、あくまでパラメータを決定するための最適化演算を行なった際の条件であり、この値が下の各指標の値に影響を与えることはありません。

サマリーの売買判定欄には、終点日が引けた時点の売買の状態が表示されます。ここに、例えば"買いHOLD"と表示されたら、翌日は買い保有継続となります。"売り"と表示されたら、買いシステムの場合は翌寄付きで手仕舞いとなります。

そのため、フォワードテスト等を行なうのでないならば、終点日は常に最新の日付にしておきます。場合によりましたら、このセルの内容を「=today()」に変更しておいてもいいかもしれません。

株価データの更新を先に行なっておく必要がありますが、システムを開いた段階で最新データに更新されます。運用中のシステムの日々の更新が煩わしい方は、試してみられてはいかがでしょうか。

また、テスト対象を指定したら、指定したセルを任意の色で塗りつぶしておく、何を最適化したのかが後で分かり易くなります。当初はテスト対象を指定したら、そのシステムと指標名とが自動的に表示されるようにしたかったのですが、私の力不足ではできませんでした。

なお、サンプルシートにおきましては、一応銘柄名は伏せさせていただきます。もっとも、株価の推移を見れば一目瞭然だとは思いますが。

また、パラメータが特定される恐れがあるため、チャートの一部の表示を削除しています。

これは、ある銘柄の移動平均システムにおいて、買い運用時の時価基準ドローダウンが最小となるように最適化を行なった結果です。もちろん、これはKFシステムクリエイター[拡張版]の仕様を確認していただくための一例であり、これがベストなシステム、あるいは最適なパラメータというわけではありません。

各種条件で最適化を行い、その結果を保存しておきたい場合は、サマリーシート全体を選択してコピーし、それを他のシートやブックに複製写してください。

さまざまな条件における検討結果を、簡単に保存しておくことができます。

以上、KFシステムクリエイター[拡張版]の概要について、説明いたしました。ユーザーの方はもとより、KFシステムクリエイターのご購入を検討されている方も、ご不明な点等ございましたら、[お問い合わせページ](#)よりお気軽にお問い合わせください。