

2007年8月31日 KFシステムクリエイター改定のお知らせ

かねてよりアナウンスしておりました、KFシステムクリエイターの改定作業が完了いたしました。ダウンロードページの製品ファイルを更新いたしましたので、ユーザーの方はダウンロードをお願いいたします。
なお、更新はC～Fのシステムファイルのみで、取扱説明書および株価データの更新はありません。

また、今回から従来システムを[簡易版]に名称変更し、[拡張版]同様に更新いたしました。これは[拡張版]から損益率やドローダウンの部分を除いたもので、対応性能指標としては一番最初にリリースしたシステムと同じものです。それにサマリーシートを追加し、使い勝手を向上させています。演算負荷を気にされる方は、こちらをお試しください。

[拡張版]には、多くの性能指標を追加したため、かなり重い作りとなってしまいました。最適化演算に要する時間は、これまでの[拡張版]に対して3割増、[簡易版]に対して2倍程度となっています。
PCの性能が十分でない方は、以下に述べる高速化をお試しください。

まずは、お使いのPCが最高性能の設定になっているかどうかをご確認ください。PCによっては、省エネのために標準でパワーセーブの設定になっている場合があります。
立ち上げ時のセットアップ画面などから、設定を変更できる場合があります。詳しくはお使いのPCの説明書をご覧ください。

もう一つは、エクセルの優先度を上げることです。エクセルの優先度は標準で"通常"となっていますが、これを"高"にすることで、高速化が図れます。
設定の仕方は次の通りです。なお、事前にエクセルを起動しておいてください。

- ①タスクバーにカーソルを寄せ、右クリックメニューからタスクマネージャを起動します。
- ②プロセスタブを開いて、"表示"メニューから"列の選択"を選び、"基本優先度"にチェックを入れ"OK"を押します(この操作は最初の1回のみでOKです)。
- ③エクセルのプロセス(イメージ名excel.exe)を選択し、右クリックメニューから"優先度の設定"を開いて"高"にチェックを入れます。
- ④警告ダイアログが出ますが、"はい"を選択します。これで、高速化の設定になります。PCや常駐ソフトの状態にもよりますが、私の環境では2割程度の高速化が図れました。
- ⑤この設定は、エクセルを終了すると初期設定に戻ります。常に"高"設定で使いたい場合は、エクセル起動の度に設定してやる必用があります。

[拡張版]では、新たに次の性能指標やチャートを追加しました。

- ①最大ETD、最大STD、および、ETD、STDの時系列チャート。
- ②時価(値洗い)累積損益率、および、そのチャート。
- ③時価累計、時価累積、簿価累計、簿価累積の、最大DD、最大DD期間(回復期間)、平均DD期間(回復期間)、および、それらの時系列チャート。

また、最適化演算時のテーブル選択を、サマリーシート上でテーブルNo.を入力するだけで可能にしました。また、ここに1か2以外の入力(例えば0など)を行なうと、パラメータの手動設定ができるようにいたしました。
手動設定のセルに数値を入力することで、それに応じた結果が直ちに反映されます。

それ以外の使い方は、従来と同様です。新たに追加した性能指標の意味などについては、以下の通りです。

- ①ETD:トレード毎の最大評価益からの下落率。最大ETDは、全トレードにおけるETDの最大値。
- ②STD:トレード毎の最大評価損。最大STDは、全トレードにおけるSTDの最大値。なお、KFシステムクリエイターでは、最大評価損からの回復過程をSTD2として求めています。
- ③時価累計DD:時価基準のドローダウンを累計したもの。
- ④時価累積DD:時価基準のドローダウンを累積したもの。複利損益のドローダウン。
- ⑤簿価累計DD:簿価基準のドローダウンを累計したもの。
- ⑥簿価累積DD:簿価基準のドローダウンを累積したもの。複利損益のドローダウン。

その他、ご不明な点等ございましたら、お問い合わせください。なお、更新にあたっては、十分に確認をしたつもりですが、万一バグ等発見されましたら、当方までご連絡いただくと幸いです。