

シストレ魂【フリー版】 操作マニュアル

Ver.2.0.18

もくじ

● 第1章：シストレ魂【フリー版】のインストール	6
1-1) ダウンロード、インストール.....	6
1-2) シストレ魂のアンインストール.....	12
● 第2章：株価データの取得	13
2-1) データゲット社のアカウント作成.....	14
2-2) データゲット社のアクセス権の購入.....	18
2-3) 株価データの初期化（1998年～）.....	22
2-4) 1990年以降データの初期化（10年CD利用）.....	27
2-5) 毎日の株価データ更新.....	36
2-5-1) 自動更新.....	36
2-5-2) 手動更新.....	38
2-6) 海外データ取得.....	45
2-6-1) Yahoo! Finance.....	46
2-6-2) Tiingo.....	48
● 第3章：売買ストラテジーの作成	50
3-1) ルール設定.....	51
3-1-1) トレード対象.....	52
グループファイル、除外銘柄リストファイルのフォーマット.....	54
ユーザー定義データ.....	54
3-1-2) 仕掛け条件.....	56
3-1-3) 手仕舞い条件.....	57
3-1-4) 資金管理.....	58
1日あたりの最大仕掛け量.....	58
※ 仕掛け時の余力消費について.....	58

最大レバレッジ	59
ポジションサイジング（1 銘柄あたりのポジションサイズ上下限）	59
ポジションサイズは最小でも××円以上とする。	64
仕掛け銘柄優先順位	64
3-1-5) その他	65
3-2) シグナル設定	68
3-3) 全体設定	71
「バックテスト初期資産」	71
「現物、信用」	71
「最大レバレッジ」	71
「取引コスト」	71
「1 日あたり最大仕掛け銘柄数」	72
「最大保有銘柄数」	72
「成行注文時の余力消費方式」	72
「ルール優先度」	72
3-4) 条件作成操作方法（条件ツリーの操作）	74
3-4-1) 条件の追加	75
3-4-2) テクニカル指標の選択、パラメータの設定	79
3-4-3) テクニカル指標のタイプ	80
通常のテクニカル指標	80
連動性指標	82
騰落レシオ	82
相対ランキング	83
シグナル	84
ポジション状態量	85
3-4-3) 条件の無効化・有効化	85
3-4-4) 条件の削除	86
3-4-5) 条件の編集	87
3-4-6) シグナル判定条件のインポート	88
3-4-7) 条件のドラッグ&ドロップ（移動とコピー）	88
3-4-8) 条件文のコピー&ペースト	89

● 第 4 章：バックテスト	91
4-1) 全体サマリ	93
4-2) トレード履歴	93
4-3) 時系列	94
4-4) 資産グラフ	96
4-5) 年次サマリ	97
4-6) 市場別サマリ	97
4-7) 銘柄別サマリ	98
4-8) 業種別サマリ	98
4-9) 価格帯別サマリ	99
4-10) 損益率ヒストグラム	99
4-11) ポジション状態ビュー	100
● 第 5 章：売買指示	101
当日日付	102
当日現金残高	102
当日ポジションファイル	102
引け後 (Data-Get)	103
引け前(タワー)・・・リアルタイム売買指示	104
自動発注機能	104
仕掛け	106
手仕舞い	106
見送り	107
すべての執行方法の指示を表示する	107
売買指示ファイルの自動保存機能について	107
● 第 6 章：発注魂（自動発注機能）	109
6-1)発注魂 for 立花証券 e 支店	110
● 第 7 章：株価データビュー	112

● 第 8 章：テクニカル指標計算	115
● 第 9 章：ランキングビュー	116
● 第 10 章：チャートビュー	118
表示されているテクニカル指標の編集・削除・表示色の指定・複製・上 下移動	119
● 第 11 章：連続バックテスト機能	123
● 第 12 章：過去パフォーマンス集計機能	126

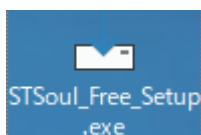
●第1章：シストレ魂【フリー版】のインストール

1-1) ダウンロード、インストール

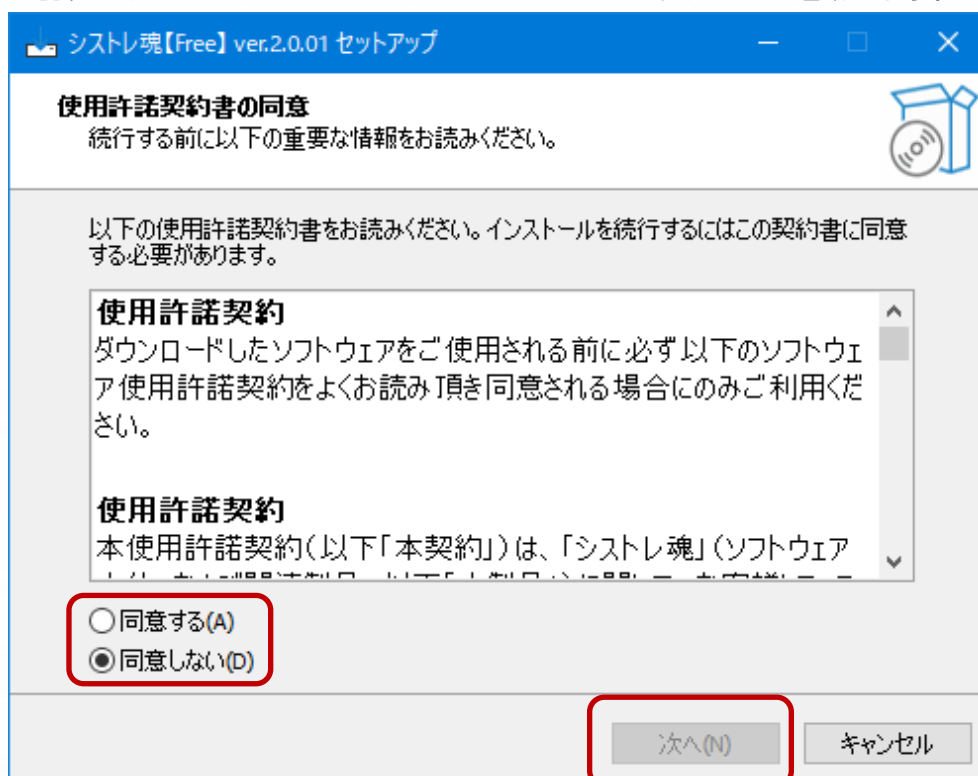
「シストレ魂【フリー版】」は無料のフリーソフトです。
インストーラーを以下のダウンロードページからダウンロードします。

<http://stsoul.com/>

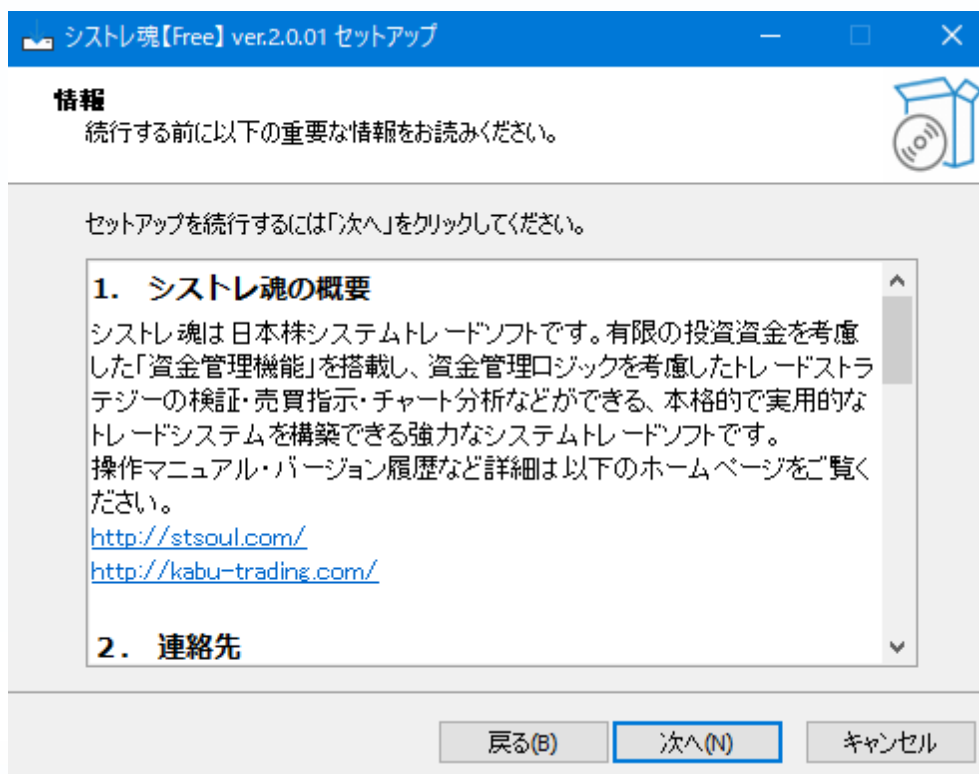
STSoul_Free_Setup.exe というファイルが得られます。



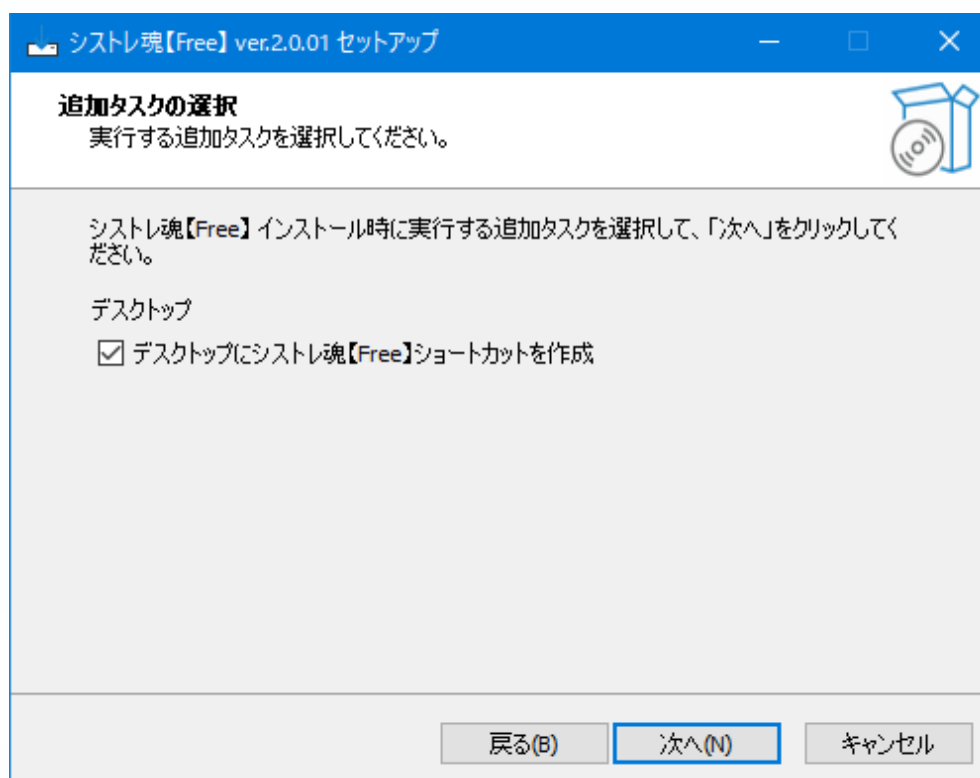
上記、ダウンロードしたインストーラーをダブルクリックして起動します。



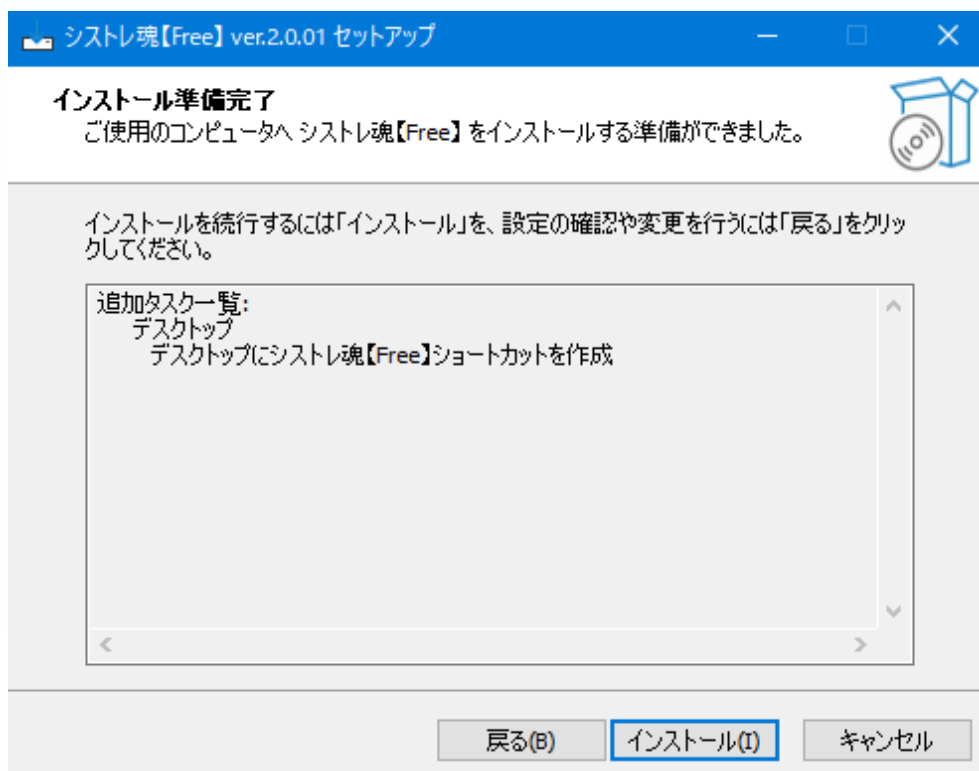
使用許諾契約書が表示されるので「同意する」にチェックして「次へ」を押します。



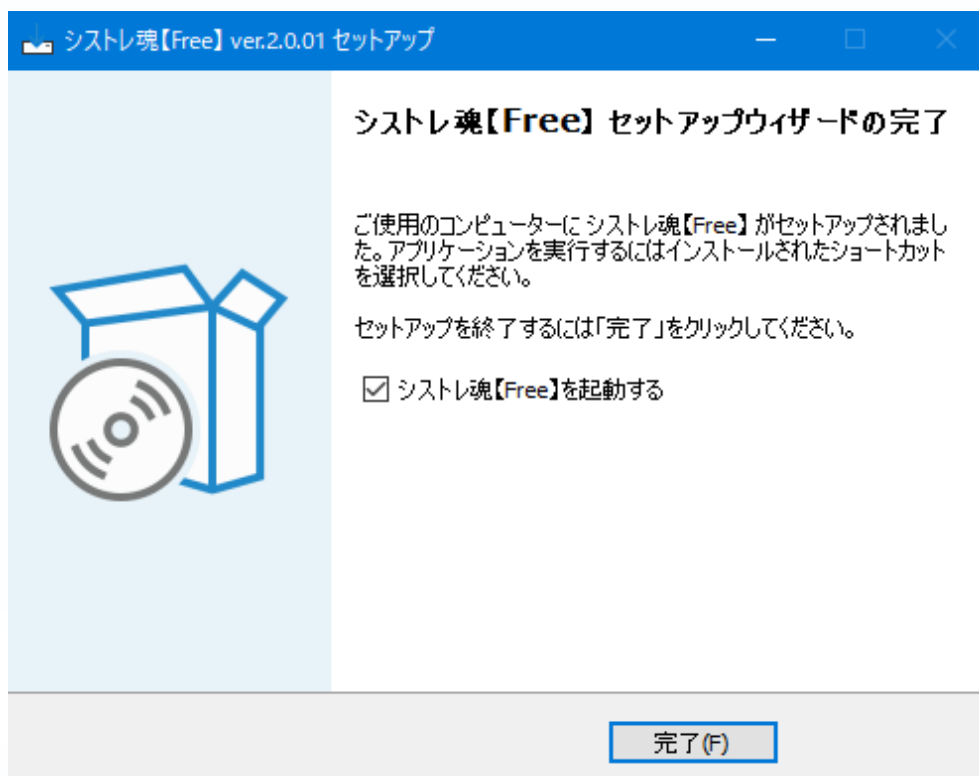
インストール前にソフトウェアの概要説明が表示されます。内容に問題がなければ「次へ」を押します。



デスクトップにショートカットを作成するかどうか選択して「次へ」を押します。



インストールボタンを押せば、インストールが始まります。



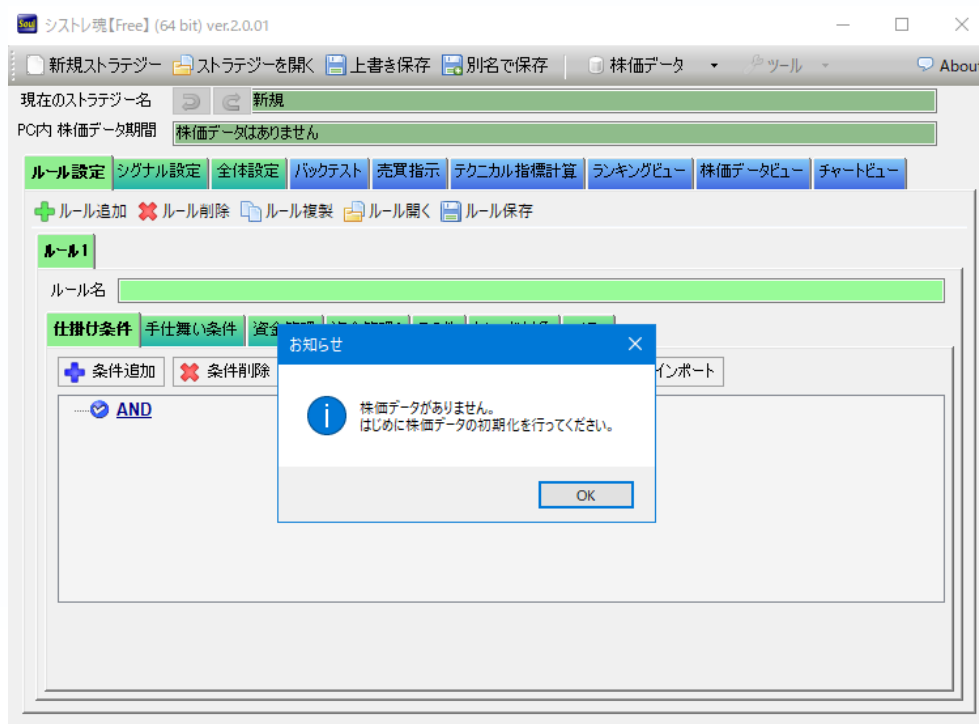
以上でインストールは終了しました。

「シストレ魂【Free】を起動する」をチェックしておくで「完了」ボタンを押すとシストレ魂が起動し、インストーラーは終了します。

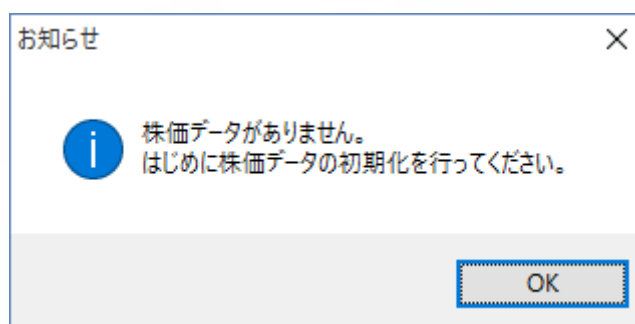
また、デスクトップに以下のアイコンが作成されている場合は



このショートカットをダブルクリックすることで「シストレ魂」が起動します。



初めてインストールした状態では株価データが入っていないので、株価データが存在しないことを示すダイアログが表示されます。



OK ボタンを押して「第2章 株価データの取得」にて、株価データの初期化を行ってください。

1-2) シストレ魂のアンインストール

ご利用のPCからシストレ魂をアンインストールする場合は、通常のアプリケーションと同様に「コントロールパネル」「プログラムのアンインストール」から行います。

ただし、このアンインストールツールではユーザーがシストレ魂を利用して作成されたファイル

- ストラテジーファイル
- 株価データ
- その他ユーザーが保存した設定ファイル
- ユーザーの使用状態保存のための設定ファイル

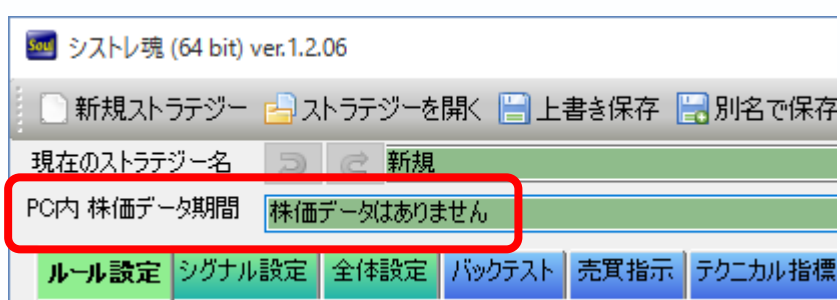
などは削除されないため、これらのユーザーが作成したファイルが不要な場合は以下のフォルダのファイルを手動削除してください。

C:\Users\ {ユーザー名} \Documents\シストレ魂

C:\Users\ {ユーザー名} \AppData\Roaming\シストレ魂 または、 %appdata%\シストレ魂

●第2章：株価データの取得

「シストレ魂」を利用するには、株価データが必要です。最初にPCに「シストレ魂」をインストールした時点では、株価データは一切付属していません。



「シストレ魂」のメイン画面の上部に、PC内の株価データの状態が表示されています。上図は、インストール直後の状態です。「株価データはありません」と表示されています。

株価データの取得には、別途、株価データを配信している「データゲット社」のアカウントを作成（無料）して、有効なアクセス権（有料）を購入しておく必要があります。

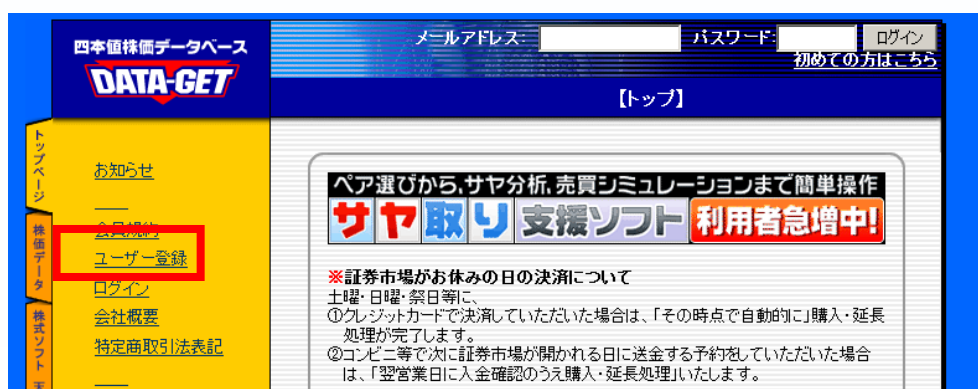
この章では、「データゲット社」より株価データを取得する方法について説明します。

2-1) データゲット社のアカウント作成

はじめに、アカウントを作成します。アカウントの作成は無料です。

<http://www.data-get.com/main/>

上記URLに接続すると次図のようなページが表示されます。



ページ左側のメニューの「ユーザー登録」をクリックします。

●新規ユーザー登録

DATA-GETのサービスを利用する際に、ユーザー登録が必要となります。(登録は無料)
[会員規約](#)をよくお読みいただき、登録をしてください。❓

すでに登録されているユーザーは[こちら](#)でログインしてください。

入力したメールアドレスにパスワードが送信されますので、以下の入力欄に間違いのないように入力して下さい。

***の項目は必ず入力または選択して下さい。**

メールアドレス(半角):*

メールアドレスの再入力(半角):*

お名前(全角):*

○お申し込みありがとうございます

手続きを完了させるには、以下の項目を入力して「次へ」ボタンをクリックして下さい。

メール：

氏名：

フリガナ：

郵便番号：

都道府県：

住所：

電話：

FAX：

リセット

次へ

必要事項を記入して「次へ」ボタンを押してください。確認の画面が出ますので、入力に間違いがなければ「登録」ボタンを押します。

以下のように登録が完了します。

○ユーザー登録が完了しました

ログインに必要なパスワードを 様のメールアドレスに送信しました。

ログインは[こちらのデータ・ゲットのホームページ](#)から行えます。

登録したメールアドレスに、パスワードが記された以下のようなメールが送られてきますので、このメールを保管しておいてください。

このたびは、データ・ゲットのユーザー登録をいただきまして、誠にありがとうございます。
ご登録いただいた ID(メールアドレス)、パスワードは以下の通りです。

ID(メールアドレス): [REDACTED]

パスワード: [REDACTED]

ID及びパスワードはデータのダウンロード時等で必要となることがありますので、大切に保管してください。
なお、パスワードは以下のURLにユーザーログインしてから変更することができます。

<http://www.data-get.com/>

今後とも、よろしくお願いします。

以上で、データゲット社のアカウント作成はできました。

2-2) データゲット社のアクセス権の購入

データゲット社のアクセス権（有償）を購入することで、株価データの配信を受けることができます。

データアクセス権は、2022年4月現在、以下のような価格となっています。

1ヶ月（30日）：1,650円

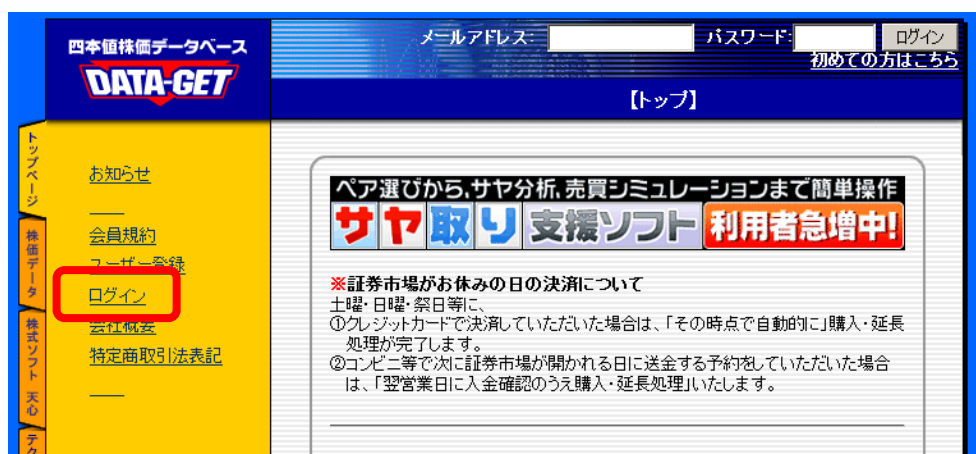
3ヶ月（90日）：4,620円

6ヶ月（180日）：8,580円

1年間（365日）：15,840円

データゲットのトップページを開きます。

<http://www.data-get.com/main/>



左サイドのメニューから「ログイン」をクリックします。

四本値株価データベース
DATA-GET

メールアドレス: パスワード: ログイン
初めての方はこちら

【ログイン】

●ログイン
株価データダウンロードサービスなどをご利用する際に、ユーザーログインが必要となっております。すべての項目を入力してから、「ログイン」をクリックしてください。

メールアドレス(半角)
パスワード(半角)
ログイン

ログインフォームになりますので、登録したメールアドレス、データゲットより送付されたパスワードを入力して、「ログイン」ボタンを押します。

四本値株価データベース
DATA-GET

【株価データアクセス権を購入する】

【ログイン】

●ログインしました
[マイページへ](#)

上図のようにログインが完了します。

上図、画面右上の【株価データアクセス権を購入する】をクリックします。

●登録情報の確認

※下記の登録情報をご確認し、「申し込み」をクリックして下さい。
登録情報を変更する場合、「変更」をクリックして下さい。登録情報
を変更してから、もう一度お申し込みしてください。

メールアドレス:	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX
お名前(全角):	XXXXXXXXXX
郵便番号(半角):	XXXXXXXXXX
都道府県:	XXXXXXXX
住所(全角):	XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX
電話番号(半角):	XXXXXXXXXX
FAX(半角):	

変更

申し込み

登録情報の確認画面が出ますので、「申し込み」ボタンを押します。

●商品の選択

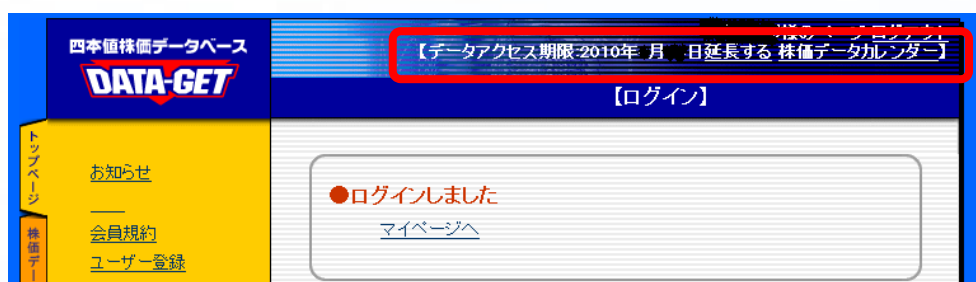
商品を選択してください。

データアクセス 一ヶ月分 (30日)	1,650円	カード,WebMoney,銀行
データアクセス 三ヶ月分 (90日)	4,620円	カード,WebMoney,銀行
データアクセス 六ヶ月分 (180日)	8,580円	WebMoney,銀行
データアクセス 一年間 (365日)	15,840円	WebMoney,銀行
10年株価データCD-ROM	8,800円	カード,WebMoney,銀行

商品を選択して、Web ページの指示に従って購入手続きを進めてください。

以上でアクセス権購入の説明は終わりです。

なお、購入手続きが完了すると、トップページにデータアクセス期限が表示されるようになりますので、確認してください。



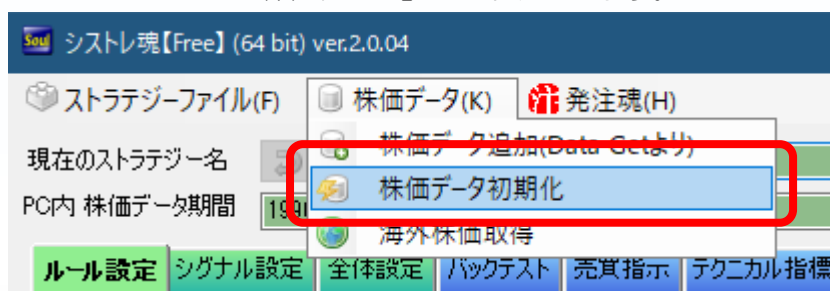
2-3) 株価データの初期化（1998年～）

株価データの取得には、インターネット接続が必要です。PCをインターネットに接続してください。

データゲット社のデータアクセス権を購入すると、「シストレ魂」で株価データをダウンロードすることが可能になります。

「シストレ魂」を起動します。

メインメニューの「株価データ」をクリックします。



プルダウンメニューのうち「株価データ初期化」をクリックします。

株価データの初期化フォームが現れます。

「データソース」

株価データの初期化には 2 種類のデータソースが選択可能です。ひとつはすべてをデータゲットの Web サイトから自動ダウンロードして初期化するもの（この場合 1998 年以降のデータが入手できます）、もうひとつは、データゲット社から販売されている 10 年 CD を利用して 1990 年からのデータを取得するものです。

「同一日に複数市場に上場している場合のデータ処理方法」

データゲット社の配信する株価データには、ある銘柄が同時に複数の市場（東証と大証のように）に上場している場合、その銘柄についてすべての市場の株価データを含んでいます。シストレ魂ではひとつの銘柄はひとつの株価の時系列を持ちますので、どの市場のデータを株価データとして採用するか？の処理方法をユーザーが選択可能です。「市場による優先順位を採用」（デフォルト動作）を選択した場合、東証 1 部 ← 東証 2 部 ← 大証 ← ジャスダック ← マザーズ ← ヘラクレス。という優先順にしたがって株価データを採用していきます。「出来高の多い市場を採用」を選択すると、もっとも出来高の多い市場の株価を採用します。

株価データの初期化では、株価データをデータゲット社よりダウンロードして過去の株価データをPCにインポートします。

データゲットの株価データのダウンロードは、1998年以降のデータがダウンロード可能です。1998年以前、1990年以降のデータを利用したい場合は、別途データゲット社より10年CDを購入する必要があります。

ここではダウンロードによる初期化を説明します。

「データゲットからダウンロードして初期化（1998年～）」
をチェックして選択します。

- ①データゲットのユーザID（メールアドレス）とパスワードを入力します。
- ②「初期化開始」ボタンを押します。

なお、「パスワード表示」にチェックを入れると、入力されたパスワードを確認することが出来ます。入力ミスのチェックなどに利用できます。

株価データの初期化

株価データをすべて初期化します。

初期化開始 中止

データソース

データゲットからダウンロードして初期化(1998年～) パスワード表示
データゲットID(メールアドレス) データゲットパスワード *****

データゲット「10年CD」から初期化(1990年～) 10年CD内の「株価データ」フォルダを指定します
CDの場所 参照

同一日に複数市場に上場している場合のデータの処理方法

市場による優先順を採用(東1、東2、大証、ジャス、マザ、ヘラの順)【デフォルト】
 出来高の多い市場を採用

株価データフォルダ消去

1998年1月度データダウンロード
1998年2月度データダウンロード
1998年3月度データダウンロード

上図のように、株価データのダウンロードが始まります。

株価データの初期化

株価データをすべて初期化します。

初期化開始 中止

データソース

データゲットからダウンロードして初期化(1998年～) パスワード表示
データゲットID(メールアドレス) データゲットパスワード *****

データゲット「10年CD」から初期化(1990年～) 10年CD内の「株価データ」フォルダを指定します
CDの場所 参照

同一日に複数市場に上場している場合のデータの処理方法

市場による優先順を採用(東1、東2、大証、ジャス、マザ、ヘラの順)【デフォルト】
 出来高の多い市場を採用

2015/09/01のデータはありません
データ書き込み中.....
銘柄リスト1ダウンロード
銘柄リスト2ダウンロード
調整係数2ダウンロード
銘柄情報ダウンロード
調整係数(2)ダウンロード
株価データ初期化処理終了

上図のように、数分程度にて、直近の株価データまでのダウンロードが終了します。「x」ボタンを押して、フォームを閉じてください。



「シストレ魂」のメイン画面にて、PC内に1998年1月5日以降のデータがダウンロードできたことが表示されました。

以上で、ダウンロードによる株価データの初期化ができました。

2-4) 1990 年以降データの初期化（10 年CD利用）

1990 年以降、2002 年以前の株価データを利用したい場合は、データゲット社が販売する 10 年株価 CD-ROM を別途購入する必要があります。



データゲット社のホームページのアクセス権の購入の画面にて「株価データ」タブをクリックして、「10 年株価データCD」をクリックして購入手続きを進めてください。

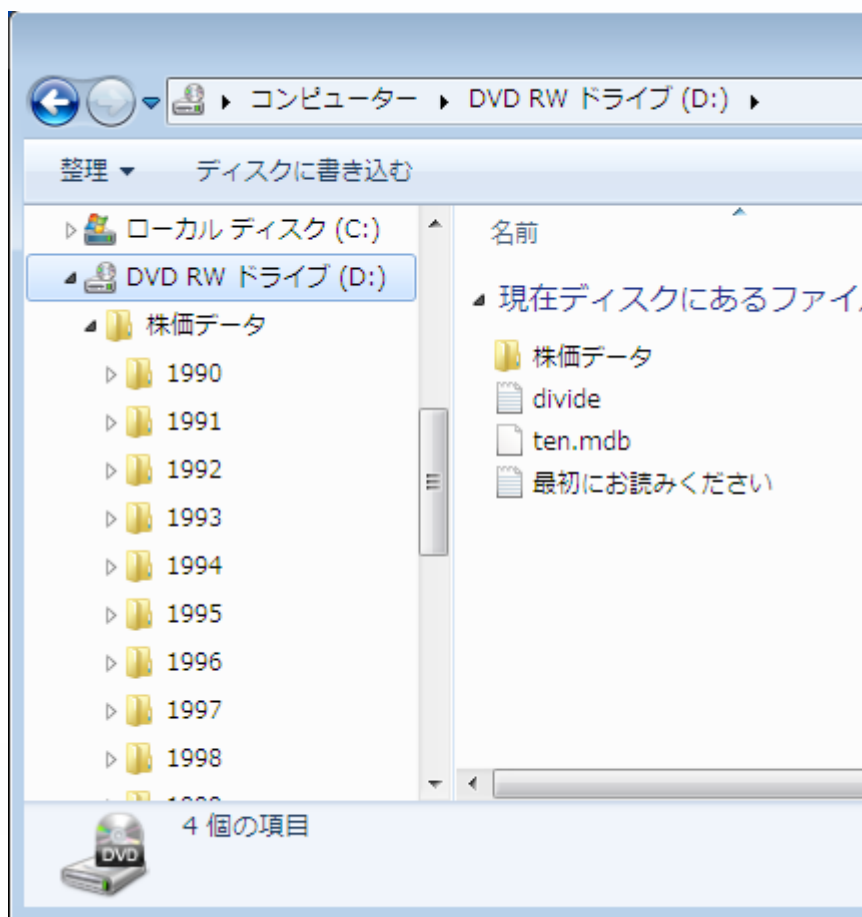
●商品の選択

商品を選択してください。

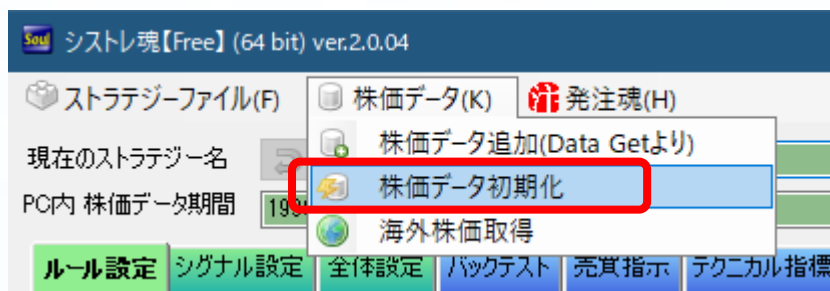
データアクセス 一ヶ月分 (30日)	1,650円	カード,WebMoney,銀行
データアクセス 三ヶ月分 (90日)	4,620円	カード,WebMoney,銀行
データアクセス 六ヶ月分 (180日)	8,580円	WebMoney,銀行
データアクセス 一年間 (365日)	15,840円	WebMoney,銀行
10年株価データCD-ROM	8,800円	カード,WebMoney,銀行

「10年株価データ CD-ROM」は 2022 年 4 月現在 8800 円となっています。
購入手続きが完了すると、自宅に CD-ROM が郵送されてきます。

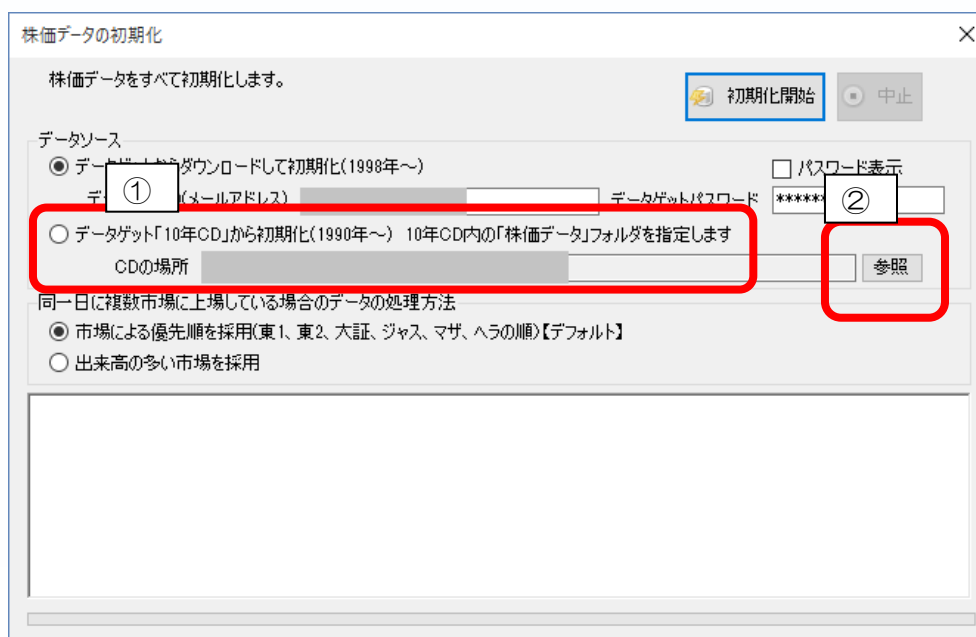
郵送されてきた CD-ROM を PC に挿入します。CD-ROM のフォルダ構成は以下のようになっています。



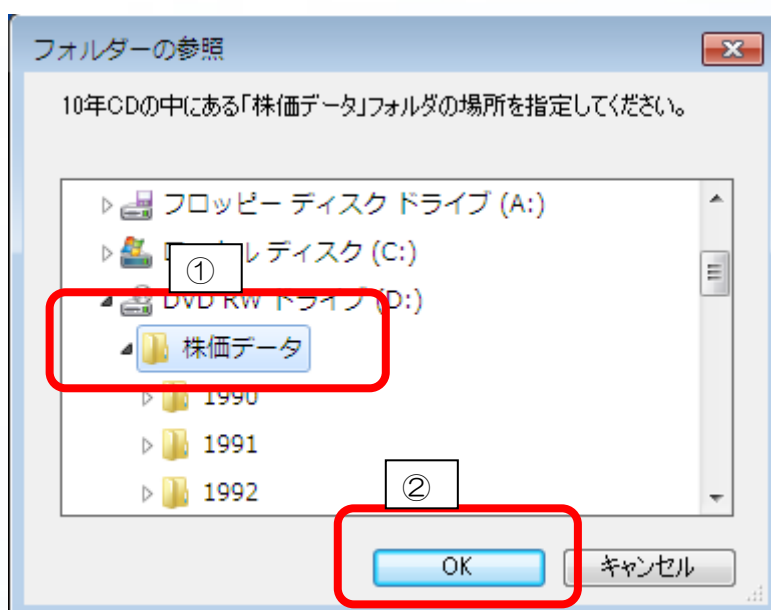
CD-ROMの中に「株価データ」というフォルダがあることを確認してください。「株価データ」フォルダの直下には「1990」「1991」…「2009」など、年度ごとの株価データが配置されています。「シストレ魂」を起動します。



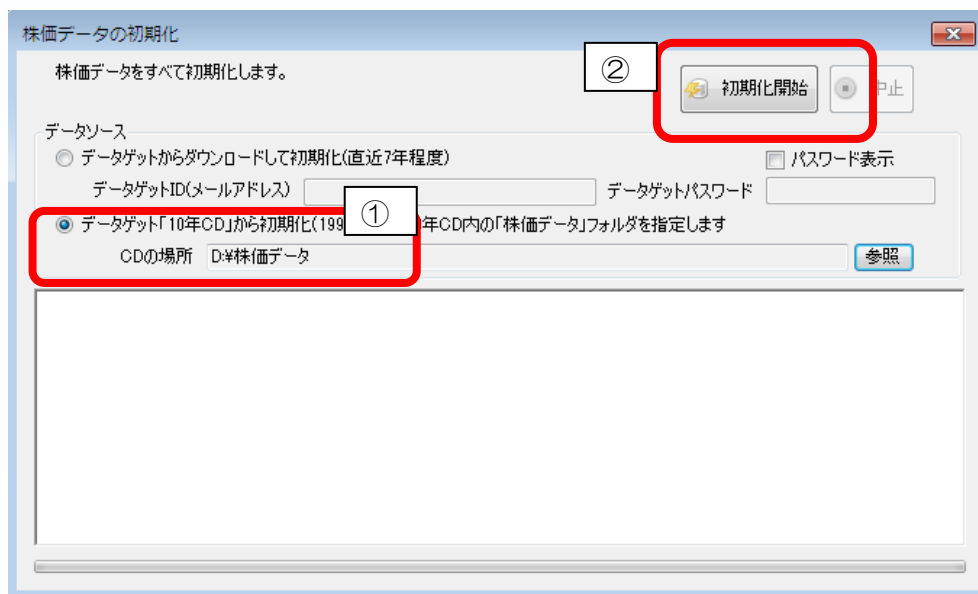
「シストレ魂」のメニューより「株価データ初期化」を選択します。



- ① 「データゲット 10年CDから初期化」を選択します。
同一日に複数市場に上場している場合のデータの処理方法については 3-3) 章を参照してください。
- ② 「参照」ボタンを押します。

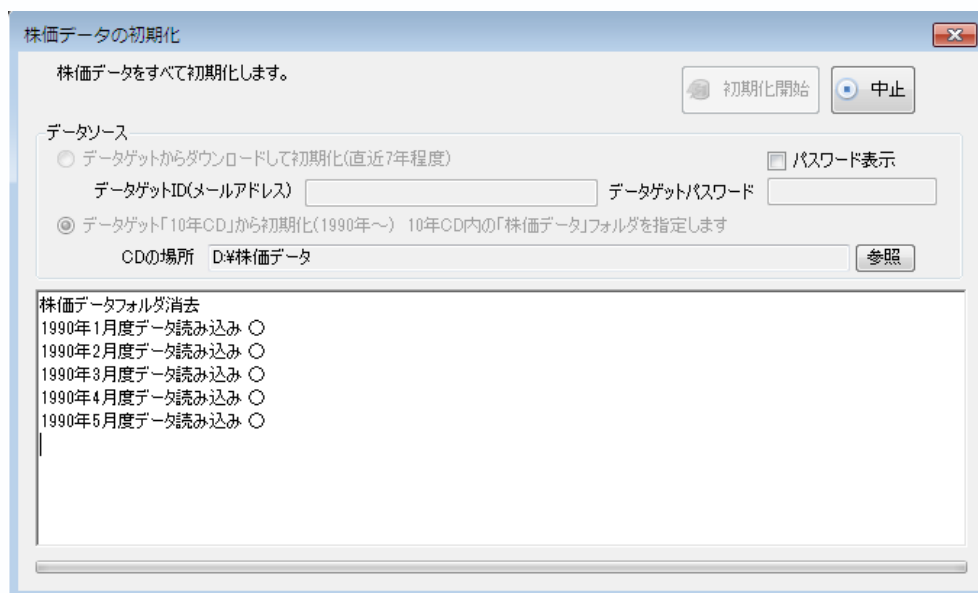


- 「フォルダーの参照」フォームにて、
- ② CD-ROM 中の「株価データ」フォルダを左クリックして、選択します。
 - ② 「OK」ボタンを押します。

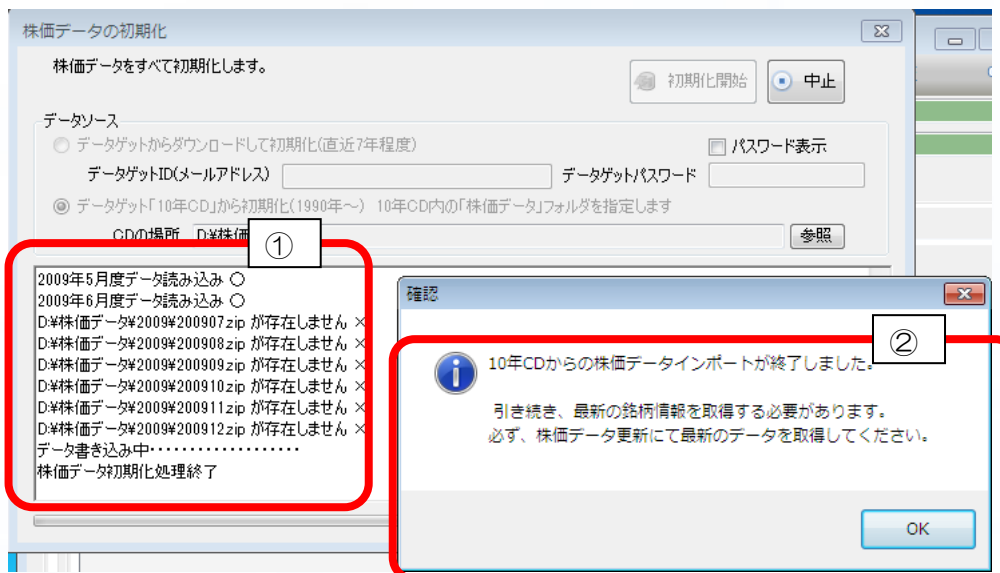


① 「CDの場所」の欄に、「10年CDが挿入されたドライブ文字:¥株価データ」が指定されました。ここで、ドライブ文字はPC環境によって異なります。自身のPC構成で読み替えてください。

② 「初期化開始」ボタンを押します。



上図のように、1990年以降の株価データの初期化が開始されます。

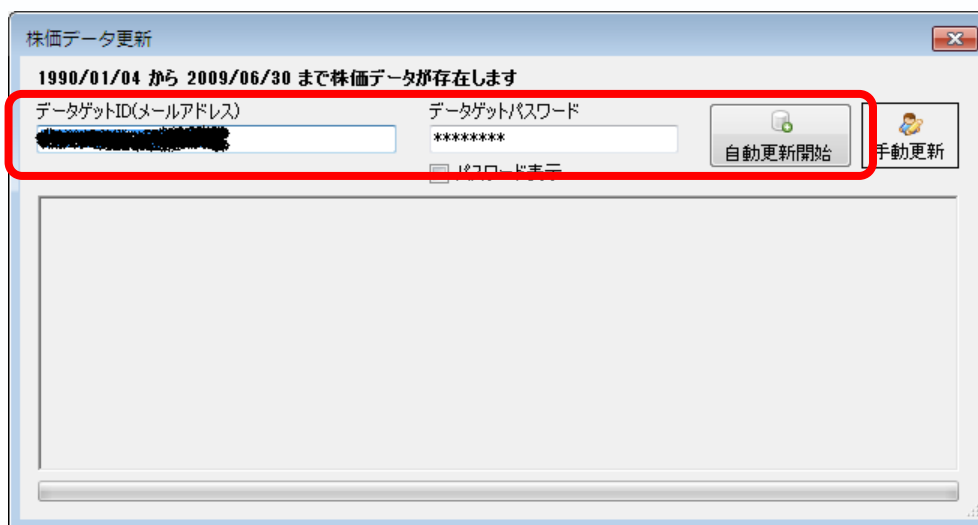


10年CDからのデータのインポートが終了すると、上図のようなメッセージが表示されます。この例ではCDの中に2009年6月までのデータが入っており、それ以降のデータがない。というメッセージが表示されています。①

10年CDは半年毎に新しい株価データを収録したものを販売しています。この

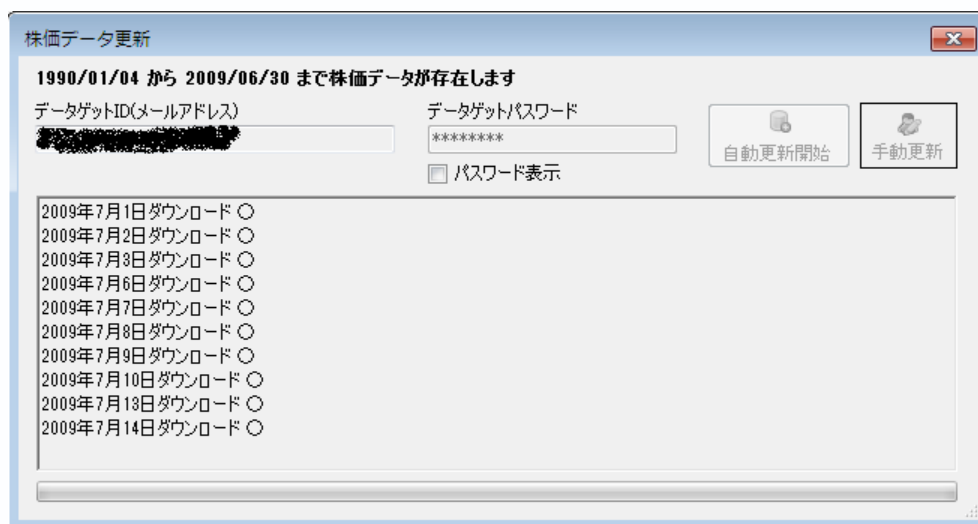
例では 2009 年 6 月までが収録されている CD を利用しています。

②では、10 年 CD に収録されている日付以降（この例では 2009 年 7 月以降）のデータを、ダウンロードによってインポートするよう促しています。「OK」ボタンを押します。



上図の「株価データ更新」の画面が現れます。ここからはデータゲットのデータアクセス権を利用して、最新のデータをダウンロードします。ここではインターネット接続が必要です。

データゲット社のアカウント情報、ユーザー ID（メールアドレス）とパスワードを入力して、「自動更新開始」ボタンを押します。



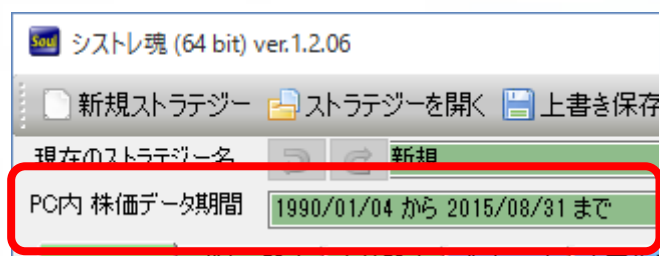
ダウンロードが開始されます。



上図のように最新の株価データまでのダウンロードが終了します。
「x」ボタンを押してフォームを閉じます。



すると、上図の「株価データの初期化」画面に戻りますので、「x」ボタンを押して閉じます。



メイン画面に戻ります、最新のデータがPC内に存在することが表示されています。

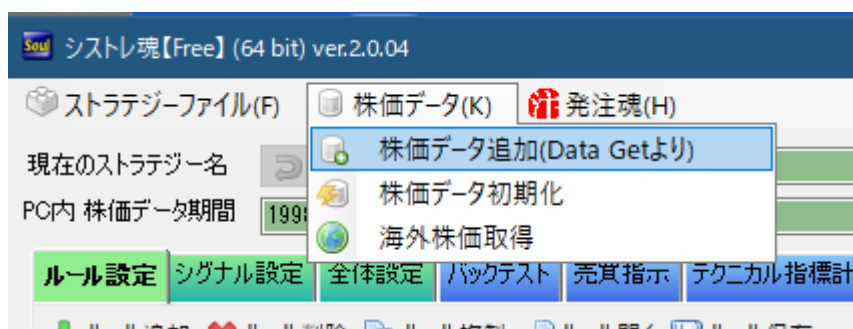
以上で株価データの初期化は終了しました。

2-5) 毎日の株価データ更新

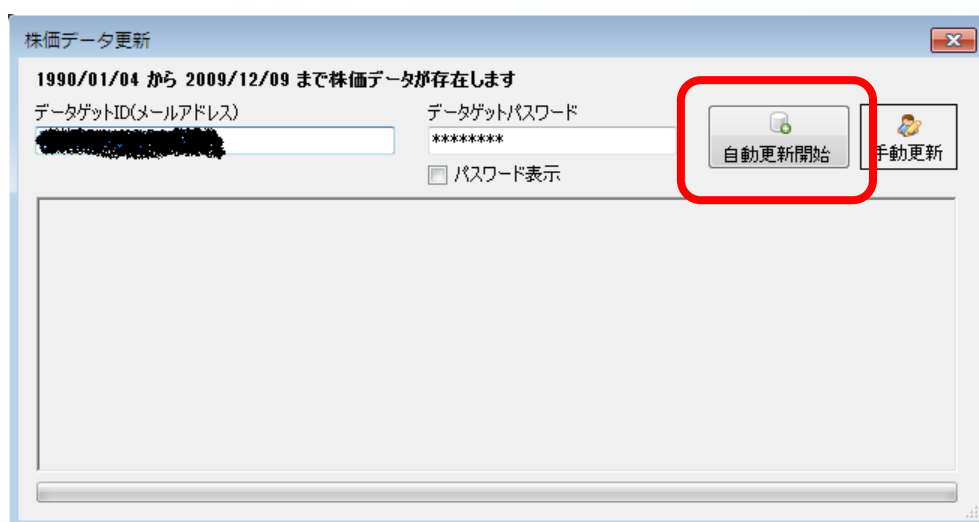
これまでは、「シストレ魂」インストール後の株価データ初期化を説明しましたが、データゲット社からは、毎日夕方 18 時以降程度に最新の株価データが配信されます。最新のデータでバックテスト、売買指示を行うには「シストレ魂」に毎日の最新データをダウンロードする必要があります。

ここでは毎日の**最新データの追加方法**を説明します。(インターネット接続が必要です)

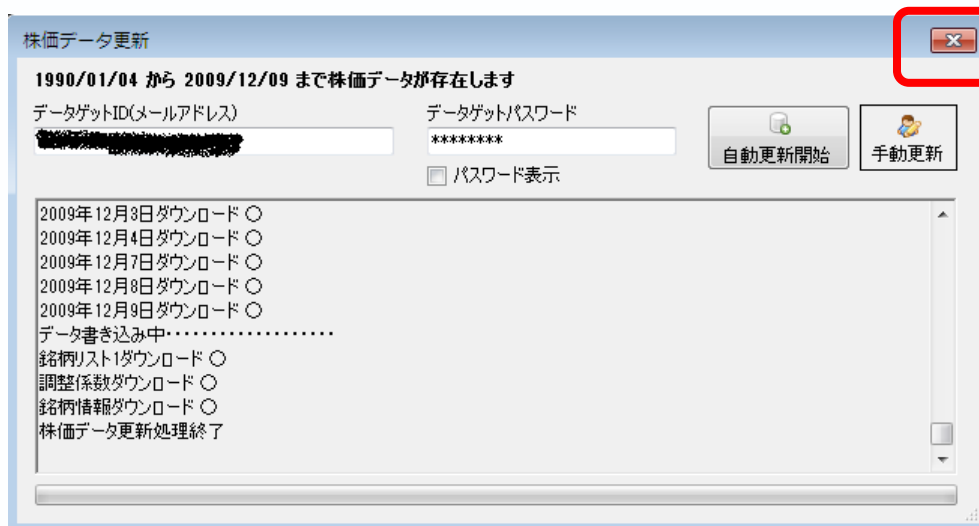
2-5-1) 自動更新



メインメニューの「株価データ」「株価データ追加」を選択します。



「自動更新開始」ボタンを押します。



上図のように、ダウンロードが終了したら、「x」ボタンを押して閉じます。

2-5-2) 手動更新

通常は、前節の「自動更新」を利用しますが、PC環境、インターネット環境によって自動更新が出来ない場合は、手動更新を行います。

手動更新は、あらかじめ別途データゲット社のページより手動でダウンロードした株価データを用いて行います。

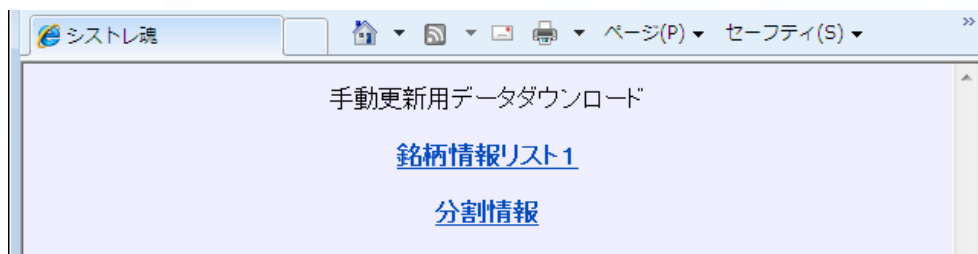
株価データ、銘柄情報データ、分割情報データ、銘柄情報リスト1の4種類が必要です。

株価データ、銘柄情報データについては、データゲット社より配信。

分割情報データ、銘柄情報リスト1については、弊社サーバーより配信しています。

はじめに、弊社サーバーより「分割情報」「銘柄情報リスト1」を取得します。以下のURLにアクセスします。

<http://www.stsoul.com/download/>



「銘柄情報リスト1」から Abolished.dat

「分割情報」から revice.coef2

とうファイルがダウンロードできます。各リンクを右クリックして「対象をファイルに保存」してください。

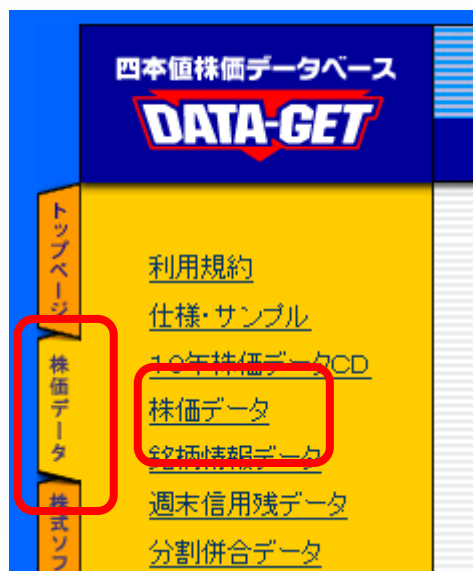
保存したファイルを自身で管理しやすいフォルダーにコピーして保存してください。

この例では、「デスクトップ」に「手動更新データ」というフォルダを作成してそこに置いておくことにします。

次に、データゲット社より「株価データ」「銘柄情報データ」を取得します。

データゲット社のページを開いてログインします。

<http://www.data-get.com/main/login.php>



「株価データ」タブを選択し、「株価データ」をクリックします。

●株価データ

データは19時ごろに更新されます。

サンプル株価データのダウンロードは[こちら](#)。容量:約195KB

以下のメニューからデータを取得したい市場をクリックしてください。

通常は「全市場」でOKです。❓

- **全市場**
- [東京証券取引所1部](#)
- [東京証券取引所2部](#)
- [マザーズ](#)
- [大阪証券取引所1部・2部](#)
- [ヘラクレス](#)
- [名古屋証券取引所1部・2部](#)
- [ジャスダック](#)

[戻る](#)

「全市場」をクリックします。

●全市場 ほかの市場のデータは[こちらへ](#)
週末信用残データは[こちらへ](#)

過去のデータ

[2002年](#) [2003年](#) [2004年](#) [2005年](#) [2006年](#) [2007年](#) [2008年](#) [2009年](#)

2009年 [01](#) [02](#) [03](#) [04](#) [05](#) [06](#) [07](#) [08](#) [09](#) [10](#) [11](#) [12](#)

2009年12月 一ヶ月分

SUN	MON	TUE	WED	THU	FRI	SAT	
29	30	<u>1</u>	<u>2</u>	<u>3</u>	<u>4</u>	5	1週間分
6	<u>7</u>	<u>8</u>	<u>9</u>	10	11	12	1週間分
13	14	15	16	17	18	19	1週間分
20	21	22	23	24	25	26	1週間分
27	28	29	30	31	1	2	1週間分

全市場のデータカレンダーが表示されます。2002年以降のすべてのデータがダウンロード可能であることがわかります。(2009年12月現在)

PC内に入っているデータ期限以降のデータをダウンロードしてください。

「1か月分」「1週間分」または、それぞれの日付ごとでも構いませんが、PCに配置されているデータ以降のデータを選択ダウンロードしてください。

「1ヶ月分」の場合は、200911.zipのようなファイル名になります。この例では2009年11月度のデータだとわかります。

「1週間分」の場合は、2009111.zipのようなファイル名になります。この例では2009年11月の第1週目のデータだとわかります。

日付ごとのデータの場合は、20091204.zipのようなファイル名になります。

2009年12月4日のデータだとわかります。

次に、銘柄情報データをダウンロードします。



「株価データ」タブを選択して、「銘柄情報データ」をクリックします。

●銘柄情報データ

サンプルファイルのダウンロードは[こちら](#)。容量:約1KB

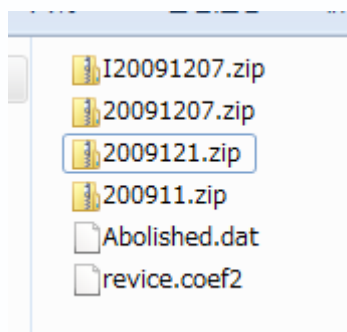
銘柄情報は、現在取り引きされている銘柄名のデータです。
新規上場や業種変更等があるたびに最新の情報に更新されます。

?

- [銘柄情報](#)

[戻る](#)

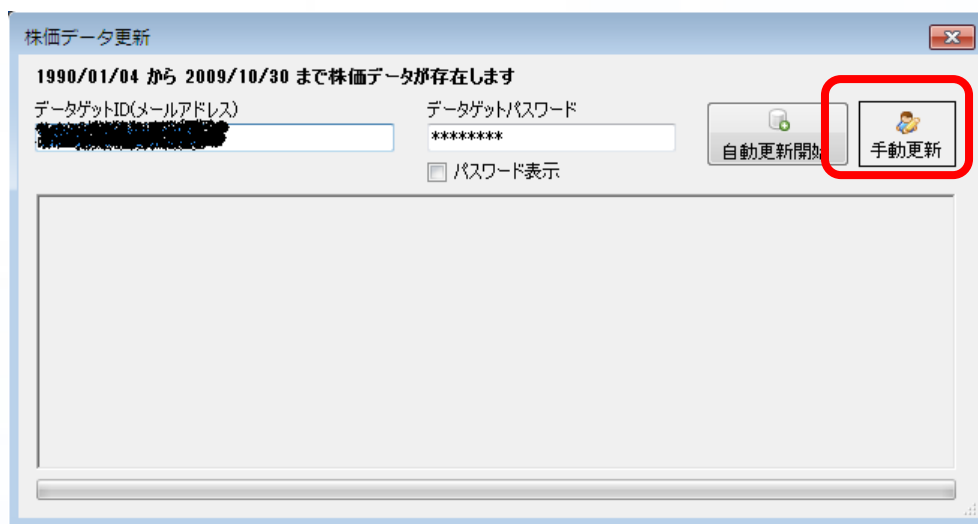
「銘柄情報」をクリックしてダウンロードします。
銘柄情報データは I20091207.zip のような名前のファイルとなります。最新の情報がひとつだけダウンロードできます。



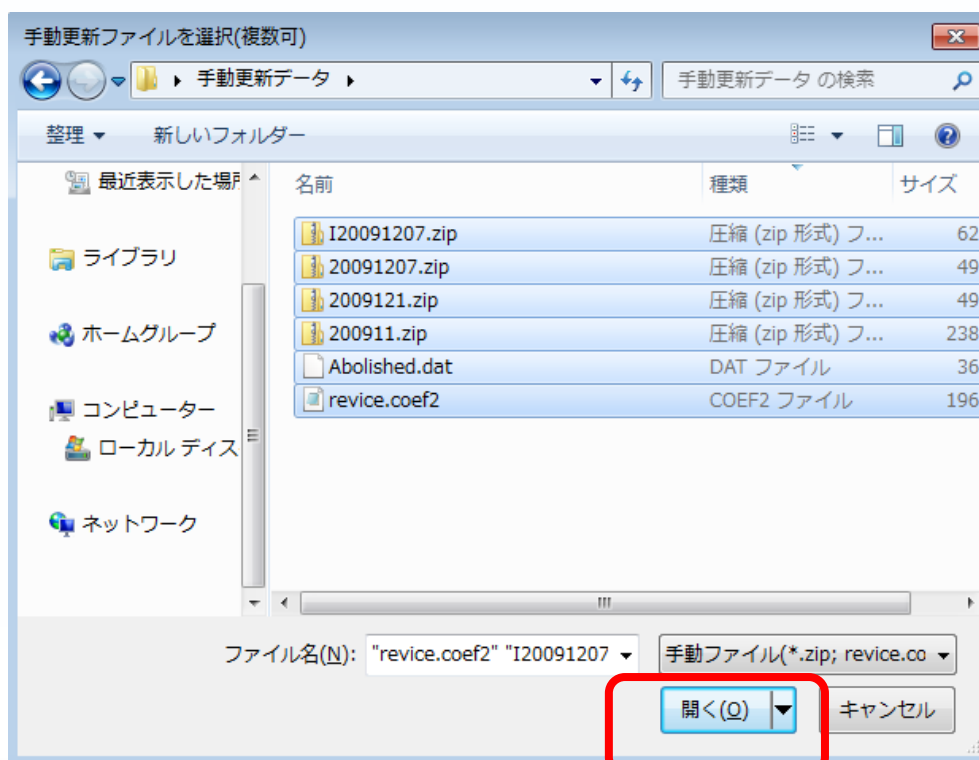
必要なファイルがダウンロードできたら、PCのどこでも構いませんので自身で把握しやすい場所においておきます。

この例では、現在の日付が2009年12月7日夕方、PC内に2009年10月30日までのデータが入っているものとします。ダウンロードしたデータは「デスクトップ」に「手動更新データ」というフォルダを作成して、そこに配置しました。

「シストレ魂」の「株価データ更新」を開きます。



「手動更新」ボタンを押します。



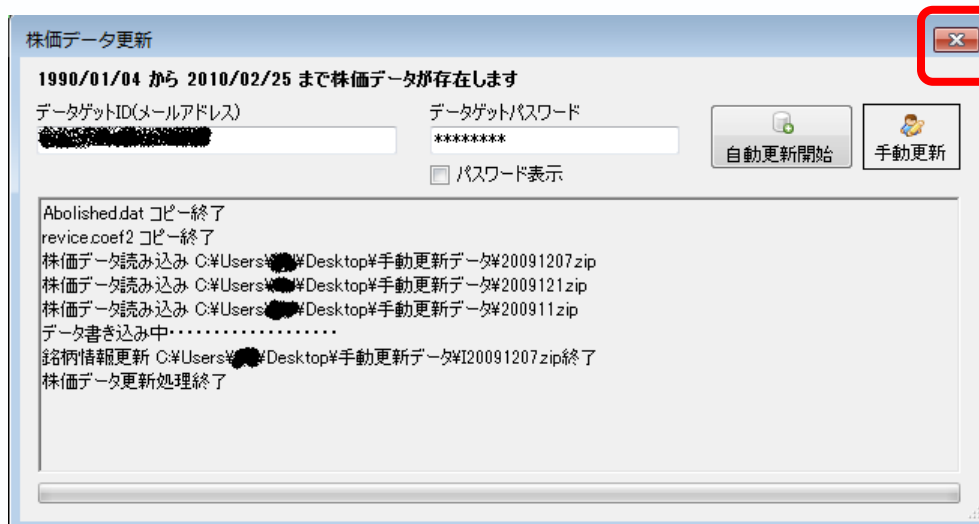
「手動更新ファイルを選択 (複数可)」という画面が現れます。手動でダウンロードしたファイルのあるフォルダまで移動して、ダウンロードしたファイルを複数選択します。

この例では、

- 200911.zip (2009 年 11 月度の株価データ)、
- 2009121.zip (2009 年 12 月第 1 週の株価データ)、
- 20091207.zip (2009 年 12 月 7 日 (月曜日) の株価データ)、
- I20091207.zip (2009 年 12 月 7 日の銘柄情報ファイル)、
- Abolished.dat (銘柄情報リスト 1)、
- revice.coef2 (分割情報)、

の 6 つのデータファイルを選択しています。

「開く」ボタンを押します。指定したデータのインポート処理が開始されます。



上図のようなメッセージになれば、手動更新は終了です。「x」ボタンを押して閉じてください。

以上で手動更新は終了です。

2-6) 海外データ取得

シストレ魂【Free】(64 bit) ver.2.0.06

ストラテジーファイル(F) 株価データ(K) 海外データ取得(W) 発注魂(H)

現在のストラテジー名 demo

PC内 株価データ期間 1990/01/04 から 2022/05/17

Yahoo! finance
Tiingo

ルール設定 シグナル設定 全体設定 バックテスト 売買指示 テクニカル指標計算 ランキングビュー

銘柄コード DJI 調整後株価 調整前株価

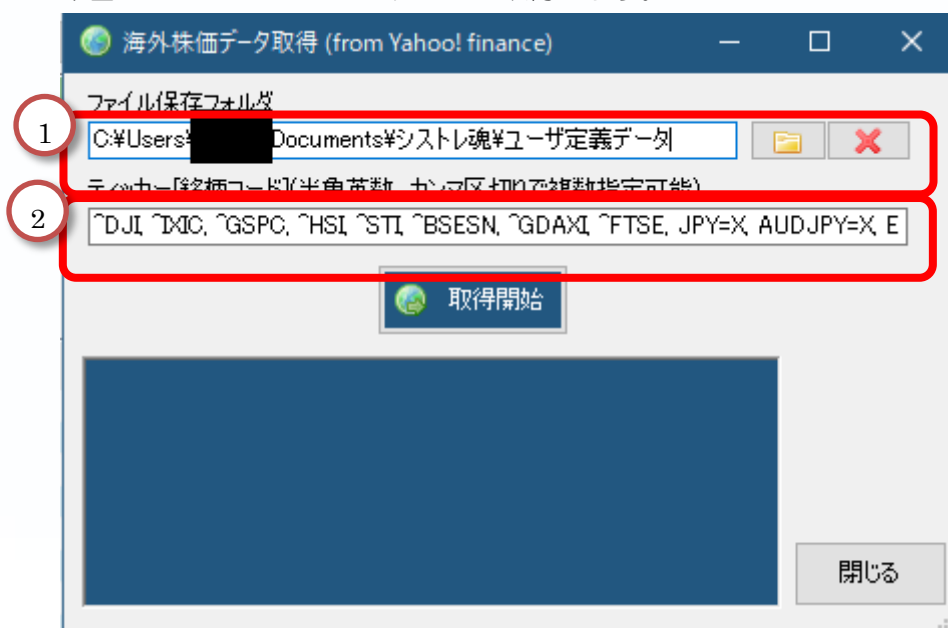
^DJI NYダウ [不明] 1

日付↑	市場	始値	高値	安値	終値	出来高	調整
2022/05/17	ユーザ定...	32,427.00	32,689.14	32,308.15	32,654.59	389,310,000	
2022/05/16	ユーザ定...	32,152.15	32,514.02	31,928.18	32,223.42	330,030,000	
2022/05/13	ユーザ定...	31,963.86	32,276.05	31,862.79	32,196.66	388,520,000	
2022/05/12	ユーザ定...	31,699.04	31,914.46	31,228.22	31,730.30	544,240,000	
2022/05/11	ユーザ定...	32,123.24	32,584.02	31,798.86	31,834.11	458,460,000	

この機能は、世界の株・先物・株価指数・暗号通貨などの日足データを世界のファイナンスデータ配信サービスから取り込んで 3-1-1)章にあります「ユーザー定義データ」に csvファイルとしてインポートする機能です。欲しい ticker (日本で言う銘柄コード) を指定(複数可)するだけでユーザー定義データとして追加され、ストラテジーの条件設定などに利用できるようになります。

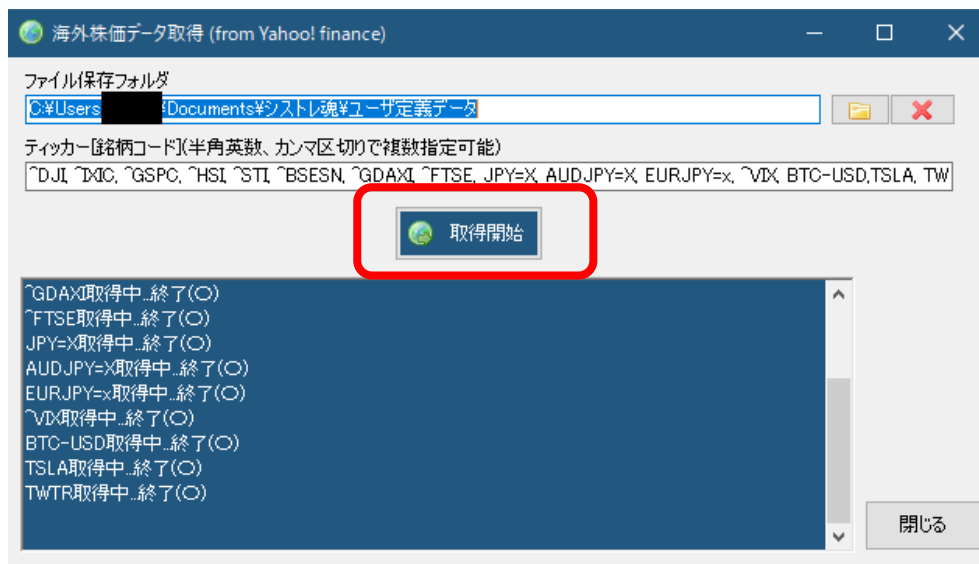
2-6-1) Yahoo! Finance

米国 Yahoo! finance からデータを取得します。

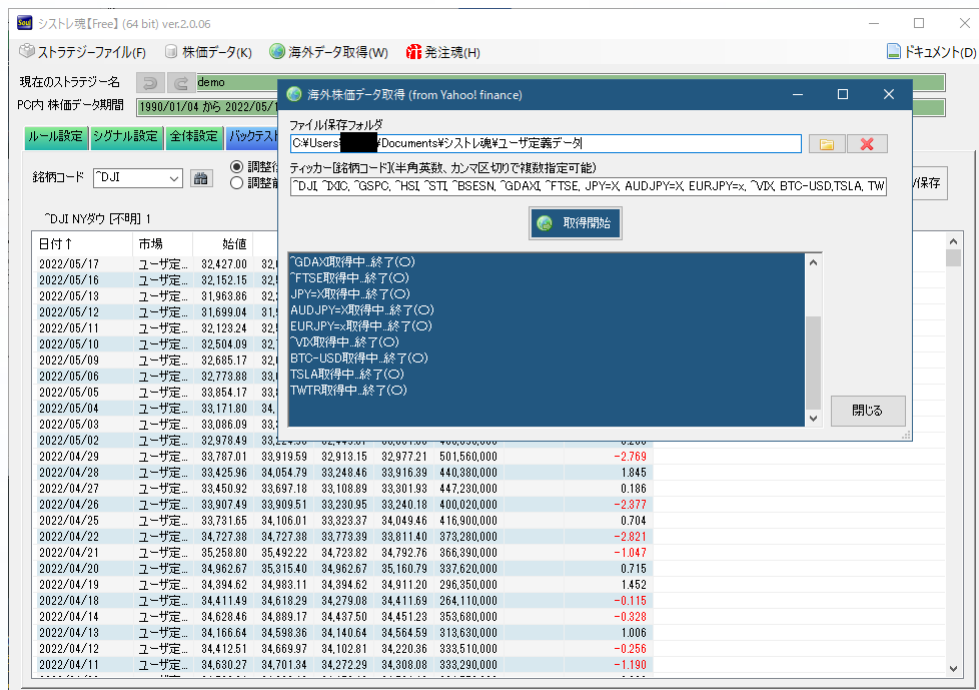


- ① ① に取得した csv ファイルを保存するフォルダを指定します。デフォルトで指定されているフォルダは「シストレ魂」がユーザー定義データの保存場所として定義されているフォルダとなります。このフォルダに保存しておけばチャート表示やストラテジーの条件設定で利用できますから、特別な理由がない限り設定は変える必要はありません。
- ② ② 取得したい株・株価指数・為替・先物・仮想通貨など米国 Yahoo Finance に存在するティッカー（日本でいう銘柄コード）をカンマ区切りで指定します。

「取得開始」ボタンを押すと株価を取得していきます。



取得が終了すると指定した株価データが読み込まれた状態となっていますのでティッカーを銘柄コードとして条件式などで利用することができるようになりました。



2-6-2) Tiingo

海外株価取得 (from Tiingo)

ファイル保存フォルダ
C:\Users\██████\Documents\シストレ魂\ユーザー定義データ

ティッカー[銘柄コード](半角英数、カンマ区切りで複数指定可能)
tsla, twtr, btcjpy, usdjpy

API Token
4a15285d9870c7799ca8c6c5d2c6 b883c276c57

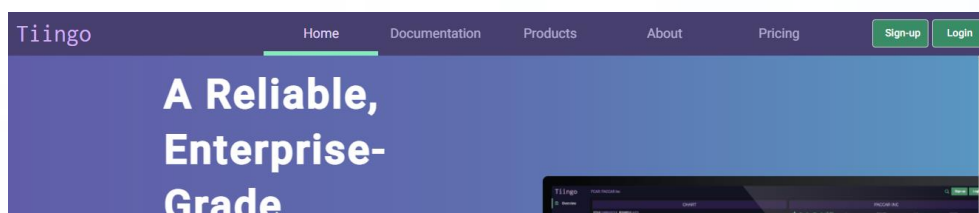
取得開始

閉じる

Tiingo からのデータ取得には、Tiingo.com にメールアドレスでユーザー登録をして無料で発行される API Token を入力する必要があります。

<https://api.tiingo.com/> の「Sign-up」からユーザー登録ができます。

クレジットカード情報など支払い方法の登録も必要ありません。



2022年5月現在、無料アカウントでの制限は以下のようになります。

- 1時間あたり50リクエストまで
- 1日あたり1000リクエストまで
- データ量、1か月 1GBまで

日足データの検証に用いる程度のアクセスであれば無料アカウントで十分かと思えます。詳細は <https://api.tiingo.com/about/pricing> を確認してください。有料アカウントでも10\$/月 ですのでそれほど高くはないようです。

現在のところ残念ながら NY ダウなどの世界の株価指数は配信しておらず、今後追加していくようです。

個別株、ETF、為替、暗号通貨などは入手可能です。

海外株価取得 (from Tiingo)

ファイル保存フォルダ
C:\Users\...Documents\シストレ魂\ユーザー定義データ

ティッカー [銘柄コード](半角英数、カンマ区切りで複数指定可能)
tsla, twtr, btcjpy, usdjpy, ethjpy

API Token
[API Token]

取得開始

取得状況:

- tsla取得中_終了(○)
- twtr取得中_終了(○)
- btcjpy取得中_終了(○)
- usdjpy取得中_終了(○)
- ethjpy取得中_終了(○)

閉じる

日付↑	市場	始値							
2022/05/18	ユーザ定...	3,939,200.00							
2022/05/17	ユーザ定...	3,851,100.00							
2022/05/16	ユーザ定...	4,055,180.49							
2022/05/15	ユーザ定...	3,885,999.68							
2022/05/14	ユーザ定...	3,793,890.15							
2022/05/13	ユーザ定...	3,735,921.58							
2022/05/12	ユーザ定...	3,789,350.73							
2022/05/11	ユーザ定...	4,048,895.62							
2022/05/10	ユーザ定...	3,930,072.23							
2022/05/09	ユーザ定...	4,456,910.48							
2022/05/08	ユーザ定...	4,628,164.65							
2022/05/07	ユーザ定...	4,703,896.83	4,721,998.94	4,550,831.25	4,636,199.82	141			-1.541
2022/05/06	ユーザ定...	4,765,305.27	4,778,896.43	4,617,720.98	4,708,761.81	339			-1.244
2022/05/05	ユーザ定...	5,128,804.01	5,152,399.45	4,643,944.97	4,768,078.74	340			-7.033
2022/05/04	ユーザ定...	4,911,516.86	5,158,191.29	4,909,618.26	5,128,812.94	306			4.416
2022/05/03	ユーザ定...	5,015,699.21	5,034,788.62	4,888,314.38	4,911,902.14	182			-1.976
2022/05/02	ユーザ定...	5,005,701.75	5,108,798.18	4,957,400.18	5,010,896.03	252			0.143

●第3章：売買ストラテジーの作成

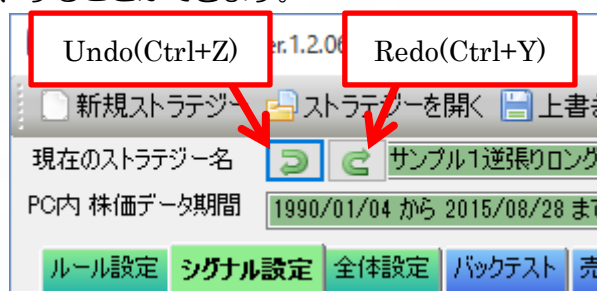
本章では「シストレ魂」での「売買ストラテジー」（以下、単に「ストラテジー」と呼びます）の構成と編集方法について説明します。

ストラテジーとは、トレーダーの限りある一定の資金のなかで、いつ、どの銘柄に仕掛けて、いつ、どのポジションを手仕舞いするか？についてのトレードに必要なすべての売買行動の行動条件・行動規範を意味します。

「シストレ魂」を利用するトレーダーは、売買行動に必要なすべての条件（ストラテジー）を自分で自由に設定して、そのストラテジーの有効性を過去の株価データを用いて検証・運用することができます。

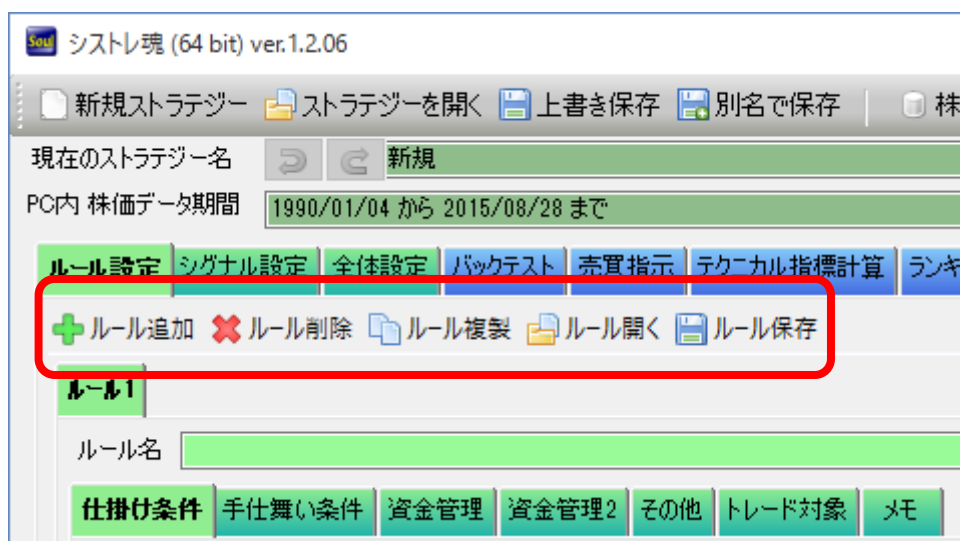
「シストレ魂」では、「ストラテジー」は、「ルール設定」「シグナル設定」「全体設定」によって構成されます。

なお、ストラテジーの編集の変更は Undo(Ctrl+Z)で「元に戻す」、Redo(Ctrl+Y)で「やり直し」、することができます。

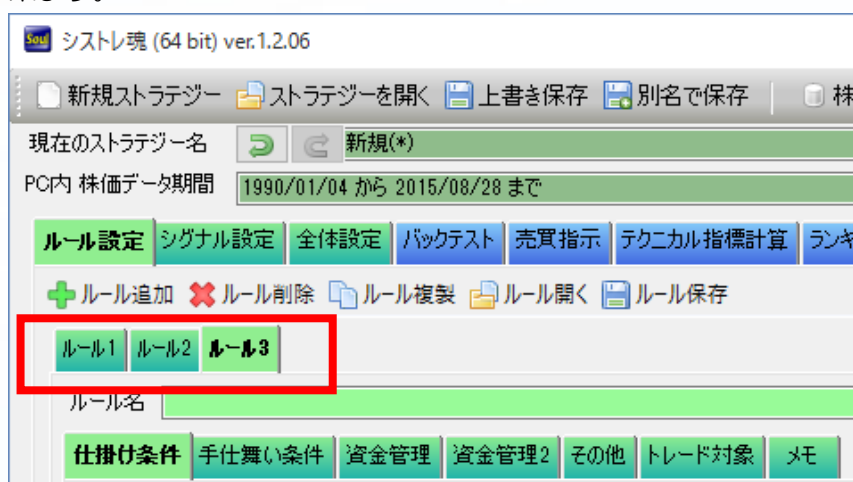


3-1) ルール設定

ひとつのストラテジーにおいて、いくつでもルールを定義できます。



「ルール追加」ボタンにて、いくつでもルールを増やすことができます。
 「ルール削除」ボタンにて、選択されているルールを削除することができます。
 「ルール複製」ボタンにて、選択されているルールを複製することができます。
 「ルール保存」ボタンにて、選択されているルールを保存することができます。
 「ルール開く」ボタンにて、保存されたルールを呼び出して追加することができます。



また「ルール1」などのタブをドラグ&ドロップすることで、ルールの並びを変更することが出来ます。

ひとつの「ルール」は、「仕掛け条件」「手仕舞い条件」「資金管理」「その他」「トレード対象」「メモ」から構成されます。

3-1-1) トレード対象

ここでは、どの銘柄をトレード（売買）対象にするか？を指定することができます。「市場」「業種」「グループファイル」によって指定することが可能です。

「市場」は、東証1部、東証2部、大証、ジャスダック、マザーズ、ヘラクレス、東証プライム、東証スタンダード、東証グロース、東証（他）、指数、ユーザ定義データ、それぞれについて、指定、指定解除ができます。

「業種」は 36 業種について、個別に指定、指定解除ができます。ユーザー定義データは、業種は「不明」として扱われますが、「不明」となる業種はいつもトレード対象として扱われます。

「グループファイル」は、ユーザが定義した銘柄コードの一覧ファイル（CSV形式）を指定することで、そのファイルに含まれる銘柄のみが、トレード対

象であることを指定できます。「グループファイル」の欄が空欄（なにも指定しない）場合は、すべての銘柄が対象となります。

「除外銘柄リストファイル」は、ユーザがトレード対象としない銘柄をリストして、トレード対象から外すことができます。特にトレード対象から除外したい銘柄が存在しない場合、この欄は空欄にしておきます。

したがって、

「市場」にて指定された市場に含まれる銘柄

かつ

「業種」にて指定された業種に含まれる銘柄

かつ

「グループファイル」に含まれる銘柄

かつ

「除外銘柄リストファイル」に含まれない銘柄
がトレード対象となります。

また、「市場」において「指数」という市場がありますが、これは日経平均 225 種などの株価指数を意味します。データゲット社の株価データには、日経平均 225 種(0101)、TOP 1 X(0201)、日経ジャスダック平均(I001)、業種別(水産)(I101)などの株価指数の日足データが含まれます。「シストレ魂」ではこれらの指数もトレード対象として含めることが可能となっています。デフォルトではチェックがオフになっています。

グループファイル、除外銘柄リストファイルのフォーマット

	A	B	C	D	E
1	1301				
2	1331				
3	1332				
4	1334				
5	1352				
6	1376				
7	1377				
8	1378				
9	1379				
10	1380				
11	1381				
12	1382				
13	1400				
14	1401				
15	1405				

グループファイル、または、除外銘柄リストファイルは上図のように、第1列に対象としたい銘柄コードを列挙したCSV形式ファイルです。このようなCSV形式ファイルを作成しておき、「グループファイル」欄の「参照」ボタンにてファイル指定することで、「シストレ魂」に認識させることができます。グループファイルのファイルサンプルは、「シストレ魂」インストール時に [Windows 7, Windows Vista の場合]

c:\Users\ユーザー\Documents\シストレ魂\グループファイル

[Windows XP の場合]

c:\Documents and Settings\ユーザー\My Documents\シストレ魂\グループファイル

に配置されていますので、確認してください。

このサンプルファイルを複製・変更して、自身で作成するとよいでしょう。

ユーザー定義データ

また、「市場」のなかに「ユーザー定義データ」という市場があります。

「ユーザー定義データ」は、データゲット社の株価データ以外に、別途ユーザー

自身で作成した日足データをインポートして、トレード対象に含めたり、各種条件に利用することができる機能です。ユーザー定義データはCSVファイル形式で以下のようなフォーマットで作成します。

- 1 列目「日付」…2002/2/4 という書式で入力します。
 - 2 列目「始値」…数値を入力します。小数点以下はあってもなくても可。
 - 3 列目「高値」…数値を入力します。小数点以下はあってもなくても可。
 - 4 列目「安値」…数値を入力します。小数点以下はあってもなくても可。
 - 5 列目「終値」…数値を入力します。小数点以下はあってもなくても可。
 - 6 列目「出来高」…数値を入力します。小数点以下はあってもなくても可。出来高が定義できないデータ（為替データなど）の場合でも何らかの数値の入力が必要です。
- 1 行目は必ず、カラム名（列名）として、日付、始値、高値、安値、終値、出来高。と記入。



	A	B	C	D	E	F	G
1	日付	始値	高値	安値	終値	出来高	
2	2001/9/10	18200	18200	17570	17600	24075	
3	2001/9/11	17600	17980	17540	17870	12268	
4	2001/9/12	18570	18570	18570	18570	4389	
5	2001/9/13	18550	18600	18100	18590	20034	
6	2001/9/14	18450	18950	18400	18850	14073	
7	2001/9/17	19460	19550	19440	19550	7317	
8	2001/9/18	19140	19570	18860	19170	26136	
9	2001/9/19	18470	18530	18470	18470	13347	
10	2001/9/20	17770	17950	17770	17770	21173	
11	2001/9/21	17520	17600	16900	17340	21161	

ユーザー定義データのファイルサンプル USDJPY.csv、東京原油.csv は、「シストレ魂」インストール時に

[Windows 7, Windows Vista の場合]

c:\Users\ユーザー名\Documents\シストレ魂\ユーザー定義データ

[Windows XP の場合]

c:\Documents and Settings\ユーザー名\My Documents\シストレ魂\ユーザー定義データ

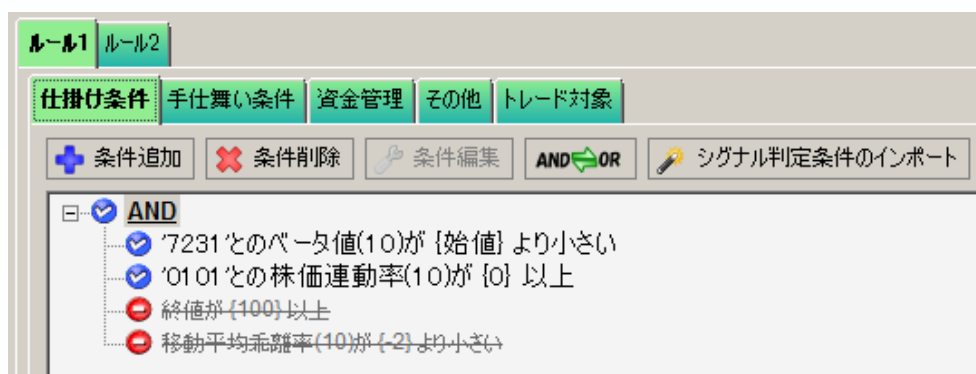
に配置されていますので確認してください。

為替データや、先物データなど、自身で利用したいデータがあれば上記のフォルダーに作成して配置することで、条件やトレード対象として利用できるようになります。

ユーザー定義データのファイル名の[.csv]を除いた部分が銘柄のコード、銘柄名として扱われます。

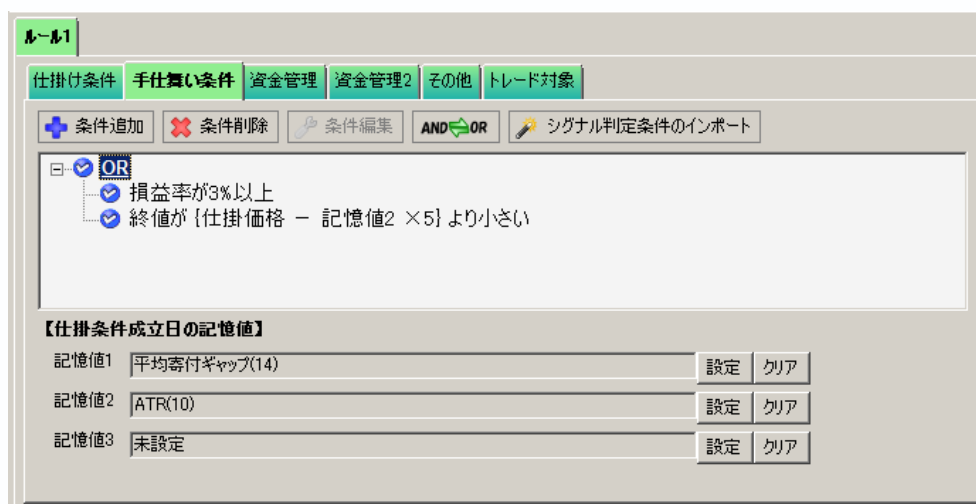
ユーザー定義データの業種は「不明」として扱われます。

3-1-2) 仕掛け条件



「仕掛け条件」は、毎日の株価データによって、PC内に存在するすべての銘柄（指数データ、ユーザー定義データ含む）について評価される条件で、ここで定義された条件に合致した銘柄が、仕掛け対象銘柄となります。

3-1-3) 手仕舞い条件



「手仕舞い条件」は、毎日の株価データによって、そのルールによって仕掛けられた、すべての当日保有中のポジションについて評価される条件で、ここで定義された条件に合致したポジションが手仕舞い対象となります。

手仕舞い条件では、

【仕掛条件成立日の記憶値】・・・を設定することができます。記憶値とは保有中のポジションについて、仕掛条件が成立した日の任意のテクニカル指標の値を記憶しておく機能です。手仕舞い条件にて、仕掛けたときの状態を記憶しておいて、その値（記憶値）を元に条件を組み立てたいときに利用します。記憶値はテクニカル指標のカテゴリ「ポジション状態量」「記憶値」にて参照することができます。

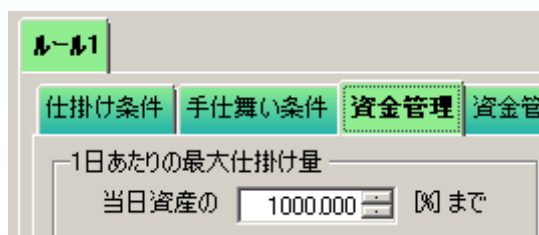
「未設定」となっている記憶値のスロットの「設定」ボタンを押すと追加することができます。すでにテクニカルが設定されているスロットの「設定」ボタンを押すと、テクニカルのパラメータを編集することができます。すでにテクニカルが設定されているスロットの「クリア」ボタンを押すと、その記憶値を消去することができます。

3-1-4) 資金管理

すべてのトレーダーは一定の有限の資金でトレードをします。「資金管理」「資金管理 2」では、どのように資金を分配してトレーディングするか?を定義します。

1日あたりの最大仕掛け量

「仕掛け条件」によっては、大量に仕掛け条件に合致した銘柄が発生する日があるかもしれません。その場合に、当日の手持ち資産の何パーセントまでを仕掛けていくか?を決定します。この機能を利用することによって、「仕掛け候補が何日も連続して発生する場合に、時間的に分散して仕掛けていく」という投資行動が可能となります。0以上の数値が入力可能です。



なお、手持ち資産とは、

[信用取引の場合]…当日の現金残高。

[現物取引の場合]…当日の現金残高+当日の保有ポジションの現物簿価の合計。
となります。

※ 仕掛け時の余力消費について

各仕掛け注文の余力消費は

[成り行き注文、または、ショートの場合]…調整前値幅上限値×数量

[指値注文でロングの場合]…指値×数量

で計算されます。

「シストレ魂」では、仕掛ける際にこの余力消費式に従って、「1日あたりの最大仕掛け量」「最大レバレッジ」などの設定を超えないように仕掛けていきます。これは実際の証券会社の注文受付時の余力消費のし方と非常に近いものといえます。

最大レバレッジ

金管理2 その他 **トレード対象**

最大レバレッジ

10 倍

ルールごとに最大レバレッジを指定できます。「全体設定」にも「最大レバレッジ」の設定がありますが、ルールの仕掛け条件に基づき、仕掛ける時に「ルール」の最大レバレッジと、「全体設定」の最大レバレッジの小さいほうの数値が適用されます。ルールごとにリスク量を調整するときに利用できます。

最大レバレッジは、全体設定にて、「信用」を選択したときに有効となります。

ポジションサイジング（1銘柄あたりのポジションサイズ上下限）

ルール1

ルール名

仕掛け条件 手仕舞い条件 資金管理 **資金管理2** その他 **トレード対象**

1銘柄あたりポジションサイズの上下限

損失額基準

損失率基準

定率 ポジションサイズ = 資産の [%]

定額 上限額 [円] 下限額 [円]

株価変動率(10)によるポジションサイズ調整を行う

 株価変動率上限 [%] 株価変動率下限 [%] 調整下限額 [円]

出来高による制限をする 期間平均出来高(1)の

 分の1を上限とする

売買単位による制限をする 売買単位の 倍を上限とする

ポジションサイズは最小でも 円以上とする。(それ以下は見送り)

仕掛けるにあたり、1銘柄あたりどのくらいのサイズ（株数）にするか？を指定します。

「定額」…「上限額」を指定できます。「シストレ魂」は、ここで指定されたサイズを超えないように仕掛け数量を決定します。「シストレ魂」は高額な銘柄の場合、(最低売買単位でもこの上限を超えるものがある場合)仕掛けを見送ります。

1銘柄あたりポジションサイズの上下限

損失額基準
 損失率基準
 定率
 定額

上限額 [円]

「定率」…1銘柄あたりのサイズを、当日の資産の何パーセント以下にするかを指定します。当日資産が100万円の場合、10%とすると、1銘柄あたり10万円となります。「上限額」「下限額」もあわせて設定できます。バックテストあるいは、実際の資産運用にて、トレードを繰り返すと手持ちの資産が増減して変化していきます。上限額、あるいは下限額を設定することで、定率何%に上限下限を設定することが出来ます。たとえば、トレードによって資産が1000万円に増えたとき、20%と設定していた場合、1銘柄あたり200万円となりますが、その場合でも1銘柄あたり50万円に制限したい。という場合に「上限額」が利用できます。「下限額」はその逆のケースとなります。

1銘柄あたりポジションサイズの上下限

損失額基準
 損失率基準
 定率
 定額

ポジションサイズ = 資産の [%]

上限額 [円] 下限額 [円]

「損失額基準」…1銘柄あたりのサイズを、許容できる損失幅から決定するタイプのポジションサイジングです。銘柄ごとに価格変動の激しさが異なるため、どのポジションでも同じリスク(損失金額)を取ったポジションサイズにすることを意図したポジションサイジング方式です。

この方法では、仕掛ける株数を

$$\text{株数} = \text{許容損失額} \div \{m \times \text{ATR}(n)\}$$

によって決定します。ATR(n)とは、直近n日間での1日あたりの平均値動きの幅(円)を意味します。許容損失額(円)はユーザが任意に設定します。

この式の意味するところは、「この銘柄は、直近n日間で1日あたり平均するとATR(n)円変動していた。仮にm日間連続で不利な値動きをしたとして、許容損失金額に収まる株数」ということとなります。

このポジションサイズ方式では上限額を資産(現金+現物簿価)の何%で設定することもできます。

「上限額」「下限額」もあわせて設定できます。

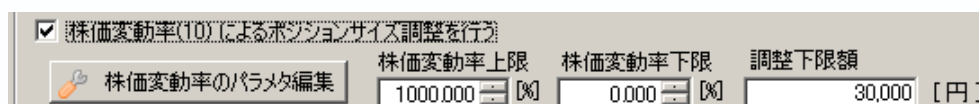
「損失率基準」…上記「損失額基準」と同様の方式ですが、上記「許容損失額」を現在資産の何%で決定するものです。複利運用で資産が増えたとき(減ったとき)にあわせてポジションサイズも増減させることができます。現在資産とは、信用取引の場合は現金残高、現物取引の場合は現金残高+現物簿価、です。

この方式では株数は

$$\text{株数} = \{\text{当日資産の } x\% \} \div \{m \times \text{ATR}(n)\}$$

によって決定されます。

このポジションサイズ方式では上限額を資産(現金+現物簿価)の何%で設定することもできます。

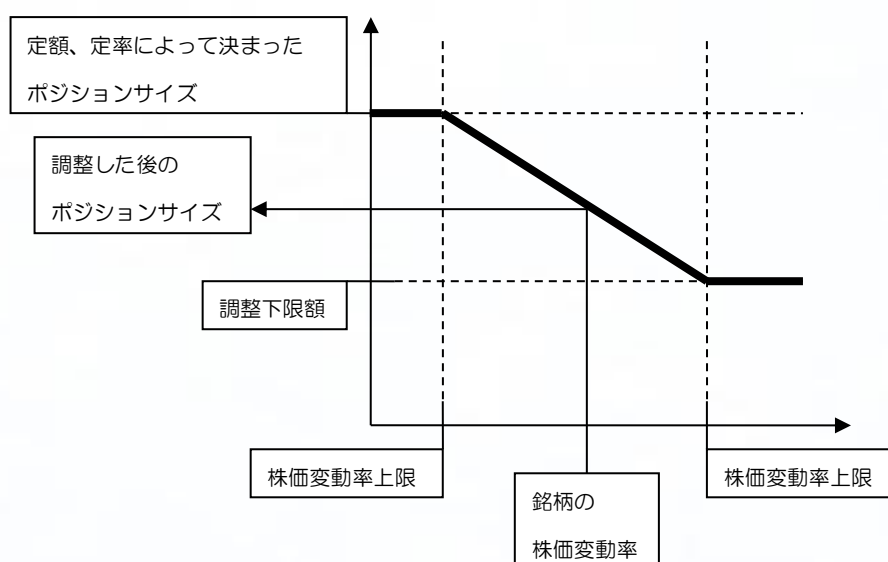


「株価変動率によるポジションサイズ調整を行う」…上記「定額」「定率」「損失額基準」「損失率基準」によって仕掛けるポジションサイズの上限（目標値）が決定します。ここでは、ポジションサイズをさらに、銘柄ごとの株価変動率（ボラティリティー）によって、ポジションサイズを調整することができます。

ボラティリティーの大きな銘柄は、値動きが激しいため、期待されるリターンもリスクも大きくなります。一方、ボラティリティーの小さな銘柄は、値動きが少ないため、期待されるリターンもリスクも小さくなります。

この機能は、値動きの激しい銘柄を、小さなポジションに、値動きの小さな銘柄を大きなポジションに、することで銘柄ごとに期待されるリターンとリスクを均一に近づけることができます。

ここでは、「株価変動率上限」「株価変動率下限」「調整下限額」を指定します。結果として得られるポジションサイズは、以下のグラフのイメージとなります。



銘柄の株価変動率が大きい場合は、小さなポジションサイズに。

銘柄の株価変動率が小さい場合は、大きなポジションサイズに。

なることがわかります。

なお、銘柄の株価変動率が、株価変動率上限を超えている場合は、株価変動率上限とみなし、株価変動率上限を下回っている場合は、株価変動率下限として扱います。したがって、調整後のポジションサイズは、「調整下限額」から「定額・定率によって決定したポジションサイズ」の間の値をとることになります。

出来高による制限をする
 期間平均出来高(1)の
 期間平均出来高
パラメタ編集
分の1を上限とする

「出来高による制限をする」…「シストレ魂」は「定額」「定率」「損失額基準」「損失率基準」によって決まったポジションサイズで仕掛けようとしていますが、銘柄によっては出来高が少なく、自分が仕掛けた数量がその銘柄の価格を大きく変化させてしまうことがあります。これを避けるために、期間出来高の何分の1を上限として仕掛ける。という設定が出来ます。

上記、「定額」「定率」「損失額基準」によって決まったポジションサイズに対して、この制限を越えないような数量（上限）で仕掛けるようになります。この制限にかかると「定率」「損失額基準」の「下限値」よりも小さなサイズで仕掛けることがあります。

期間出来高にまつわるテクニカル指標のうち「期間平均出来高」「期間最大出来高」「期間最小出来高」が選択できます。

「パラメタ設定」ボタンを押すと、平均出来高の期間、基準日を編集することが出来ます。

売買単位による制限をする
 売買単位の 倍を上限とする

「売買単位による制限をする」…これも同様に売買単位の何倍を上限として仕掛ける。という設定が出来ます。空売りの売買単位規制などに対応することが出来ます。

上記、「定額」「定率」「損失額基準」「損失率基準」によって決まったポジションサイズに対して、この制限を越えないような（上限）数量で仕掛けるように

なります。この制限にかかると「定率」「損失額基準」の「下限値」よりも小さなサイズで仕掛けることがあります。

※ポジションサイズ（1 銘柄あたりの仕掛け株数量）は、成り行き注文（翌日寄り成、当日引け成）の場合、当日終値×数量。指値注文（翌日寄り指、翌日指値）の場合、指値×数量。が上記の設定によって決定したポジションサイズを超えないように決定されます。

ポジションサイズは最小でも××円以上とする。

ポジションサイズは最小でも 円以上とする。(それ以下は見送り)

ポジションサイズに関するこれまでの設定内容によっては、非常に小さなポジション（数万円など）をとることもあります。ここに最小のポジションサイズを指定することで、こういった小さなポジションを見送る設定が出来ます。売買指示での見送りの理由は「ポジションサイズ過小」となります。

仕掛け銘柄優先順位

設定した「仕掛け条件」によっては、大量に「仕掛け条件」に合致する銘柄が発生する日があるかもしれません。通常のトレーダーは一定の限りある資産を運用していますから、「仕掛け条件」に合致した銘柄に優先順位をつけて、その優先順位に従って仕掛けていくことが現実的です。

ここでは、様々なテクニカル指標の数値によって銘柄ごとの優先順位を定義できます。「仕掛け銘柄優先順位」で指定したテクニカル指標と「降順・昇順」によって優先順位が決められます。この指標が同じ数値となる銘柄が存在した場合は「仕掛け銘柄第2優先順位」を指定することで、さらに優先順位づけが可能です。第1、第2優先順位がともに同じ数値となる銘柄が存在した場合は、銘柄コード昇順で優先順位が決定します。

仕掛け銘柄優先順位 <input type="button" value="指標の選択"/> <input type="button" value="パラメタ編集"/> <input type="radio"/> 降順 <input checked="" type="radio"/> 昇順 <input type="text" value="連続陽線日数"/>	仕掛け銘柄第2優先順位 <input type="button" value="指標の選択"/> <input type="button" value="パラメタ編集"/> <input type="button" value="クリア"/> <input type="radio"/> 降順 <input checked="" type="radio"/> 昇順 <input type="text" value="期間変化率(10)"/>
---	---

「指標の選択」ボタンを押すことで、指標を選択することができます。さらに、テクニカル指標の数値の「降順（大きいもの優先）」「昇順（小さいもの優先）」を指定できます。

第2優先順位については「クリア」ボタンを押すことで「未指定」とすることができます。

デフォルトでは第1優先順位だけが指定されており、「終値」「降順」となっています。

3-1-5) その他

ここでは、以下の項目が設定できます。

ルール1	
ルール名 <input type="text"/>	
<input type="button" value="仕掛け条件"/>	<input type="button" value="手仕舞い条件"/> <input type="button" value="資金管理"/> <input type="button" value="資金管理2"/> <input checked="" type="button" value="その他"/> <input type="button" value="トレード対象"/>
取引形態 <input checked="" type="radio"/> 買い建て <input type="radio"/> 売り建て	
仕掛け方法 <input checked="" type="radio"/> 翌日寄成 <input type="radio"/> 翌日寄指 <input type="checkbox"/> 逆指値にする スリッページ <input type="text" value="0.00"/> % <input type="radio"/> 当日引成 <input type="radio"/> 翌日指値 <input type="text" value="当日終値"/> の+ <input type="text" value="0.000"/> %	
手仕舞い方法 <input checked="" type="radio"/> 翌日寄成 <input type="radio"/> 翌日引成 <input type="checkbox"/> 逆指値にする スリッページ <input type="text" value="0.00"/> % <input type="radio"/> 当日引成 <input type="radio"/> 翌日指値 <input type="text" value="当日終値"/> の+ <input type="text" value="0.000"/> % <input type="checkbox"/> 手仕舞いが約定せず、持ち越した場合、次の日から強制的に翌日寄成にする <input type="checkbox"/> 日数が経過した場合、強制的に翌日寄成で決済する <input type="text" value="保有日数"/> <input type="text" value="20"/> 日経過	
メモ <input type="text"/>	

「取引形態」…「買い（ロング）」か「売り（ショート）」かが選択できます。

「仕掛け方法」…「翌日寄成」「当日引成」「翌日寄指」「翌日指値」が選択できます。指値は、4本値に対して何%上下。で指定できます。

「翌日指値」を選択した場合は、「逆指値にする」を選択できます。

逆指値とは、通常の指値は指定した価格より有利な価格（買い建ての場合は、指値より安い価格、売り建ての場合は、指値より高い価格）が付いたときに約定しますが、逆指値は、指定した価格より不利な価格（買い建ての場合は、指値より高い価格、売り建ての場合は、指値より安い価格）が付いたときに約定します。また「逆指値にする」を選択した場合は、スリッページを指定することで、平均して指定した指値よりどれだけ不利な価格で約定するか？を設定することができます。これにより、逆指値による不利な価格での約定をシミュレートすることが出来ます。

「手仕舞い方法」…「翌日寄成」「当日引成」「翌日引成」「翌日指値」が選択できます。指値は「4本値」または「仕掛け値」の何%上下。で指定できます。逆指値については、仕掛けの場合と同様です。

「手仕舞いが約定せず、持ち越した場合、次の日から強制的に翌日寄成にする」も選択できます。手仕舞いでは、手仕舞い条件が成立しても、手仕舞いができずに持ち越してしまうことがあります。

1. 執行当日の出来高がゼロの場合。
2. 買い建の決済にて、ストップ安の場合。売り建の決済にて、ストップ高の場合。
3. 指値が成立しない場合。

の3通りです。このように持ち越してしまった場合に、強制的に次の日に寄り付き成行で決済する動作をさせることが出来ます。

このオプションを選択しない場合は、上記理由により持ち越しても、次の日は手仕舞い条件を評価して、指定された手仕舞い方法で手仕舞いを行います。

「日数が経過した場合、強制的に翌日寄成で決済する」も指定できます。手仕舞い条件が成立していなくても、保有日数または稼働日経過日数が経過したときに、指定された決済方法によらず、強制的に翌日寄り成で決済がされます。

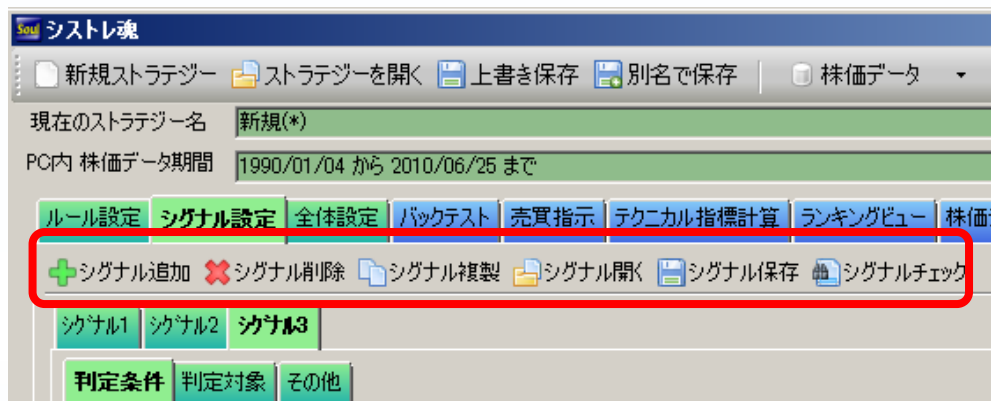
「メモ」ルールに関するメモ書きを自由に書き込めます。

The screenshot shows the 'Rule Settings' (ルール設定) window. At the top, there are several tabs: 'ルール設定' (Rule Settings), 'シグナル設定' (Signal Settings), '全体設定' (General Settings), 'バックテスト' (Backtest), '売買指示' (Buy/Sell Orders), 'テクニカル指標計算' (Technical Indicator Calculation), 'ランキングビュー' (Ranking View), '株価データビュー' (Stock Price Data View), and 'チャートビュー' (Chart View). Below these are icons for '+ ルール追加' (Add Rule), 'x ルール削除' (Delete Rule), 'ルール複製' (Duplicate Rule), 'ルール開く' (Open Rule), and 'ルール保存' (Save Rule). The main area has two tabs: 'ルール1' (Rule 1) and 'ルール2' (Rule 2). Under 'ルール2', there is a 'ルール名' (Rule Name) field. Below that is a sub-menu with tabs: '仕掛け条件' (Entry Conditions), '手仕舞い条件' (Exit Conditions), '資金管理' (Money Management), '資金管理2' (Money Management 2), 'その他' (Others), 'トレード対象' (Trade Object), and 'メモ' (Memo). The 'メモ' tab is selected, and the text area contains the instruction: 'ルールに関するメモを書き留めておくことができます。' (You can save notes related to the rule.)

3-2) シグナル設定

シグナルは、相場全体の状態を表現・判定するために用います。トレーダーが自由に設定した条件式に合致した銘柄数を「シグナル数」といいます。この「シグナル数」は、ひとつのテクニカル指標のように「ルール」の条件式に用いることもできます。

ひとつのストラテジーにおいて、いくつでもシグナルを定義できます。



「シグナル追加」ボタンにて新規シグナルを追加することができます。

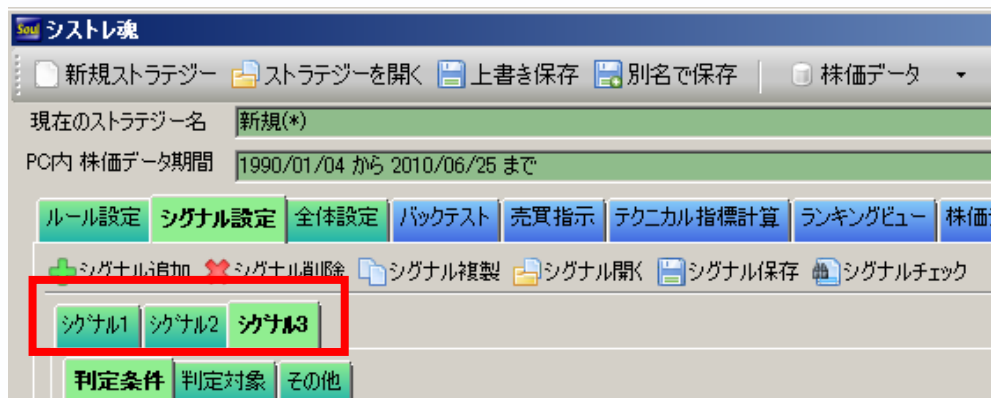
「シグナル削除」ボタンにて、選択されているシグナルを削除することができます。

「シグナル複製」ボタンにて、選択されているシグナルを複製することができます。

「シグナル保存」ボタンにて、選択されたシグナルを保存することができます。

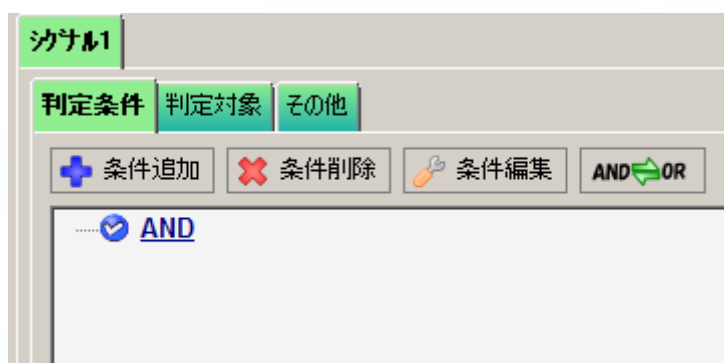
「シグナル開く」ボタンにて、保存されたシグナルを呼び出して追加することができます。

「シグナルチェック」ボタンにて、指定した日付のシグナル（複数）の点灯状況が確認できます。



また「シグナル1」などのタブをドラグドロップすることで、シグナルの並びを変更することが出来ます。

ひとつの「シグナル」は、「判定条件」「判定対象」「その他」で構成されます。



「判定条件」は、様々なテクニカル指標の条件式の組み合わせ（AND、OR）で自由に条件を設定できます。

シグナル1

判定条件 **判定対象**

対象市場

東証1部 東証2部 大証 JASDAQ マザーズ ヘラクレス 指数

ユーザ定義データ

業種

<input checked="" type="checkbox"/> 水産	<input checked="" type="checkbox"/> 化学	<input checked="" type="checkbox"/> 非鉄・金属	<input checked="" type="checkbox"/> 精密機器	<input checked="" type="checkbox"/> 証券	<input checked="" type="checkbox"/> 空運
<input checked="" type="checkbox"/> 鉱業	<input checked="" type="checkbox"/> 医薬品	<input checked="" type="checkbox"/> 機械	<input checked="" type="checkbox"/> その他製造	<input checked="" type="checkbox"/> 保険	<input checked="" type="checkbox"/> 倉庫
<input checked="" type="checkbox"/> 建設	<input checked="" type="checkbox"/> 石油	<input checked="" type="checkbox"/> 電気機器	<input checked="" type="checkbox"/> 商社	<input checked="" type="checkbox"/> 不動産	<input checked="" type="checkbox"/> 情報・通信
<input checked="" type="checkbox"/> 食品	<input checked="" type="checkbox"/> ゴム	<input checked="" type="checkbox"/> 造船	<input checked="" type="checkbox"/> 小売業	<input checked="" type="checkbox"/> 鉄道・バス	<input checked="" type="checkbox"/> 電力
<input checked="" type="checkbox"/> 繊維	<input checked="" type="checkbox"/> 窯業	<input checked="" type="checkbox"/> 自動車	<input checked="" type="checkbox"/> 銀行	<input checked="" type="checkbox"/> 陸運	<input checked="" type="checkbox"/> ガス
<input checked="" type="checkbox"/> パルプ・紙	<input checked="" type="checkbox"/> 鉄鋼	<input checked="" type="checkbox"/> 輸送用機器	<input checked="" type="checkbox"/> その他金融	<input checked="" type="checkbox"/> 海運	<input checked="" type="checkbox"/> サービス

グループファイル

「判定対象」は、「判定条件」を評価する対象となる銘柄を指定します。
 「市場」「業種」「グループファイル」によって指定できます。
 グループファイルについては、「ルール」の章を参照ください。

シグナル1

判定条件 判定対象 **その他**

メモ

「その他」は、シグナルに対するメモ書きを自由に書き込むことができます。

3-3) 全体設定

ルール設定	シグナル設定	全体設定	バックテスト	売買指示	テクニカル指標計算	ランキングビ
バックテスト初期資産		<input type="radio"/> 現物 最大レバレッジ <input checked="" type="radio"/> 信用 <input type="text" value="1"/> 倍		<input type="text" value="3,000,000"/>		
1日あたり最大仕掛け銘柄数		最大保有銘柄数		<input type="text" value="10,000"/> 銘柄		<input type="text" value="10,000"/> 銘柄
成行注文時の余力消費方式						
<input checked="" type="radio"/> 値幅制限上限で計算(証券会社の余力消費計算と同様。指値の場合は指値) <input type="radio"/> 当日終値で計算						
取引コスト						
<input checked="" type="checkbox"/> 取引コストを考慮する						
売買手数料(1往復)売買代金の		<input type="text" value="0.05"/> [%]				
売買手数料(1往復)		<input type="text" value="100"/> [円]				
信用金利		<input type="text" value="2.8"/> [%/年]				
貸株料		<input type="text" value="1.2"/> [%/年]				
ルール優先度(数値の低いもの優先)						
ルール1優先度		<input type="text" value="2"/>		ルール2優先度		<input type="text" value="1"/>

「バックテスト初期資産」

バックテストを行う際の初期の手持ち資産を定義します。

「現物、信用」

バックテスト、売買指示において現物取引を行うか、信用取引を行うか？を選択します。

「最大レバレッジ」

信用取引において、手持ちの資産(当日)に対して、何倍までのポジションを保有するか？を決定します。

手持ち資産とは、「当日の現金残高」+「当日の評価損」(評価益の場合は足さない)を意味します。

「取引コスト」

取引にかかわるコストを設定できます。ここでは

「信用金利%/年」「貸株料%/年」「売買手数料（1 往復）売買代金の*%」「売買手数料（1 往復）円」が指定できます。各トレード毎に、手数料はトレード毎に合計されます。信用金利は信用・買いのトレードの場合に合算されます。貸株料は信用・売りのトレードの場合に合算されます。バックテストのトレード履歴に「取引コスト」の欄に合算されたコストが表示されます。

「1 日あたり最大仕掛け銘柄数」

1 日に仕掛ける銘柄数の最大値を設定できます。

「最大保有銘柄数」

トレード中に保有する銘柄数の最大値を設定できます。たとえばすでにポジションを 3 銘柄保有していて、この値が 5 銘柄に設定されていたとき、最大で 2 銘柄だけ新たに仕掛けることができる。という動作になります。

「成行注文時の余力消費方式」

「値幅制限上限で計算」と「当日終値で計算」が選択可能です。「値幅制限上限で計算」を選択すると、仕掛け注文時に 100 円の株価で 1000 株注文でも注文余力の消費量は $100 \text{円} \times 1000 \text{株} = 100,000 \text{円}$ ではなく、値幅制限上限の値段 $\times 1000 \text{株}$ となります。この余力消費方式は、証券会社での注文受付時に計算される消費量と同じとなります。レバレッジいっぱい付近でのトレードや、現物で資産上限いっぱいまで利用するトレードの場合はバックテストでは注文が通っても、現実のトレードでは注文が出せない。ということがありえます。この方式はそのようなバックテストと現実との乖離を避けようという意味があります。一方レバレッジいっぱいまで利用しないトレードの場合、設定したレバレッジを下回る建て玉総額となる傾向があります。

「当日終値で計算」を選択すると、当日終値 \times 株数。で余力消費がされます。レバレッジいっぱいまで利用しないトレードを行う場合はこちらの方式でも前述のような問題は起きません。その場合設定したレバレッジ付近での建て玉総額となる傾向があります。

「ルール優先度」

ルールはいくつでも定義できます。それぞれのルールの「仕掛け条件」に合致した銘柄が大量に発生することもあり得ます。このときどのルールの仕掛け対象銘柄を優先して仕掛けていくか？を定義します。ここで設定された数値が小さいほうのルールが優先されます。上図ではルールが二つ定義されているスト

ラテジーなので、2箇所しか入力できないようになっています。
なお、複数のルールで同時に、ある銘柄が仕掛け対象となった場合、優先度の高い（優先度数値の小さい）ルールにおいて仕掛けられます。

複数のルールがある場合の仕掛け優先度の順番は以下の例のようになります。

ルール1(優先度1)	ルール2(優先度1)	ルール3(優先度2)
仕掛け対象銘柄1(1)	仕掛け対象銘柄1(2)	仕掛け対象銘柄1(13)
仕掛け対象銘柄2(3)	仕掛け対象銘柄2(4)	仕掛け対象銘柄2(14)
仕掛け対象銘柄3(5)	仕掛け対象銘柄3(6)	仕掛け対象銘柄3(15)
仕掛け対象銘柄4(7)	仕掛け対象銘柄4(8)	仕掛け対象銘柄4(16)
	仕掛け対象銘柄5(9)	仕掛け対象銘柄5(17)
	仕掛け対象銘柄6(10)	仕掛け対象銘柄6(18)
	仕掛け対象銘柄7(11)	
	仕掛け対象銘柄8(12)	

この例では、ルール1に4つの仕掛け候補、ルール2に8つの仕掛け候補、ルール3に6つの仕掛け候補があるとします。それぞれのルールの仕掛け候補はルールで設定された仕掛け銘柄優先順位で並んでいます。ルールの優先順はルール1、ルール2が優先度1。ルール3が優先度2と設定されていますから、ルール1とルール2は等価。ルール3が優先度が低い。ということになります。このときの仕掛け順番は、銘柄の横の（）内に示した数字の順番で仕掛けていきます。


また、ルールの間で同一の銘柄が重複して仕掛け候補になることがあります。この場合、優先度の低い（優先度数値の大きい）ルールでの仕掛けは「見送り」とされます。「シストレ魂」では、ひとつの銘柄は一度にひとつしか仕掛けとなりません。

3-4) 条件作成操作方法（条件ツリーの操作）

ここでは、条件作成の操作方法について説明します。「シストレ魂」ではすべての条件式は、論理記号（ANDとOR）が節点（ノード）となった、樹状（ツリー状）で表現されます。

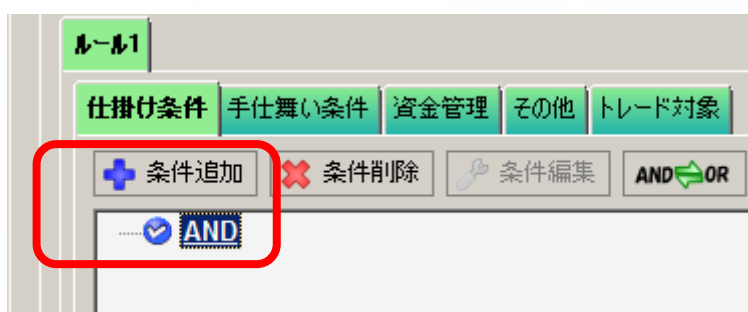
「AND」は「かつ」という意味で、子供としてぶら下がっている条件がすべて成立したときだけ成立します。

「OR」は「あるいは」という意味で、子供としてぶら下がっている条件がひとつでも成立したら、成立します。

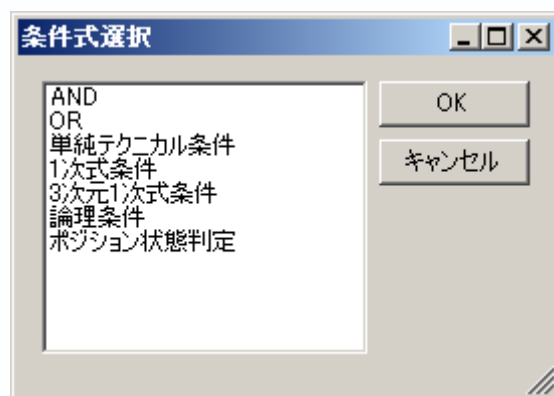
ここでは樹状（ツリー状）の条件作成操作方法について説明します。すべての条件は最初に論理記号が一つだけ存在します。ツリー中の論理記号のANDとORは選択した状態で  ボタンを押すと、または、ダブルクリックすると差し替えることができます。

すべての条件式は、「AND」か「OR」の子供条件として追加していきます。「AND」がさらに論理記号「AND」「OR」を子供条件として持つこともできます。そうすることで、何階層でも複雑な条件を組み合わせて作成することが出来ます。この階層数に制限はありません。

3-4-1) 条件の追加

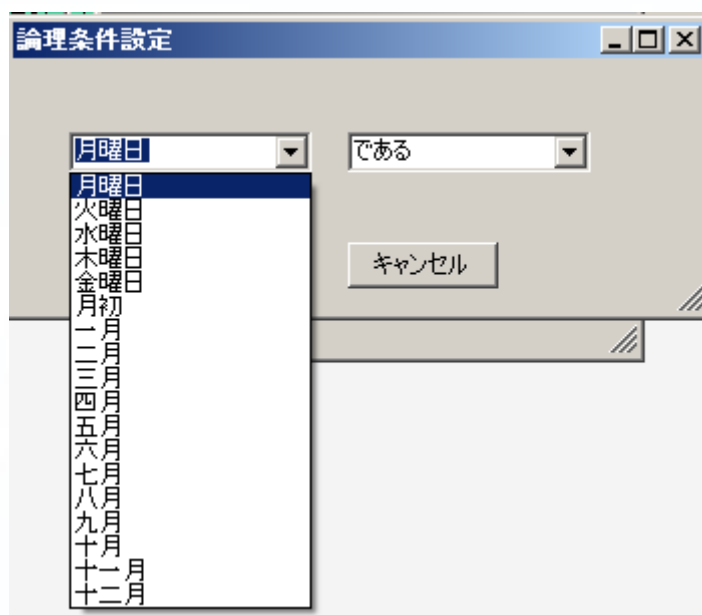


論理記号（AND、OR）に子供条件を追加するには、論理記号を左クリックして選択した状態で「条件追加」ボタンを押します。



「条件式選択」フォームが現れます。「シストレ魂」では条件式には、5種類あります。

「論理条件」…ルールの「仕掛け条件」「手仕舞い条件」で利用できます。



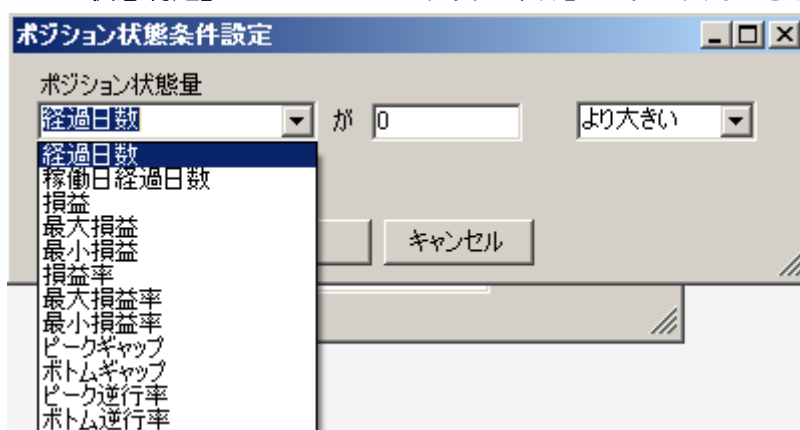
この条件は、「XXである。ではない」という条件で、XXには以下のものが選択可能です。

曜日…月曜日、火曜日、水曜日、木曜日、金曜日

月初…月初

月…1月、2月～12月

「ポジション状態判定」…ルールの「手仕舞い条件」のみで利用できます。



保有しているポジションの状態についての条件式です。以下のものが利用できます。

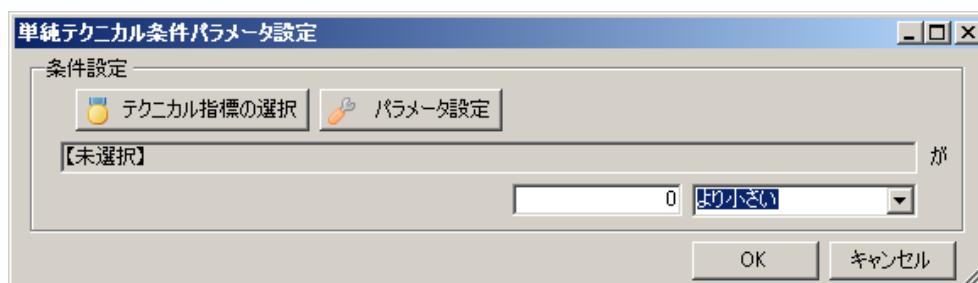
経過日数	ポジション保有日数(土日祝含む)
稼働日経過日数	ポジション保有日数(市場稼働日のみ)
損益	損益[%]
損益率	買い:(現在値-仕掛値)/仕掛値*100 売り:(仕掛値-現在値)/仕掛値*100
最大損益	ポジション建てて以来の最大の含み益[%]
最小損益	ポジション建てて以来の最大の含み損[%]
最大損益率	ポジション建てて以来の最大の含み益率(正の数)
最小損益率	ポジション建てて以来の最大の含み損率(負の数)
ピークギャップ	買い:仕掛後高値-現在値 売り:現在値-仕掛後安値
ボトムギャップ	買い:現在値-仕掛後安値 売り:仕掛後高値-現在値
ピーク逆行率	買い:(仕掛後高値-現在値)/仕掛後高値*100 売り:(現在値-仕掛後安値)/仕掛後安値*100
ボトム逆行率	買い:(現在値-仕掛後安値)/仕掛後安値*100 売り:(仕掛後高値-現在値)/仕掛後高値*100

「単純テクニカル条件」…ルールの「仕掛け条件」「手仕舞い条件」シグナルの「判定条件」で利用できます。この条件はもっとも利用頻度の高い、基本的な条件式です。

「テクニカル指標 と 定数 の大小比較」

という形式の条件式です。

「テクニカル指標」「定数」はユーザが自由に値を設定できます。単純テクニカル条件を選択すると、以下のうようなフォームで条件式を定義できます。

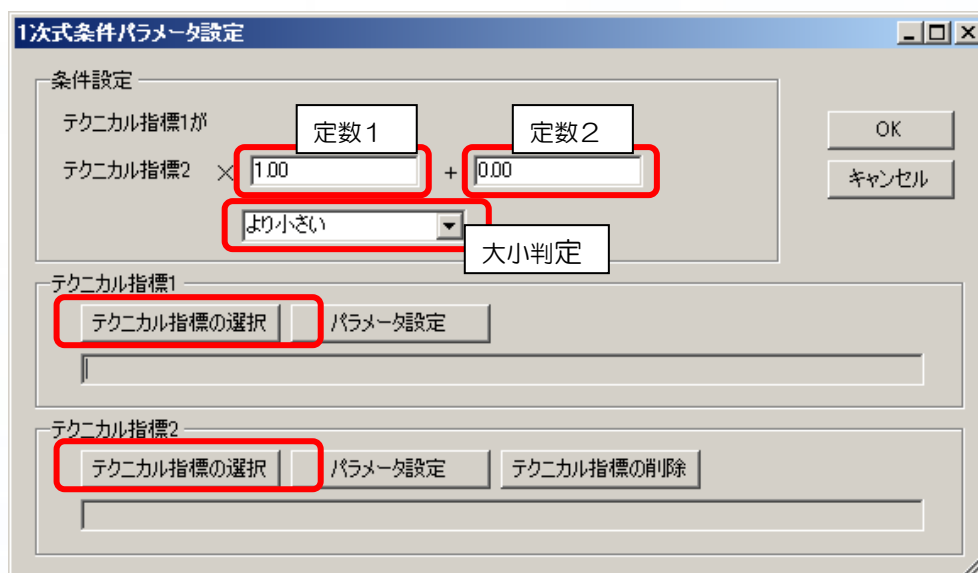


「1次式条件」…ルールの「仕掛け条件」「手仕舞い条件」シグナルの「判定条件」で利用できます。この条件は二つのテクニカルを1次式に組み込んで様々な数値条件を判定できる汎用的な条件式です。

「テクニカル指標1」とテクニカル指標2 × 定数1 + 定数2 との大小比較

という形式の条件式です。

「テクニカル指標1」「テクニカル指標2」「定数1」「定数2」にはユーザが自由に値を設定できます。1次式の大小判定が可能となります。1次式条件を選択すると、以下ののようなフォームで条件式を定義できます。



定数1、定数2、大小判定は上図の場所で設定できます。

「3次元1次式条件」…ルールの「仕掛け条件」「手仕舞い条件」シグナルの「判定条件」で利用できます。この条件は二つのテクニカルを3次元1次式に組み込んで様々な数値条件を判定できる汎用的な条件式です。

テクニカル指標1

と

$$\text{テクニカル指標2} \times \text{定数1} + \text{テクニカル指標3} \times \text{定数2} + \text{定数3}$$

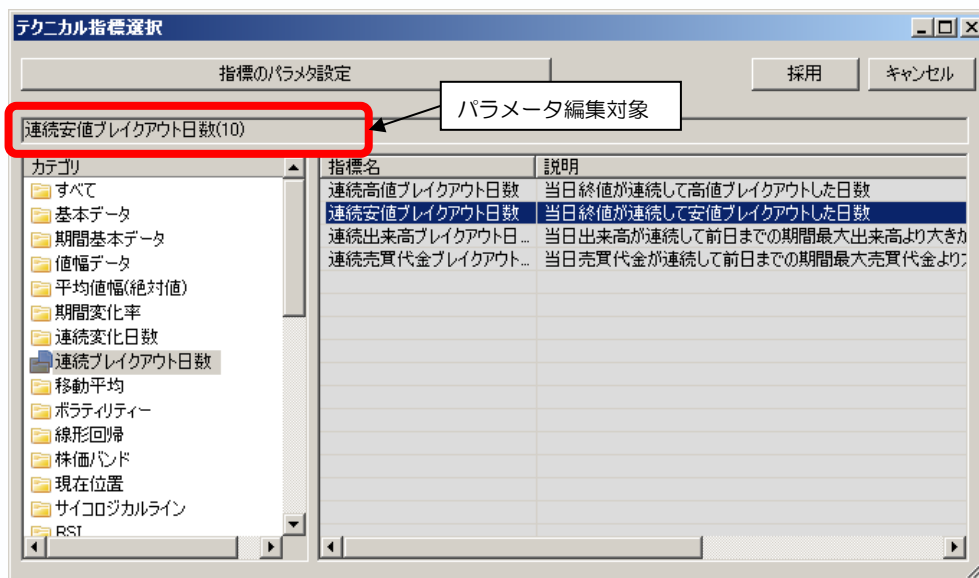
との大小比較

という形式の条件式です。

「テクニカル指標1」「テクニカル指標2」「テクニカル指標3」「定数1」「定数2」「定数3」にはユーザが自由に値を設定できます。3次元の1次式の大小判定が可能となります。3次元1次式条件を選択すると、以下のようなフォームで条件式を定義できます。

3-4-2) テクニカル指標の選択、パラメータの設定

テクニカル指標は、上図の「テクニカル指標選択」ボタンを押すことで選択できるようになります。



この画面ではテクニカル指標の選択と、パラメータの設定が出来ます。左側のビューで、テクニカル指標のカテゴリを選択できます。右側のビューにはカテゴリごとにテクニカル指標の一覧が表示されます。右側のビューでクリックして選択した指標が、パラメータ編集対象となります。

テクニカル指標にはいくつかのタイプがあります。以下にタイプごとに特徴を説明します。

3-4-3) テクニカル指標のタイプ

通常のテクニカル指標

通常のテクニカル指標は、ある日、あるひとつの銘柄について、ひとつの値が算出される数値です。

上図の「指標のパラメタ設定」ボタンを押すと、設定画面が現れます。

ここでは以下の項目が設定できます。

「**対象銘柄**」…条件を評価するすべての銘柄（またはポジション）について評価する場合は「個別銘柄」を選択します。通常はこれを選択します。ここで「特定銘柄」を選択すると、ここで選択された銘柄についてのみ判定する条件式が出来ます。これは、仕掛け条件に、相場全体を判定する条件を入れたい場合に利用できます。たとえば、「日経平均が上昇しているとき」のような条件が「仕掛け条件」「手仕舞い条件」に表現できます。

「**基準日**」…条件式は、毎日終値の時点で評価されますが、 X 日前のテクニカル指標。を表現したい場合に利用します。当日は0、1日前は「基準日」を1と設定します。

「**期間**」…各テクニカル指標に必要な期間のことです。指標ごとに指定が必要な期間の数は異なります。

連動性指標

連動性指標は、2つの銘柄の間の連動性を表した指標です。テクニカル指標の選択画面で「連動性指標」のカテゴリに属します。

「連動性指標」は「仕掛け条件」「手仕舞い条件」「シグナル判定条件」で利用可能です。

「連動性指標」の設定できるパラメータは下図のようになります。

「対象銘柄1」…通常のテクニカル指標と同様です。「特定銘柄」を指定することで、相場全体の状態を評価することもできます。たとえば、「トヨタと日経平均の株価連動率が×××」といったような条件を表現できます。「シグナル判定条件」で利用する場合は「特定銘柄」は利用できません。

「対象銘柄2」…連動性を表したい対象となる第2の銘柄を指定します。デフォルトでは日経平均225種(0101)が選択されています。

「基準日」…通常のテクニカル指標と同様です。

「期間」…通常のテクニカル指標と同様です。

騰落レシオ

相場全体の状態を表すテクニカル指標です。騰落レシオもひとつのテクニカル指標として条件の中で扱えます。テクニカル指標の選択画面で「騰落レシオ」

のカテゴリに属します。「騰落レシオ」は「仕掛け条件」「手仕舞い条件」で利用可能です。

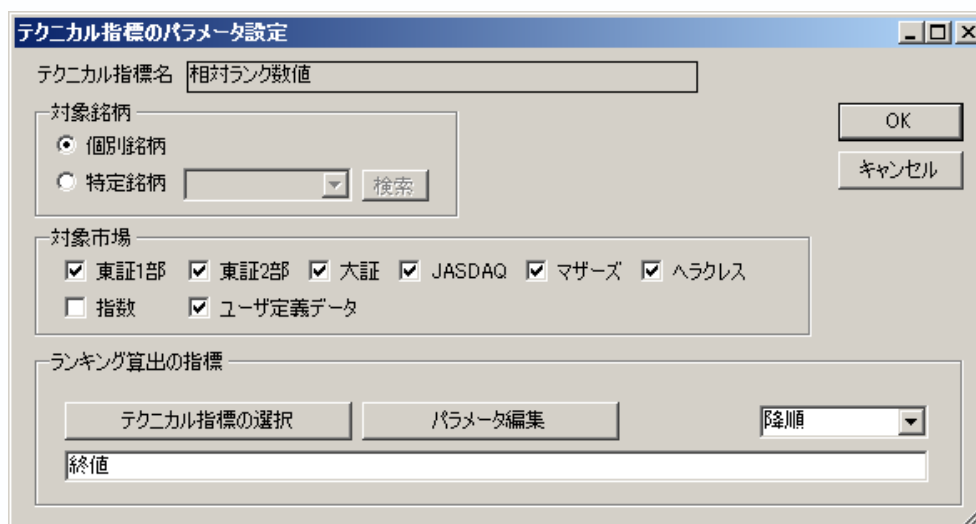
The image shows two screenshots of the 'テクニカル指標のパラメータ設定' (Technical Indicator Parameter Setting) dialog box. The top screenshot is for the '騰落レシオ' (Tendō Reshio) indicator. It has a text field for the indicator name containing '騰落レシオ'. Under '対象市場' (Target Market), there are checkboxes for '東証1部', '東証2部', '大証', 'JASDAQ', 'マザーズ', 'ヘラクレス', '指数', and 'ユーザ定義データ'. The '基準日' (Reference Date) is set to 0 and the '期間' (Period) is set to 5. The bottom screenshot is for the '騰落レシオシグナル' (Tendō Reshio Shigunaru) indicator. It has a text field for the indicator name containing '騰落レシオシグナル'. Under '対象市場', there are checkboxes for '東証1部', '東証2部', '大証', 'JASDAQ', 'マザーズ', 'ヘラクレス', '指数', and 'ユーザ定義データ'. The '基準日' (Reference Date) is set to 0, the '期間' (Period) is set to 5, and the '移動平均期間' (Moving Average Period) is set to 10. Both screenshots have 'OK' and 'キャンセル' (Cancel) buttons at the bottom right.

ここでは、「対象市場」「基準日」騰落レシオの「期間」、騰落レシオシグナルの「移動平均期間」が設定できます。

相対ランキング

あるテクニカル指標による、個別銘柄の相場全体におけるランキング。もテクニカル指標として設定できます。テクニカル指標の選択画面で「相対ランキング」のカテゴリに属します。「相対ランキング」は「仕掛け条件」「手仕舞い条件」で利用可能です。

このテクニカル指標は以下の項目が設定できます。



「対象銘柄」…通常のテクニカル指標と同様です。

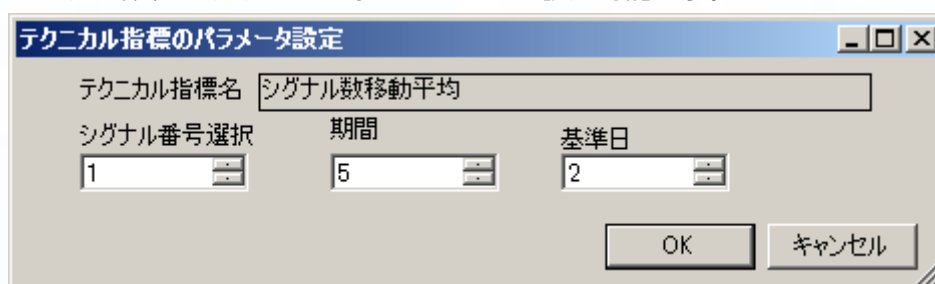
「対象市場」…ランキングを計算する対象の市場を指定します。

「ランキング算出の指標」…どのテクニカル指標（数値）によってランキングを計算するか？を定義します。ならび順として「降順」「昇順」が選択可能です。

シグナル

相場全体の状態を表すのに用いることができます。シグナルはユーザが独自に定義します。「シストレ魂」では「シグナル数」もひとつのテクニカル指標のように1次式条件式の中で扱えます。テクニカル指標の選択画面で「シグナル」のカテゴリに属します。シグナル数は「仕掛け条件」「手仕舞い条件」で利用可能です。

シグナル数、は以下のようなパラメータが設定可能です。



「シグナル番号」…どのシグナルか？を番号で指定します。(1～6)
シグナルとして定義されていない番号を指定している場合は、バックテストなどの計算時に警告が出ます。

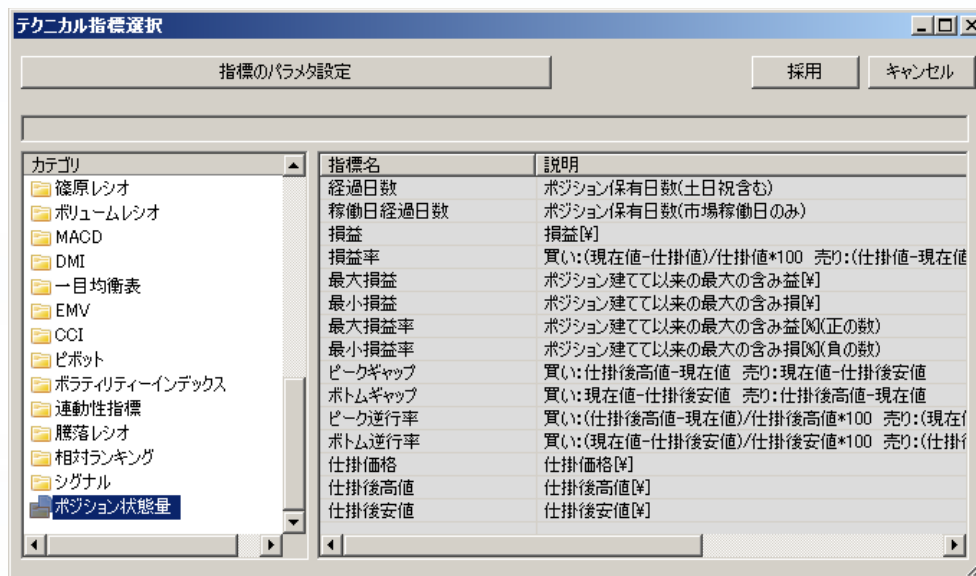
「期間」…移動平均の場合は、平均の期間を指定可能です。

「基準日」…通常のテクニカル指標と同様です。


ポジション状態量

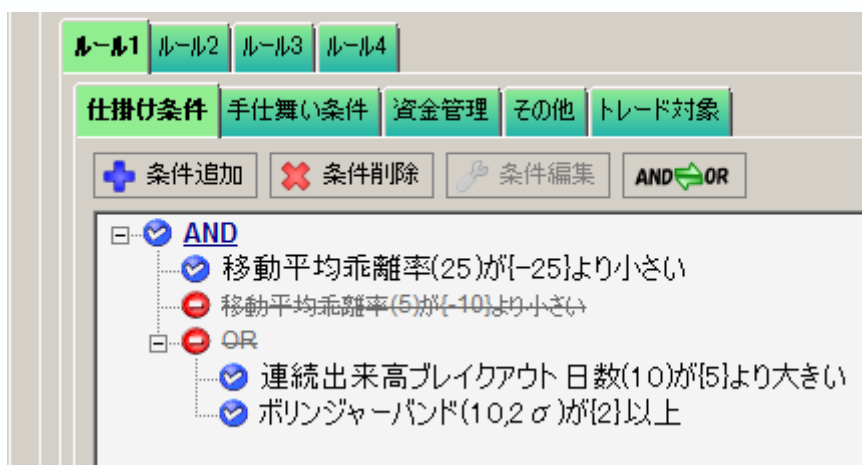
保有しているポジションの状態を表す量(状態量…損益率など)もひとつのテクニカル指標のように1次式の変数として扱うことができます。ポジション状態量は「手仕舞い条件」でのみ利用可能です。

ポジション状態量では、設定できるパラメータはありません。



3-4-3) 条件の無効化・有効化

条件ツリーの各条件の左側のアイコン  をクリックすることで条件の有効・無効を切り替えることができます。



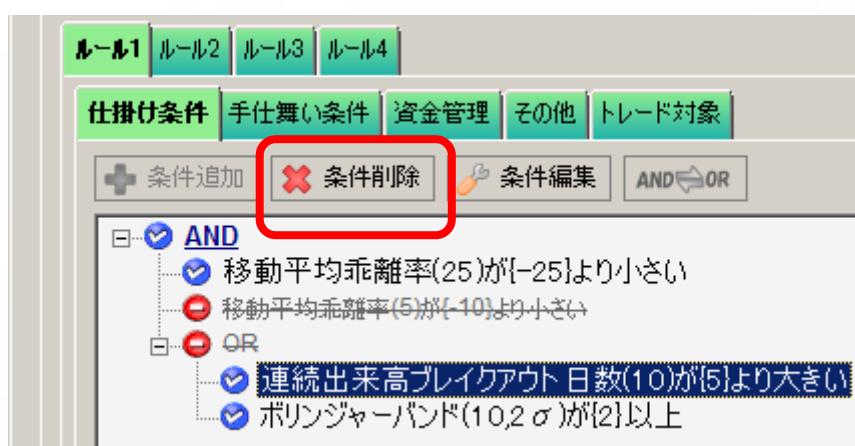
☑ は、条件式が有効になっている状態を表します。

⊖ は、条件式が無効になっている状態を表します。

無効となっている条件式は、無視され、存在しないものとみなされます。

上図のように論理記号（AND、OR）が無効となっている場合は、その子供の条件が有効になっていても無視され、存在しないものとみなされます。

3-4-4) 条件の削除

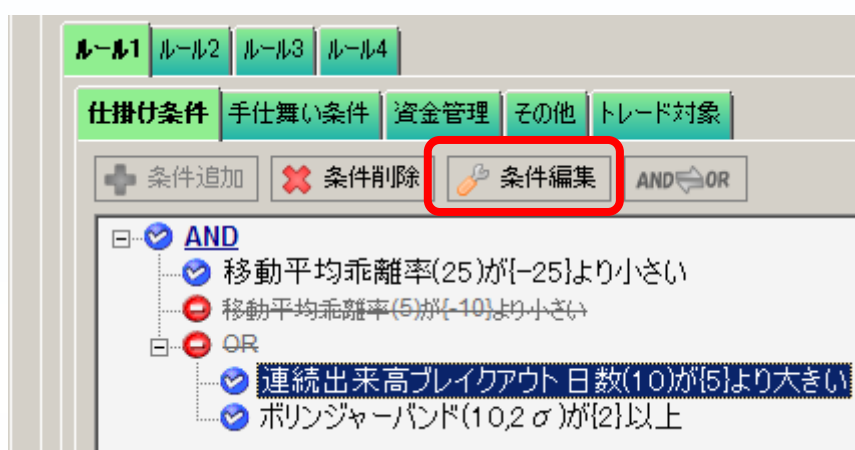


削除したい条件式を選択してから、「条件削除」ボタンを押すことで条件式を削除することができます。論理記号（AND、OR）を選択した場合は、その子

供の条件も一緒に削除されます。

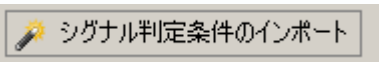
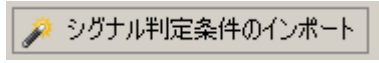
また、条件を選択した状態で、PCの Delete キーを押すことで削除することもできます。

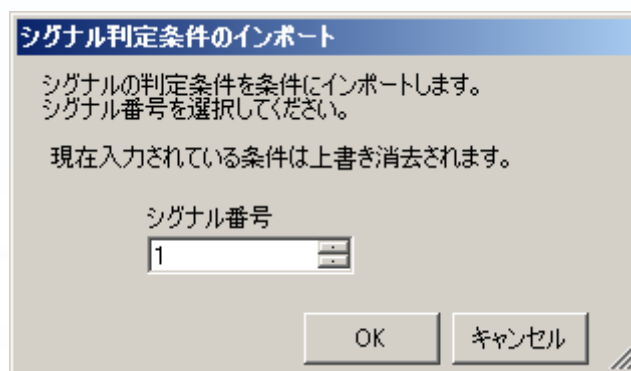
3-4-5) 条件の編集



入力されている条件式を編集したい場合は、編集したい条件式を選択してから、「条件編集」ボタンをおすことで、または、条件式をダブルクリックすることで、編集が出来るようになります。

3-4-6) シグナル判定条件のインポート

仕掛け条件、手仕舞い条件にて  ボタンを押すことで、現在編集中のストラテジーに定義されたシグナルの「判定条件」をそのままインポートすることができます。仕掛け条件にシグナル条件と同じものを利用したい場合などに便利です。  を押すと、以下のダイアログが現れます。現在編集されているストラテジーに定義されたシグナルが選択可能になります。



インポートの元となるシグナル判定条件をもったシグナル番号を選択して「OK」ボタンを押すと、条件がそのままコピーされてインポートできます。

3-4-7) 条件のドラッグ&ドロップ（移動とコピー）

あるひとつの条件ツリーの中で、条件をドラッグ&ドロップすることが可能です。条件を左クリックでつかんだまま、ほかの条件にドロップすると、ドロップ位置の条件の下の位置につかまれた条件が移動します。ドロップ先の条件が論理記号の場合は、その論理記号の子供条件の最初に挿入されます。

また、ドラッグ&ドロップ操作をPCの「Ctrl キー」を押しながら行くと、条件文をコピーすることが出来ます。

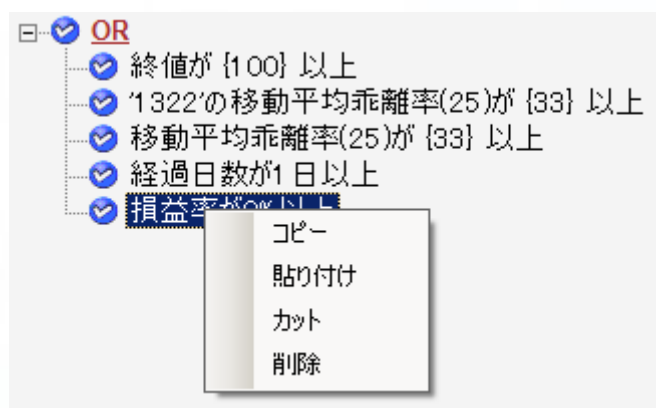
3-4-8) 条件文のコピー&ペースト

ひとつの条件ツリーの中、あるいは、異なる条件ツリーの間にて、条件文をコピー&ペーストすることが可能です。

条件を選択して、Ctrl+C キーを押すことで選択した条件をクリップボードにコピーします。

貼り付け先の条件を選択して、Ctrl+V を押すことで、選択した条件の下に、クリップボードにコピーした条件を貼り付けることが出来ます。ここで選択した条件が論理記号(AND,OR)の場合は、子供条件の最初に貼り付け(ペースト)されます。

また、条件ツリーの条件を「右クリック」することで、以下のようなコンテキストメニューが出てきます。これを選択することでも、コピー・ペースト・カットの作業が出来ます。



このコピー&ペーストは、仕掛け条件、手仕舞い条件、シグナル判定条件など、異なる条件の間で自由に行うことができます。

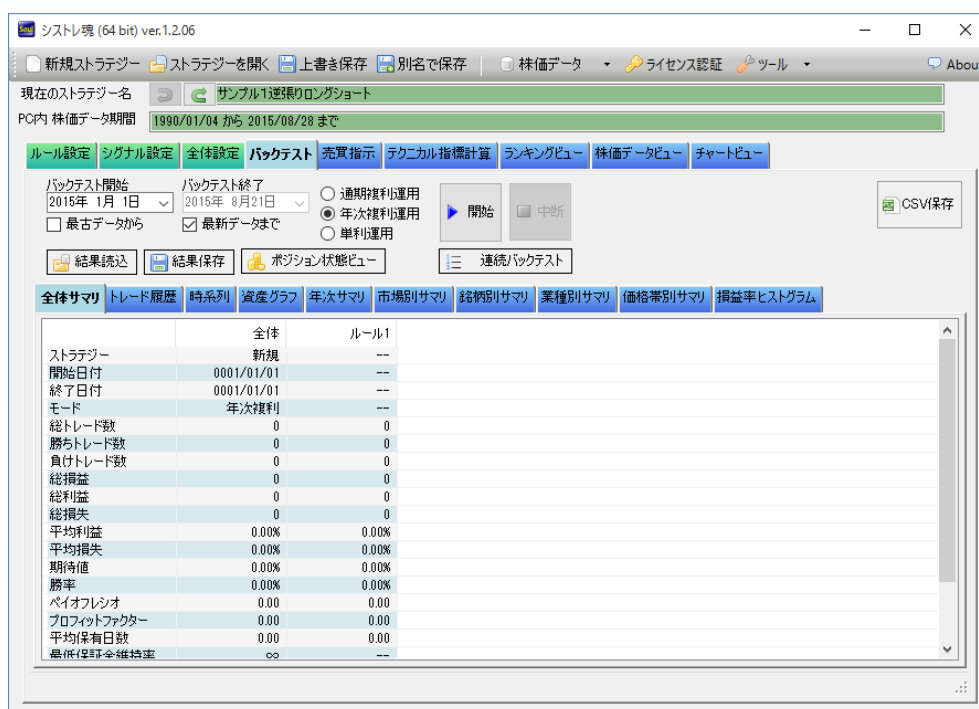
注1) 仕掛け条件と、手仕舞い条件と、シグナル判定条件では、それぞれ互換性のない条件が存在します。その場合は、Ctrl+V を行ったときに「貼り付けられない」というメッセージが出ます。(例：ポジション状態に関する条件文を含む場合は、仕掛け条件、シグナル判定条件には貼り付け不可。ランキングを用

いた条件文は、シグナル判定条件に貼り付け不可。など)

注2) また、仕掛け条件、手仕舞い条件にて利用しているテクニカル指標が特定銘柄を利用している場合に、シグナル条件に貼り付けした場合は、特定銘柄を利用していない条件に変形されて貼り付けされます。

● 第4章：バックテスト

バックテストでは、第4章で作成したストラテジーにしたがって、過去の株価データを用いて売買シミュレーションを実施して、ストラテジーの有効性を確認することができます。



ここでは、以下の機能があります。

「バックテスト開始」…バックテストの開始日を指定します。

「バックテスト終了」…バックテストの終了日を指定します。

「通期複利運用」…バックテスト開始日以降の通期で複利運用されます。

「年次複利運用」…毎年年初に「全体条件」で指定した「初期資産」に戻り、ポジションも何も持っていない状態になります。毎年年末に保持していたポジションは、年末の終値で強制決済された結果となります。

「単利運用」…毎日、「現金+現物簿価」が「初期資産」と等しくなるように初期化されます。これによって、超短期のストラテジーなどにおいて、バックテストの日付が経過しても、資金量の増減はなくなり、ストラテジーの時期的なパフォーマンスの優劣が確かめられるようになります。

「**開始**」…バックテストの計算を開始します。

「**中断**」…計算中のバックテストを中断して、そこまでの結果を得ることができます。

「**結果保存**」…バックテスト結果をバックテスト結果ファイル（拡張子 br）に保存することができます。

「**結果読込**」…保存したバックテスト結果ファイル（拡張子 br）を読み出すことができます。

「**CSV保存**」…選択されたタブで表示されているバックテスト結果をCSV形式ファイルにて保存することができます。

バックテスト結果には様々なものがあります。様々な観点からパフォーマンスの分析ができ、ストラテジーの改良に役立ってます。以下に説明します。

4-1) 全体サマリ

全体サマリ	トレード履歴	時系列	資産グラフ	年次サマリ	市場別サマリ
	全体	ルール1			
ストラテジー	test	--			
開始日付	2000/01/01	--			
終了日付	2010/06/17	--			
モード	通期複利	--			
総トレード数	5232	5232			
勝ちトレード数	4144	4144			
負けトレード数	1088	1088			
総損益	61,730,339	61,730,339			
総利益	99,363,140	99,363,140			
総損失	-37,632,801	-37,632,801			
平均利益	11.11%	11.11%			
平均損失	-16.69%	-16.69%			
期待値	5.33%	5.33%			
勝率	79.20%	79.20%			
ペイオフレシオ	0.67	0.67			
プロフィットファクター	2.64	2.64			
平均保有日数	7.69	7.69			
最低保証金維持率	35.55%	--			
最大DD率(評価)	29.39%	--			
最大DD率(実現)	10.68%	--			
平均年利	33.33%	--			

バックテスト全体のパフォーマンスの要約が表示されます。複数のルールが定義されているストラテジーの場合は、ルールごとのパフォーマンス要約も表示されます。

4-2) トレード履歴

バックテストのなかのすべてのトレードの一覧が表示されます。

全体サマリ	トレード履歴	時系列	資産グラフ	年次サマリ	市場別サマリ	銘柄別サマリ	業種別サマリ	価格帯別サマリ	損益率ヒストグラム		
コード	銘柄名	市場	業種	仕掛日	仕掛値	手仕舞日	手仕舞値	株数	損益額	損益率	逆▲
5451	淀川...	東1	鉄鋼	2000/02/16	228	2000/02/17	270	2000	84,000	18.42%	
6011	新潟...	東1	機械	2000/02/16	81	2000/02/17	98	6172	104,924	20.99%	
6114	住倉...	東2	機械	2000/02/16	213	2000/02/24	228	338	5,070	7.04%	
6453	シルバ...	東1	機械	2000/02/16	185	2000/02/17	225	1000	40,000	21.62%	
8003	(株)ト...	東1	商社	2000/02/16	114	2000/02/24	136	4164	91,608	19.30%	
8028	ファミリ...	東1	小売業	2000/02/16	4,710	2000/02/18	5,200	100	49,000	10.40%	
8172	第一...	東1	小売業	2000/02/16	61	2000/02/17	66	2138	10,690	8.20%	
8260	井筒屋	東1	小売業	2000/02/16	203	2000/02/17	219	2000	32,000	7.88%	
8866	コマ...	ジャス	不動産	2000/02/16	389	2000/03/06	523	46	6,164	34.45%	
9309	京神...	大証	倉庫	2000/02/16	370	2000/03/27	390	2	40	5.41%	
1917	ニッセ...	東1	建設	2000/02/22	84	2000/02/23	85	2146	2,146	1.19%	
3115	テザック	東1	繊維	2000/02/22	51	2000/02/28	60	230	2,070	17.65%	
4091	大陽...	東1	化学	2000/02/22	225	2000/02/24	245	2000	40,000	8.89%	
5562	日本...	東1	鉄鋼	2000/02/22	120	2000/02/28	140	4000	81,000	16.67%	

トレード履歴では、ビューのカラムヘッダ部分（「コード」「仕掛け日」など）をクリックするとリストをカラムごとの昇順、降順で並べ替えることができます。価格・数量は、調整後価格・数量で表示されます。

また、トレードを選択して、マウスでダブルクリックすると、チャートビューに切り替わり、そのトレードの銘柄の仕掛け日を表示します。

4-3) 時系列

バックテスト期間中の毎日の資産状況を時系列で表示します。

全体サマリ	トレード履歴	時系列	資産グラフ	年次サマリ	市場別サマリ	銘柄別サマリ	業種別サマリ	価格帯別サマリ	損益率ヒストグラム
日付	資産時価	現金	現物簿価	建て玉総額	評価損益	銘柄数	保証金維持率	累積▲	
2000/03/17(金)	7,217,318	7,205,447	0	818,123	11,871	6	880.73%	2	
2000/03/21(火)	7,227,631	7,267,097	0	323,573	-39,465	5	2,233.69%	2	
2000/03/22(水)	7,231,328	7,295,630	0	125,440	-64,302	4	5,764.77%	2	
2000/03/23(木)	7,244,988	7,295,630	0	125,440	-50,642	4	5,775.66%	2	
2000/03/24(金)	7,282,150	7,286,080	0	96,790	-3,930	3	7,523.66%	2	
2000/03/27(月)	7,269,760	7,286,200	0	94,530	-16,440	1	7,690.43%	2	
2000/03/28(火)	7,361,895	7,286,200	0	1,949,150	75,695	8	373.81%	2	
2000/03/29(水)	7,535,177	7,512,147	0	590,420	23,030	4	1,272.34%	2	
2000/03/30(木)	7,582,357	7,597,947	0	104,220	-15,590	2	7,275.34%	2	
2000/03/31(金)	7,574,137	7,597,947	0	104,220	-23,810	2	7,267.45%	2	
2000/04/03(月)	7,574,137	7,574,137	0	0	0	0	+∞%	2	
2000/04/04(火)	7,574,137	7,574,137	0	0	0	0	+∞%	2	
2000/04/05(水)	7,698,114	7,574,137	0	2,711,025	123,977	12	279.88%	2	
2000/04/06(木)	7,600,450	7,688,365	0	3,477,000	-78,006	16	218.83%	2	

「資産時価」…＝「現金」＋「現物簿価」＋「評価損益」が表示されます。

「現金」…現金残高を意味します。信用取引の場合、建て玉があっても決済が完了するまで現金残高は変化しません。現物取引の場合、建て玉がある場合は現金残高はその分減少します。

「現物簿価」…現物取引の場合、保有株の買値の合計が表示されます。信用取引の場合はこの項目は0となります。

「建玉総額」…信用取引の場合、建て玉の[数量×仕掛値]の合計が表示されます。現物取引の場合は、この項目は0となります。

「評価損益」…信用建て玉、または保有株の評価損益の合計が表示されます。

「銘柄数」…信用建て玉、または保有株の銘柄数が表示されます。

「保証金維持率」…信用取引の場合表示されます。

「累積実現損益」…決済が終了して、損益が確定したものについての通算損益が表示されます。

「DD金額(評価)」…資産時価のドローダウンの大きさを金額で表示します。

「DD率(評価)」…資産時価のドローダウンの大きさを率(%)で表示します。

「DD日数(評価)」…資産時価のドローダウンが発生してからの日数(カレンダー)で表示します。

「DD金額(実現)」…実現資産のドローダウンの大きさを金額で表示します。

「DD率(実現)」…実現資産のドローダウンの大きさを率(%)で表示します。

「DD日数(実現)」…実現資産のドローダウンが発生してからの日数(カレンダー)で表示します。

ここで、実現資産とは、信用取引の場合「現金」を、現物取引の場合「現金」+「現物簿価」をあらわします。

「シグナル数」…ストラテジーにシグナルが定義されている場合、毎日のシグナル数が表示されます。複数のシグナルが定義されている場合は複数表示されます。シグナルがひとつも定義されていない場合は、この項はありません。

※DD(ドローダウン)とは…

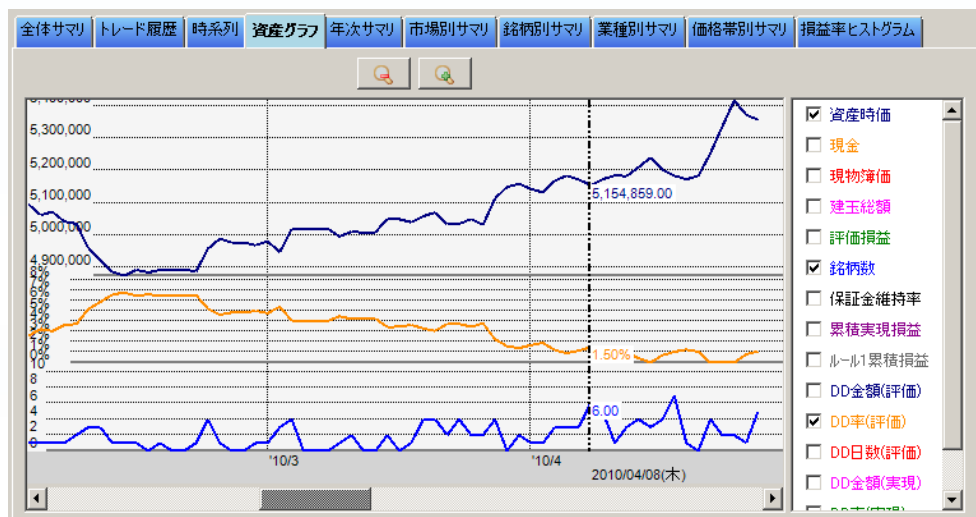
トレードを行っていくと、その結果として毎日の「資産時価」が増えたり減ったりします。ある時点での「資産時価」がバックテスト期間中の「過去最大の資産時価」から減った場合、ドローダウンが発生している。といいます。「過去最大の資産時価」から減った金額が「DD金額」。減った割合が「DD率」%。

「過去最大の資産時価」を下回った日からの経過日数が「DD日数」となります。また、「最大DD(ドローダウン)」とは「DD率」のバックテスト期間中の最大値を意味します。

4-4) 資産グラフ

「資産グラフ」では、前項の「時系列」をグラフでビジュアルに確認することができます。右側のペインの凡例のチェックボックスをチェックすることで、チェックされた項目がグラフに表示されます。

また、資産グラフをマウスでクリックすると、その位置に縦線が表示され、日付と各グラフの数値が表示されます。この縦線は、左右キーにて移動することができます。



4-5) 年次サマリ

各年度ごとの、パフォーマンスの全体サマリーが表示されます。

全体サマリ	トレード履歴	時系列	年次サマリ	市場別サマリ	銘柄別サマリ	業種別サマリ	価格帯別サマリ	損益率ヒストグラム				
年次	年初資産	年末資産	年利	勝ち数	負け数	勝率	平均利益	平均損失	POR	PF	期待値	平
2006	10,000,000	14,909,513	49.10%	376	218	63.30%	5.87%	-5.53%	1.06	1.79	1.68%	
2007	14,939,713	21,726,737	45.43%	460	325	58.60%	6.15%	-6.16%	1.00	1.38	1.05%	
2008	21,381,733	28,032,278	31.10%	683	471	59.19%	5.51%	-6.41%	0.86	1.22	0.64%	
2009	28,111,478	32,361,928	15.12%	447	335	57.16%	4.74%	-5.17%	0.92	1.19	0.49%	

「年次複利」を選択した場合は、各年次の初期資産は「全体設定」で指定された初期資産が「年初資産」に入ります。通期複利を選択した場合は毎年の年初の「資産時価」が表示されます。

4-6) 市場別サマリ

市場別のパフォーマンスのサマリーが表示されます。

全体サマリ	トレード履歴	時系列	年次サマリ	市場別サマリ	銘柄別サマリ	業種別サマリ	価格帯別サマリ	損益率ヒストグラム
市場	勝ち数	負け数	勝率	平均利益	平均損失	POR	PF	期待値
指数	0	0	0.00%	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%
ヘラ	214	149	58.95%	7.42%	-7.44%	1.00	1.37	1.32%
マザーズ	259	142	64.59%	6.36%	-7.43%	0.86	1.48	1.48%
大証	28	29	49.12%	4.98%	-7.65%	0.65	0.57	-1.44%
ジャス	263	217	54.79%	6.24%	-6.45%	0.97	1.02	0.50%
東1	1107	763	59.20%	4.81%	-5.03%	0.96	1.34	0.79%
東2	95	49	65.97%	6.09%	-6.86%	0.89	1.60	1.68%
ユーザ定義	0	0	0.00%	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%

4-7) 銘柄別サマリ

銘柄ごとのパフォーマンスサマリーが表示されます。

全体サマリ	トレード履歴	時系列	年次サマリ	市場別サマリ	銘柄別サマリ	業種別サマリ	価格帯別サマリ	損益率ヒストグラム	
コード	銘柄名	勝ち数	負け数	勝率	平均利益	平均損失	POR	PF	期待値
1334	マルハニチロホ...	2	0	100.00%	5.28%	0.00%	0.00	0.00	5.28%
1352	ハウスイ	1	0	100.00%	1.08%	0.00%	0.00	0.00	1.08%
1378	雪国まいたけ	0	1	0.00%	0.00%	-0.53%	0.00	0.00	-0.53%
1379	ホクト	1	0	100.00%	4.14%	0.00%	0.00	0.00	4.14%
1400	ルーデン・ホール...	1	1	50.00%	12.99%	-42.63%	0.30	0.38	-14.82%
1407	ウエストホールディ...	1	1	50.00%	2.12%	-1.13%	1.89	1.21	0.50%
1408	サムシングホール...	1	1	50.00%	7.83%	-6.09%	1.29	1.00	0.87%
1414	ショーボンドホ...	1	0	100.00%	4.55%	0.00%	0.00	0.00	4.55%
1491	中外鉱業	1	0	100.00%	0.83%	0.00%	0.00	0.00	0.83%
1503	住友石炭鉱業(...	2	1	66.67%	2.56%	-0.95%	2.68	5.25	1.39%
1515	日鉄鉱業	1	0	100.00%	1.75%	0.00%	0.00	0.00	1.75%
1518	三井松島産業	3	6	33.33%	7.61%	-7.93%	0.96	0.50	-2.75%
1605	国際石油開発...	1	0	100.00%	6.50%	0.00%	0.00	0.00	6.50%
1712	ダイセイ環境ソ...	1	1	50.00%	2.80%	-5.44%	0.51	0.62	-1.32%
1722	ミサワホーム	4	2	66.67%	5.33%	-19.41%	0.27	0.60	-2.92%
1729	三光ソランホ...	1	0	100.00%	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%
1731	(株)ペイントハウス	2	0	100.00%	8.50%	0.00%	0.00	0.00	8.50%
1735	伊田テクノス(株)	1	0	100.00%	3.55%	0.00%	0.00	0.00	3.55%
1739	SEED	1	0	100.00%	1.14%	0.00%	0.00	0.00	1.14%

4-8) 業種別サマリ

業種別のパフォーマンスのサマリーが表示されます。

全体サマリ	トレード履歴	時系列	年次サマリ	市場別サマリ	銘柄別サマリ	業種別サマリ	価格帯別サマリ	損益率ヒストグラム
業種	勝ち数	負け数	勝率	平均利益	平均損失	POR	PF	期待値
ガス	2	0	100.00%	9.16%	0.00%	0.00	0.00	9.16%
ゴム	9	4	69.23%	4.54%	-9.49%	0.48	0.94	0.22%
サービス	531	348	60.41%	6.26%	-6.71%	0.93	1.34	1.13%
その他金融	101	92	52.33%	4.96%	-5.07%	0.98	1.06	0.18%
その他製造	24	21	53.33%	4.50%	-4.29%	1.05	1.49	0.40%
パルプ・紙	4	5	44.44%	4.77%	-4.20%	1.14	1.07	-0.21%
医薬品	24	19	55.81%	5.48%	-6.60%	0.83	1.10	0.15%
化学	72	48	60.00%	5.00%	-4.76%	1.05	1.75	1.10%
海運	25	12	67.57%	5.23%	-5.86%	0.89	1.95	1.63%
機械	111	73	60.33%	4.99%	-5.56%	0.90	1.32	0.81%
銀行	24	16	60.00%	3.40%	-3.60%	0.95	1.26	0.60%
空運	2	2	50.00%	6.59%	-8.48%	0.78	0.69	-0.94%
建設	77	46	62.60%	5.93%	-8.72%	0.68	1.04	0.45%
鉱業	8	7	53.33%	4.63%	-6.93%	0.67	0.75	-0.77%
自動車	51	43	54.26%	3.83%	-4.60%	0.83	0.95	-0.03%
商社	127	81	61.06%	5.18%	-5.71%	0.91	1.35	0.94%
小売業	115	89	56.37%	5.44%	-5.43%	1.00	1.09	0.70%
証券	17	9	65.38%	7.11%	-3.13%	2.27	2.53	3.56%
情報・通信	50	41	54.95%	6.24%	-5.47%	1.14	1.44	0.96%

4-9) 価格帯別サマリ

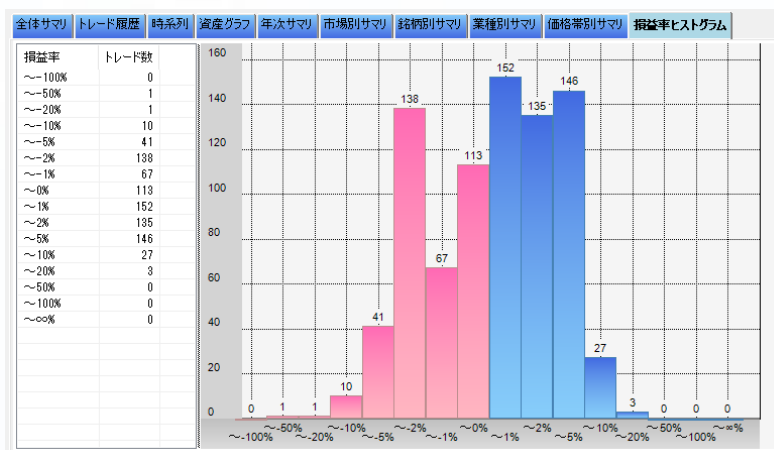
価格帯別のパフォーマンスのサマリーが表示されます。

全体サマリ	トレード履歴	時系列	年次サマリ	市場別サマリ	銘柄別サマリ	業種別サマリ	価格帯別サマリ	損益率ヒストグラム
価格帯	勝ち数	負け数	勝率	平均利益	平均損失	POR	PF	期待値
~10	0	0	0.00%	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%
~20	0	0	0.00%	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%
~50	0	0	0.00%	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%
~100	11	7	61.11%	5.09%	-7.80%	0.65	0.96	0.07%
~200	200	130	60.61%	5.51%	-5.53%	1.00	1.50	1.16%
~500	335	242	58.06%	5.05%	-5.40%	0.93	1.25	0.67%
~1,000	278	198	58.40%	5.24%	-5.24%	1.00	1.28	0.88%
~2,000	214	152	58.47%	4.86%	-5.19%	0.94	1.23	0.69%
~5,000	184	139	56.97%	4.79%	-5.49%	0.87	1.08	0.37%
~10,000	33	43	43.42%	6.75%	-6.46%	1.04	0.65	-0.73%
~20,000	40	36	52.63%	7.39%	-11.30%	0.65	0.74	-1.46%
~50,000	62	56	52.54%	7.44%	-7.99%	0.93	0.99	0.12%
~100,000	128	72	64.00%	7.49%	-7.29%	1.03	1.88	2.17%
~200,000	216	135	61.54%	5.39%	-6.44%	0.84	1.34	0.84%
~500,000	228	119	65.71%	6.02%	-5.61%	1.07	1.93	2.03%
~1,000,000	37	20	64.91%	5.76%	-4.70%	1.23	2.67	2.09%
~+∞	0	0	0.00%	0.00%	0.00%	0.00	0.00	0.00%

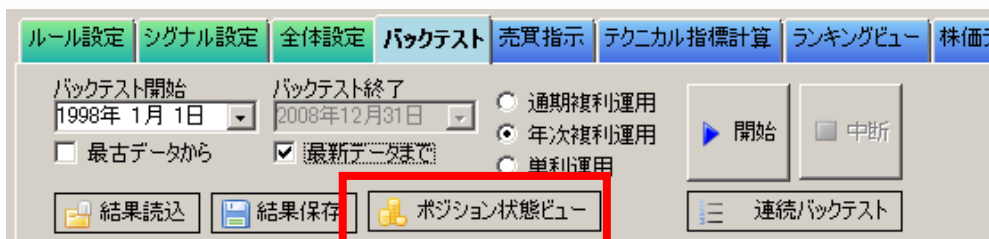
※価格は、仕掛け価格の調整前価格で表示されます。(調整前価格とは、株式分割・併合による価格調整を行う前のオリジナルの価格のことです)「トレード履歴」は調整後価格・数量で表示されていますので、留意ください。

4-10) 損益率ヒストグラム

トレードの損益率(%)のヒストグラム(度数分布表)を表示します。



4-11) ポジション状態ビュー



バックテストタブにて、バックテスト結果が表示されている状態で、ポジション状態ビューボタンを押すとポジション状態ビューが開きます。

The screenshot shows the 'ポジション状態ビュー' (Position Status View) window. It displays summary statistics at the top and a table of positions below. The summary statistics include: 現金 (Cash) 36,379,022, 保証金維持率 (Margin Maintenance Rate) 198.84%, 評価損益 (Evaluation P/L) -1,650,381, 建玉総額 (Total Open Orders) 17,465,551, and 建玉数 (Number of Open Orders) 17. The table lists various securities with columns for Code, Name, Evaluation P/L, Market, Buy/Sell, Build Date, Build Price, Current Value, Quantity, and Lot Size.

コード	銘柄名	評価損益	市場	売買	建日	建価格	現在値	数量	玉サイズ
8868	(株)アーバン...	-1,378,854	東1	買	2008/08/07	104	2	13,490	1,402,960
6665	エルピーダ...	-278,347	東1	買	2008/08/29	2,405	1,949	609	1,464,645
6506	安川電機	-188,210	東1	買	2008/09/02	719	625	2,000	1,438,000
8878	日本綜合地...	-10,780	東1	買	2008/09/02	193	191	5,315	1,025,795
2702	日本マクドナ...	-2,422	ジャス	買	2008/09/04	1,479	1,467	200	295,800
3048	ビックカメラ	52,427	東1	買	2008/09/04	47,250	49,750	21	992,250
3332	JFE商事ホ...	-16,479	東1	買	2008/09/04	539	534	3,270	1,762,530
5855	アサヒブリテ...	-102,024	東1	買	2008/09/04	2,505	2,380	815	2,041,575
6460	セガサミーホ...	-9,105	東1	買	2008/09/04	956	950	1,500	1,434,000
6817	スミダコーポ...	-12,620	東1	買	2008/09/04	890	848	300	267,000
7545	西松屋チエ...	-68	東1	買	2008/09/04	850	850	1,100	935,000
8258	セディナ	-2,773	東1	買	2008/09/04	249	247	1,374	342,126
8473	SBホールデ...	-87,930	東1	買	2008/09/04	16,650	15,980	131	2,181,150
8571	NISグループ	-32,026	東1	買	2008/09/04	112	102	3,200	358,400
8841	テーオーシー	1,783	東1	買	2008/09/04	394	397	600	236,400
8874	(株)ジョイント...	420,583	東1	買	2008/09/04	82	126	9,560	783,920
8934	サンフロンティ...	-3,537	東1	買	2008/09/04	36,000	35,750	14	504,000

ポジション状態ビューでは、指定した日付の「引け後」に保有しているポジションの状態を再現して表示します。実際の証券口座の「建て玉一覧」に相当する情報を再現することが出来ます。バックテスト結果を振り返り、メンタルトレーニングに生かすことができます。

●第5章：売買指示

「売買指示」は、「バックテスト」で開発したストラテジーのロジックに基づいて日毎トレーディングを行うために利用します。

毎日の売買行動は、当日の仕掛け対象銘柄の抽出、当日の資産状況（余力）の把握（現金残高、ポジションサイズ、評価損益）、仕掛け銘柄の決定（仕掛け量）、見送り銘柄の決定。決済ポジションの決定。を行わなくてはなりません。ユーザは「売買指示」機能を利用することで、ユーザが開発したストラテジーの設定に従った売買行動の指示を簡単に得ることが出来ます。

これによって、バックテストと同様のパフォーマンスで実際に運用することができるようになります。

「売買指示」は、当日の「現金残高」と「保有ポジション」を与えることで得られます。

「クリア」ボタンを押すと、ポジションファイルの指定を解除することができます。

「CSV保存」ボタンで、得られた売買指示をCSV形式ファイルに出力することが出来ます。実運用で発注する際に便利です。

当日日付

売買指示を出力する日付を入力します。過去の日付を指定して、過去の売買指示を見ることもできます。

当日現金残高

売買指示を得る当日の現金残高を入力します。

当日ポジションファイル

ユーザは当日保有しているポジション（建て玉、または保有銘柄）のリストをCSV形式ファイルで作成して「参照」ボタンにて指定します。

指定したポジションファイルの読み込みに成功すると、以下のように「当日保有ポジション」タブに内容が表示されます。

仕掛け(23)	手仕舞い(2)	見送り(12)	当日保有ポジション(3)				
コード	銘柄名	業種	仕掛け日	仕掛け値	株数	簿価	ルール番号
4820	EMシステムズ	サービス	2007/03/05	2,695	300	808,500	1
3713	ネットマークス	サービス	2007/03/02	81,300	9	731,700	2
9231	国際航業(株)	空運	2007/03/02	490	1,640	803,600	2

ポジションファイルのフォーマットは以下のように作成します。

	A	B	C	D	E	F
1	コード	仕掛け日	仕掛け値	株数	ルール番号	
2	5012	2009/7/22	921	1000	1	
3	7260	2009/7/17	112	2000	1	
4	8879	2009/7/14	868	500	1	
5	1377	2009/7/23	1,386	300	1	
6	6205	2009/7/15	90	1000	1	
7	6222	2009/7/16	2,320	600	1	
8						
9						

1 列目「コード」…銘柄コード

2 列目「仕掛け日」…2003/1/4 という数値形式で入力します。

3 列目「仕掛け値」…仕掛け価格を数値で入力します。

4 列目「株数」…数量を数値で入力します。

5 列目「ルール番号」…どのルールに基づくポジションか？を数値で与えます。

1 行目は、必ず「コード」「仕掛け日」「仕掛け値」「株数」「ルール番号」を記

述。

ポジションファイルのサンプルファイル（Position サンプル.csv）は
[Windows 7 , Windows Vista の場合]

c:\Users\ユーザー名\Documents\シストレ魂\ポジションファイル

[Windows XP の場合]

c:\Documents and Settings\ユーザー名\My Documents\シストレ魂\ポジションファイル

に配置されていますので、これを元に作成してください。

引け後（Data-Get）

通常のデータゲットによる日足データを用いた売買指示を利用するときに選択します。データゲットの日足データは、ザラバが引けたあと19時ごろ配信されるため、翌日の執行に関する売買指示をえるときに利用します。

このオプションでは、保有ポジション、当日現金残高がバックテストと同じであれば、バックテストと同じ結果が得られます。

引け後売買指示では、「当日引成」での「仕掛け」「手仕舞い」指示は表示されません。「当日引成」を利用しているルールは「引け前売買指示」を利用します。

引け前(タワー)・・・リアルタイム売買指示

タワー(<http://www.tower.bz/main/login.php>)が配信するザラバのリアルタイムデータを取り込んでザラバ中に売買指示を得るときに選択します。タワーのリアルタイムデータは、約1分ごとにユーザが取得することができます。このデータを利用することで引け前の最新の株価で、引け時点で執行するタイプのストラテジーの売買指示を得ることが出来るようになります。この機能を利用するには、別途タワーチケット(1890円/月 2010.9 現在)を購入しておく必要があります。購入したタワーチケット(とパスワード)を「タワーチケット」「タワーパスワード」の欄に入力します。

The screenshot shows the 'Tower' software interface with the 'Buy Order' (売買指示) tab selected. The interface includes a top navigation bar with tabs like 'Rule Setting', 'Signal Setting', 'Global Setting', 'Backtest', 'Buy Order', 'Technical Indicator Calculation', 'Ranking Computer', 'Stock Data Viewer', and 'Chart Viewer'. Below the navigation bar, there are fields for 'Today's Date' (2014年 8月25日) and 'Today's Cash Balance' (2,500,000 円). There are 'Start' (開始) and 'Stop' (中断) buttons, and a 'CSV Save' (CSV保存) button. The 'Today's Position File' (当日ポジションファイル) is set to 'None' (ポジションなし). Under 'Tower Ticket' and 'Tower Password', there are input fields. A 'Timer Interrupt' (タイマー中断) section is checked, with a timer set to 14:57:08. A checkbox for 'Automatic Order Entry at Timer Interrupt' (タイマー中断時に証券会社に自動発注する) is also checked. A table at the bottom shows order details with columns for Code, Name, Market, Type, Buy, Quantity, Today's End Price, Price, Bid Price, Execution Conditions, and Order Region.

このオプションを選択して売買指示を「開始」すると、タワーにアクセスしてザラバデータを取得して最新の株価で売買指示を更新し続けます(約1分ごと)。「中断」ボタンを押すことでその時点での売買指示を得ることができます。あるいは「タイマー中断」チェックボックスをオンにして時刻を設定することで、パソコンの日時が「当日日付」の指定した「時」「分」「秒」を超えた時点で自動で中断することができます。これによって指定した時刻の売買指示をえることができます。

自動発注機能

ここで「タイマー中断時に証券会社の自動発注する」をチェックすると、指定時刻に「発注魂」が開き、証券会社に最新の売買指示票を自動発注します。このとき「発注魂」がすでに開いていても開いていなくてもどちらでも構いま

せん。「発注魂」が起動されたときに開いている証券会社と ID、パスワードで自動発注が動作しますので、実際にこの自動発注機能を利用する前に「発注魂」を手動で開いて証券会社の ID とパスワードを入力してログインテストが成功することを確認してください。「ツール」「証券会社にログインテストする」で実行できます。

—引け前売買指示では、当日引け執行での「仕掛け」「手仕舞い」指示のみが表示されます。

—引けでの執行（手仕舞い、仕掛け）と、寄り付きでの執行（手仕舞い・仕掛け）が混在するストラテジーを運用する場合は、この引け前売買指示によって引け前に執行（注文）してから、日足が確定した後に引け後売買指示を行って引け後の執行（注文）を行うように利用します。

—（注意）タワーを用いたリアルタイム売買指示を利用する際は、データゲットによる株価データ追加(Data-GET より)を行ってから利用してください。言い換えるとリアルタイム売買指示当日の1稼働日前の日足データが読み込まれた状態で（PC 内株価データ期間で確認）リアルタイム売買指示を利用します。また、タワーを用いたリアルタイム売買指示機能は、PC 内株価データ期間に含まれる日付は指定できません。

—（注意）ザラバ中の最新株価は常に変化する可能性があります。したがって引け直前に得られるリアルタイム売買指示と引け後に得られるデータゲットデータによる売買指示では異なる結果がでることがあります。また、バックテストは引け後の日足データを利用していますので、バックテスト結果と引け前売買指示が異なる結果を出力することがあります。この性質を理解したうえで利用してください。（引け後売買指示においては、ポジション、当日現金残高がバックテストと同じであれば、バックテストと同じ結果が得られます）

仕掛け

仕掛け(23)	手仕舞い(12)	見送り(12)	当日保有ポジション(3)								
コード	銘柄名	市場	業種	売買	株数	当日終値	代金	指値	執行条件	優先順位値	ルール番号
2432	ディー...	マザー...	サービス	買い...	2	350,000	700,000	350,000	翌日寄指	2,973,918,0...	1
5401	新日...	東1	鉄鋼	買い...	1,000	796	796,000	796	翌日寄指	251,591,87...	2
9474	ゼンリン	東1	サービス	買い...	200	3,120	624,000	3,120	翌日寄指	1,301,574,0...	1
7541	メガネ...	東1	小売業	買い...	1,000	792	791,667	792	翌日寄指	345,663,516	1
5016	新日...	東1	石油	買い...	500	932	466,000	932	翌日寄指	9,355,455,0...	2
7004	日立...	東1	機械	買い...	4,500	176	792,000	176	翌日寄指	8,546,265,5...	2
5491	日本...	東1	鉄鋼	買い...	1,000	500	500,000	500	翌日寄指	7,009,737,0...	2
8020	兼松	東1	商社	買い...	3,000	238	714,000	238	翌日寄指	5,129,346,0...	2
8607	みずほ...	東1	証券	買い...	2,000	278	556,000	278	翌日寄指	4,292,228,0...	2
1662	石油...	東1	鉱業	買い...	100	7,810	781,000	7,810	翌日寄指	3,514,630,0...	2
6720	プリヴェ...	東2	その他...	買い...	6,845	119	814,555	119	翌日寄指	1,362,312,0...	2
8734	アスト...	ジャス	証券	買い...	8	92,000	736,000	92,000	翌日寄指	1,339,367,5...	2
6519	エネサ...	東1	電気...	買い...	1,542	528	814,176	528	翌日寄指	1,140,931,2...	2

「仕掛け」タブには、売買指示の結果の当日の仕掛け銘柄が表示されます。売買、執行条件、数量、指値などがストラテジーの設定に基づいて算出されています。これにしたがって注文を行うとよいでしょう。また、どのルールに基づく仕掛けか？も表示されていますので、実際の保有ポジションの管理などに利用してください。

また、銘柄をひとつ選択して、マウスでダブルクリックすると、チャートビューに切り替わり、その銘柄の売買指示の日付部分を表示します。

手仕舞い

仕掛け(23)	手仕舞い(12)	見送り(12)	当日保有ポジション(3)								
コード	銘柄名	市場	業種	売買	仕掛け値	株数	当日終値	評価損益	執行条件	ルール番号	決済理由
3713	ネットマ...	東1	サービ...	買い...	81,300	9	79,900	-12,600	翌日寄成	2	経過日数...
9231	国際航...	東1	空運	買い...	490	1,640	436	-88,560	翌日寄成	2	経過日数...

「手仕舞い」タブには、売買指示の結果の当日の手仕舞い銘柄が表示されます。また、銘柄をひとつ選択して、マウスでダブルクリックすると、チャートビューに切り替わり、その銘柄の売買指示の日付部分を表示します。

見送り

仕掛け(5)	手仕舞い(0)	見送り(1740)	当日保有ポジション(0)									
コード	銘柄名	市場	業種	当日総値	売買単位	売買	株数	指値	執行条件	優先順位値	ルール番号	見送りの理由
5002	昭和シェル...	東1	石油	693	100	買い建て	700	709	翌日指値	-1.911	1	余力不足
8276	平和堂	東1	小売業	1,131	100	買い建て	400	1,144	翌日指値	-1.900	1	余力不足
7925	前澤化成工...	東1	化学	813	100	買い建て	600	822	翌日指値	-1.895	1	余力不足
4527	ロート製薬	東1	医薬品	1,063	1,000	買い建て	0	1,083	翌日指値	-1.883	1	高値
2597	ユニカフェ	東1	食品	558	100	買い建て	800	567	翌日指値	-1.881	1	余力不足
7757	日本電産サ...	東1	精密...	758	1,000	買い建て	0	781	翌日指値	-1.877	1	高値
8053	住友商事	東1	商社	985	100	買い建て	400	1,004	翌日指値	-1.873	1	余力不足
4676	フジメディア...	東1	情報...	123,800	1	買い建て	3	126,600	翌日指値	-1.871	1	余力不足
5992	中央発條	東1	非鉄...	281	1,000	買い建て	1,000	294	翌日指値	-1.851	1	余力不足
7552	ハビネット	東1	商社	1,050	100	買い建て	400	1,068	翌日指値	-1.851	1	余力不足
9684	スクウェア...	東1	サービス	1,774	100	買い建て	200	1,817	翌日指値	-1.848	1	余力不足
1961	三機工業	東1	建設	587	1,000	買い建て	0	597	翌日指値	-1.839	1	高値
6927	パリオス テ...	東1	電気	273	100	買い建て	1,700	280	翌日指値	-1.834	1	余力不足
7601	ポプラ	東1	小売業	530	100	買い建て	900	535	翌日指値	-1.834	1	余力不足

仕掛け条件に合致していても、余力の状態、ポジションの状態、銘柄の状態、またはストラテジーの設定（突入制限など）によって仕掛け「見送り」となる銘柄もあります。ここでは仕掛け見送り銘柄の一覧が表示されます。また、銘柄をひとつ選択して、マウスでダブルクリックすると、チャートビューに切り替わり、その銘柄の売買指示の日付部分を表示します。

すべての執行方法の指示を表示する

引け前売買指示に引け以外の指示も、または、引け後売買指示に引けの指示も、表示する。

通常では「引け後」売買指示では、引けに関する仕掛け、手仕舞いの指示を表示しません。同様に、「引け前」売買指示では、引け以外の執行方法による仕掛け・手仕舞いの指示を表示しません。

このチェックボックスをオンにすることですべての執行方法の指示を表示することができます。表示はチェックボタンを変化させたときにすぐに表示されます。

売買指示ファイルの自動保存機能について

売買指示が出た時点（引け後売買指示が出た時点、引け前売買指示を「中断」ボタンを押して得た時点、引け前売買指示を指定時刻にて得た場合）の売買指示の内容が自動的に以下のファイル名で保存されるようになっています。

「仕掛け」は AutoSaveEntry.csv

「手仕舞い」は AutoSaveExit.csv

「見送り」は AutoSaveIgnore.csv

「当日保有ポジション」は AutoSavePosition.csv

保存されるフォルダは

※Vista, Windows7, Windows8, Windows10 の場合：C:\Users\ユーザー名

\Documents\シストレ魂\結果ファイル

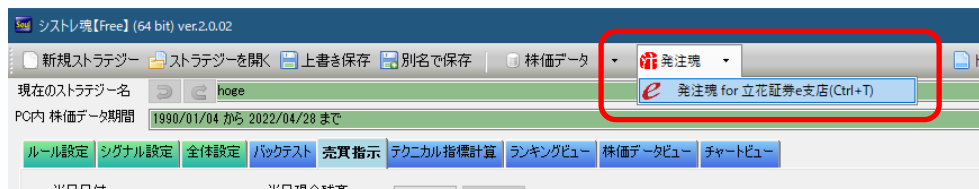
※XP の場合：c:\MyDocument\シストレ魂\結果ファイル

売買指示を算出したタイミングで上記 csv ファイルをエクセルで開いていると警告がでて保存されないのをご注意ください。

●第6章：発注魂（自動発注機能）

発注魂は、「売買指示機能」で得られた「仕掛け」と「手仕舞い」の注文リストを読み込んで証券会社に自動で発注する機能です。

ストラテジーによっては多くの銘柄に「仕掛け」「手仕舞い」する必要があり、証券会社の Web 画面から手入力するのは大変な作業となります。「発注魂」機能を使えばワンクリックで仕掛けも手仕舞いも連続&自動で発注が完了します。



「発注魂」のドロップダウンメニューから利用する証券会社を選択します。

（2022年5月現在、利用できる証券会社は「立花証券e支店」のみとなります）

発注魂が起動します。

6-1)発注魂 for 立花証券 e 支店

発注魂 for 立花証券 e 支店 (v4r2)

ユーザーID 譲渡益税口座区分
 特定期口座
 一般口座

暗証番号 ***** 暗証番号表示
 第2暗証番号 ***** 暗証番号表示
※第2暗証番号の入力は必須です

指示ファイル名を記憶しておく

仕掛け指示ファイル
 再読込

手仕舞い指示ファイル
 再読込

仕掛け(16) 手仕舞い(2) ※チェックボックスがチェックされた注文が発注されます。

コード	銘柄名	市場	業種	売買	株数	当日終値	代金	指
<input checked="" type="checkbox"/>	4503 アステラ...	東証 P	医薬品	買い建て	100	1,978.0	199,800	1.9
<input checked="" type="checkbox"/>	8411 みずほフ...	東証 P	銀行	買い建て	100	1,578.5	159,450	1.5
<input checked="" type="checkbox"/>	6503 三菱電機	東証 P	電気機器	買い建て	100	1,368.0	138,150	1.3
<input checked="" type="checkbox"/>	9503 関西電力	東証 P	電力	買い建て	100	1,140.0	115,100	1.1
<input checked="" type="checkbox"/>	4902 コニカミノ...	東証 P	精密機器	買い建て	400	454.0	183,600	4.5
<input checked="" type="checkbox"/>	7270 SUBA...	東証 P	自動車	買い建て	100	1,959.0	197,850	1.9
<input checked="" type="checkbox"/>	4755 楽天...	東証 P	サービス	買い建て	200	918.0	185,400	9.1
<input checked="" type="checkbox"/>	7202 いすゞ	東証 P	自動車	買い建て	100	1,517.0	153,200	1.5

ポジション取得 自動発注開始 閉じる(Esc)

※自動発注結果は必ず証券会社Web画面から間違いがないか確認するようにしましょう

- ① 証券会社のID、パスワード、口座区分を設定します。
立花証券は、本機能を利用するには第2暗証番号の入力が必須となっています。
- ② 「仕掛け指示ファイル」と「手仕舞い指示ファイル」を指定します。「指示ファイル名を記憶しておく」をチェックしておくと同次回起動したときもファイル名を記憶しておくことができます。
シストレ魂は「売買指示」機能を実行すると自動的に
「C:\User\ユーザー名\Documents\シストレ魂\結果ファイル」フォルダに
仕掛け指示は AutoSaveEntry.csv

手仕舞い指示は AutoSaveExit.csv

というファイル名で指示ファイルを保存します。

これらのファイル名を記憶しておくことで次回以降もファイル名を指定する必要がなくなりますし、売買指示を行ってすぐに発注魂を開くと最新の売買指示結果が読み込まれた状態になっています。

③ 指示ファイル名が指定されるとリストビューに指示ファイルの内容が読み込まれます。銘柄コードの列のチェックボックスにチェックの入った行が自動発注の対象となります。

④ 「自動発注開始」ボタンを押すと「仕掛け」と「手仕舞い」のチェックの入ったすべての行について順次発注が行われます。発注が成功するとチェックがはずれていきます。

何らかの問題があって注文が通らなかった場合はチェックボックスがチェックされたまま残されます。

自動発注が終了したらブラウザで証券会社の注文リストを開いて間違いがないか確認するようにしましょう

⑤ 「ポジション取得」ボタンは立花証券 e 支店で保有している現物株、信用建玉の一覧を取得して「売買指示機能」で必要となるポジションファイルのひな形を作成するための機能です。以下の2点について本機能で作成したポジションファイルのひな形を手修正する必要があります。

- ・現物株の建て日の欄は空欄で作成されます。手入力する必要があります。
- ・カラム名「ルール番号」は「信用」または「現物」と出力されます。売買指示機能に必要なルール番号は、適宜手入力する必要があります。

● 第7章：株価データビュー

「株価データビュー」では、PC内の株価データが時系列で表示されます。

日付↑	市場	始値	高値	安値	終値	出来高	調整係数
2022/04/07	東証 P	2,233.0	2,237.0	2,200.0	2,211.0	7,200	
2022/04/06	東証 P	2,246.0	2,256.0	2,232.0	2,233.0	10,500	
2022/04/05	東証 P	2,256.0	2,272.0	2,250.0	2,255.0	10,800	
2022/04/04	東証 P	2,276.0	2,276.0	2,265.0	2,265.0	4,800	
2022/04/01	東 1	2,284.0	2,324.0	2,270.0	2,276.0	9,800	
2022/03/31	東 1	2,334.0	2,334.0	2,284.0	2,284.0	6,800	
2022/03/30	東 1	2,376.0	2,376.0	2,306.0	2,336.0	9,800	
2022/03/29	東 1	2,409.0	2,442.0	2,359.0	2,442.0	11,100	
2022/03/28	東 1	2,402.0	2,407.0	2,359.0	2,359.0	4,300	
2022/03/25	東 1	2,447.0	2,447.0	2,409.0	2,409.0	8,700	
2022/03/24	東 1	2,417.0	2,425.0	2,395.0	2,425.0	10,600	
2022/03/23	東 1	2,370.0	2,417.0	2,370.0	2,417.0	11,100	
2022/03/22	東 1	2,382.0	2,398.0	2,361.0	2,365.0	7,900	
2022/03/18	東 1	2,332.0	2,408.0	2,332.0	2,408.0	11,200	
2022/03/17	東 1	2,309.0	2,377.0	2,309.0	2,377.0	6,400	
2022/03/16	東 1	2,305.0	2,314.0	2,293.0	2,308.0	5,200	
2022/03/15	東 1	2,306.0	2,306.0	2,290.0	2,305.0	4,000	
2022/03/14	東 1	2,301.0	2,307.0	2,288.0	2,307.0	1,800	
2022/03/11	東 1	2,312.0	2,334.0	2,300.0	2,301.0	6,900	
2022/03/10	東 1	2,285.0	2,400.0	2,285.0	2,380.0	12,100	

「銘柄コード」コンボボックスにて表示したい銘柄を選択します。ユーザー定義データをPCに配置した場合には、このコンボボックスにリストされます。

「調整後株価 / 調整前株価」…過去の株価は株式分割・併合によって調整がされています。調整前株価を選択すると、この調整を行わない当時のオリジナルの株価を表示することができます。


「日付↑」…このカラムをクリックすることで、日付の昇順・降順を切り替えることができます。

「CSV保存」…表示されている株価データをCSV形式ファイルで保存することができます。

「株価リストビュー」ダブルクリック…ビューに表示されている行をダブルク

リックするとチャートビューに表示遷移して当該銘柄の当該日付を表示します。

 ボタンを押すことで、銘柄の検索ツールが起動されます。



コード	銘柄	業種	売買単位
8356	十六銀行	銀行	1,000
8357	北陸銀行	銀行	1
8358	スルガ銀行	銀行	1,000
8359	八十二銀行	銀行	1,000
8360	山梨中央銀行	銀行	1,000
8361	大垣共立銀行	銀行	1,000
8362	福井銀行	銀行	1,000
8363	北國銀行	銀行	1,000

153銘柄

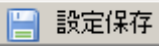
OK キャンセル

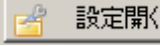
銘柄の検索が出来ます。検索結果をCSV形式で保存することが出来ます。

「テクニカル指標の追加」…このボタンを押すことで、株価ビューに表示されている銘柄に関するテクニカル指標を追加して表示することができます。テクニカル指標は何個でも表示できます。「調整係数」の右側に列が追加されていきます。



ここでは「通常のテクニカル指標」と「連動性指標」が選択可能です。

また、 ボタンにて、現在のテクニカル表示の設定を保存すること

ができます。 ボタンにて、保存されたテクニカル表示の設定を讀

み込むことが出来ます。

●第8章：テクニカル指標計算

ここではすべてのテクニカル指標を時系列で表示することができます。ここで通常のテクニカル指標を表示する場合はどの銘柄か？を「特定銘柄」の項目で指定する必要があります。



日付↑	'0101と7201との相関係数(10)	'8358'の移動平均乖離率(10)	5期間騰落レシオ(東1東2大ジャスマザハラユーザー定義)
2008/04/21(月)	0.9522	3.6036	169.0618
2008/04/18(金)	0.9114	3.2258	119.3905
2008/04/17(木)	0.9068	5.3262	139.5622
2008/04/16(水)	0.8377	0.7129	92.1155
2008/04/15(火)	0.7491	-2.9945	67.7416
2008/04/14(月)	0.6808	-4.2784	54.7767
2008/04/11(金)	0.6234	-2.3040	76.1937
2008/04/10(木)	0.6598	-4.8440	53.9549
2008/04/09(水)	0.6047	-1.6492	73.0207
2008/04/08(火)	0.4828	1.3839	112.0222
2008/04/07(月)	0.3371	5.2392	140.8968
2008/04/04(金)	0.2462	6.7248	105.8792
2008/04/03(木)	0.3902	6.8750	133.9517
2008/04/02(水)	0.3316	10.4574	119.1390
2008/04/01(火)	0.5898	4.0384	88.0489

「開始」…ボタンを押すことで、計算が開始され結果が表示されます。「騰落レシオ」「相対ランキング」「シグナル」などを指定した場合は、計算のため多くの銘柄のデータを読み込む必要があるため、若干の計算時間が必要となります。

「CSV保存」…結果をCSV形式ファイルで保存することが出来ます。

「日付↑」…このカラムヘッダをクリックすることで、日付の降順・昇順を切り替えることができます。

※表示されているテクニカル指標のカラムヘッダをクリックすることで、「パラメータの編集」「削除」が行えます。

●第9章：ランキングビュー

「ランキングビュー」では、指定された日付の様々なテクニカル指標でのランキング表を表示することが出来ます。

順位↓	順位割合	銘柄コード	銘柄名	市場	業種	平均寄付ギ...
1	0.0273	3858	ユビキタス	ジャス	サービス	10,900.00
2	0.0546	2432	ディー・エヌ・エー	東1	サービス	9,600.00
3	0.0818	8967	日本ロジスティク...	東1	その他金融	5,700.00
4	0.1091	3394	ネットワークリ...	マザーズ	商社	4,930.00
5	0.1364	2468	フットレック	マザーズ	サービス	4,600.00
6	0.1637	3856	リアルコム	マザーズ	サービス	4,585.00
7	0.1909	3853	インフォテリア	マザーズ	サービス	4,015.00
8	0.2182	8729	ソニーフィナンシ...	東1	保険	3,890.00
9	0.2455	1605	国際石油開発...	東1	鉱業	3,800.00
10	0.2728	3787	テクノマセマティカル	マザーズ	サービス	3,790.00
11	0.3001	6667	シコー	マザーズ	電気機器	3,610.00
12	0.3273	3793	ドリコム	マザーズ	サービス	3,600.00
13	0.3546	8961	森トラスト総合リ...	東1	その他金融	3,400.00
14	0.3819	3836	ディーバ	ヘラ	サービス	3,310.00
15	0.4092	8964	フロンティア不動...	東1	その他金融	3,200.00
16	0.4364	6677	エスケーエレクトロ...	ジャス	電気機器	2,950.00
17	0.4637	2167	ウェブマネー	ジャス	サービス	2,940.00
18	0.4910	6324	ハーモニック・ドラ...	ジャス	機械	2,910.00

「表示フィルターグループファイル」…ここに指定したグループファイルに含まれる銘柄のみを、ランキング結果として表示します。通常は、指定した対象市場に含まれるすべての銘柄がランキングリストに表示されますが、注目したい銘柄の対象市場でのランキングだけを表示したい場合に利用します。ここで指定するグループファイルのフォーマットは、「ルール」「トレード対象」で利用するグループファイルのフォーマットと同様です。

「日付」…ランキングを表示したい日付を指定します。

「CSV保存」…表示されたランキング表をCSV形式で保存することが出来ます。

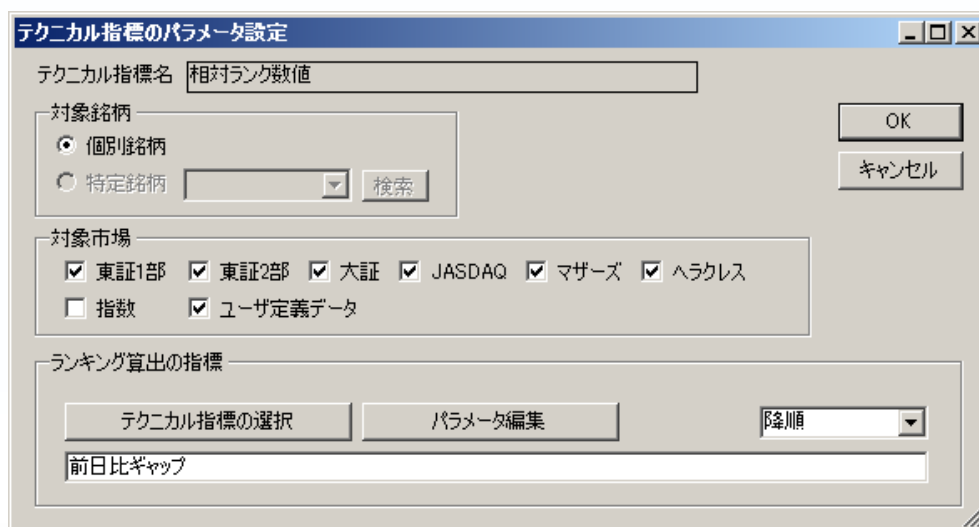
「開始」…ボタンを押すことでランキングの計算が開始され、結果が表示されます。

「順位↑」…このカラムヘッダをクリックすることで、順位の昇順・降順が切

り替わります。

「リストのダブルクリック」…ランキングリストをダブルクリックすると選択されている銘柄の選択されている日付のチャートを表示します。

「ランキングパラメータ設定」…このボタンを押すとランキングパラメータの設定画面が現れます。



ここで様々なテクニカル指標を選択することが出来ます。ここでは「通常のテクニカル指標」「連動性指標」が選択可能です。

●第10章：チャートビュー


チャートビューでは、株価データのチャートが表示できます。





【拡大縮小】…マウスホイールでチャートの縮尺を変更することができます。矢印キーの上下キーでも拡大縮小ができます。

【左右移動】…チャートをマウスの左ボタンでグリップしてドラッグすることでチャートの左右移動ができます。

【日足全体表示】…チャート上でマウス右クリックすると選択されている銘柄の全日足データにフィットさせた表示にすることができます。

 **テクニカル指標追加** ボタンにてテクニカル指標を選択して表示させることができます。

 **設定保存** ボタンにて、現在のテクニカル表示の設定を保存することができます。

 **設定開く** ボタンにて、保存されたテクニカル表示の設定を読み込むことができます。

✖ テクニカル指標全削除 ボタンにて、現在表示されているテクニカル指標をすべて削除することができます。

☑ カーソル水平線の表示 にてマウスカースルに連動した水平線を表示・非表示を切り替えることができます。

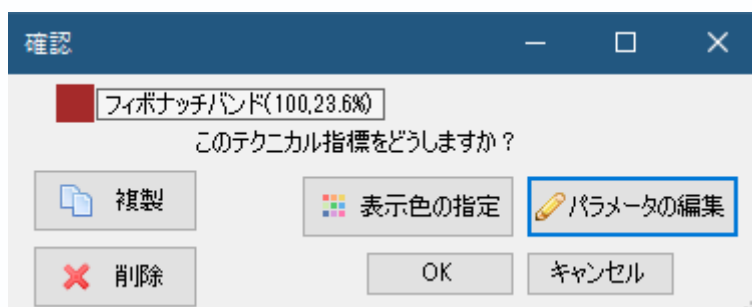


株価表示領域にてマウスを**ダブルクリック**することで固定された水平線を描画することができます。また、**右クリック**でのコンテキストメニューで固定された水平線の**描画・削除**が行えます。

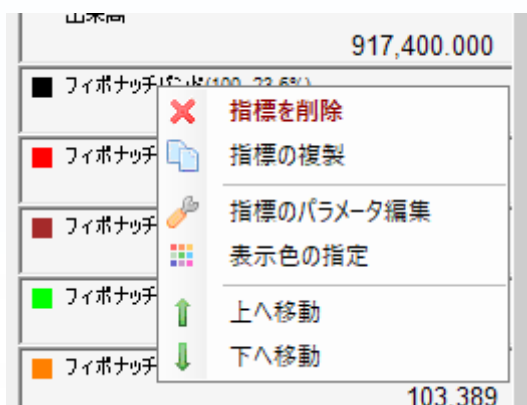


表示されているテクニカル指標の編集・削除・表示色の指定・複製・上下移動

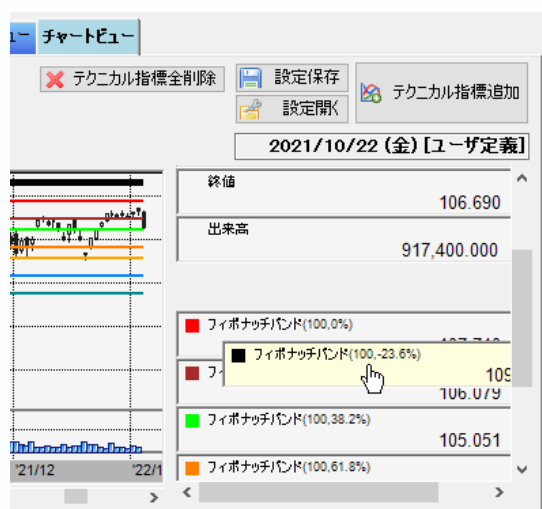
表示されているテクニカル指標を、編集、削除するには、右サイドの凡例をマウスでダブルクリック、もしくは、右クリックしてください。ダブルクリックで編集フォームが現れます。



右クリックでコンテキストメニューが表示され機能が選択できます。



表示されているテクニカル指標をマウス左ボタンでドラッグすることで上下位置を変更することができます。



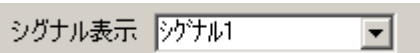
チャート画面を左クリックすることで、カーソル線（縦線）が固定され、右側の凡例の部分に各テクニカル指標の数値が表示されます。



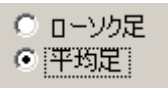
この状態で、キーボードの左右キーを押すことで、カーソル線を左右に移動することが出来ます。押し続けると連続で移動します。

また、キーボードの Ctrl キーを押しながら左右キーを押すとチャートの末端までカーソル線を移動することができます。

キーボードの上下キーでチャートの縮尺を変更することができます。押し続けると連続で拡大縮小できます。



現在読み込まれているストラテジーにシグナルが定義されている場合「シグナル表示」にて、各銘柄のシグナル状況（赤矢印）がチャート上に表示されます。



チャートの表示を通常のローソク足と平均足に切り替えることができます。平均足とは、値動きのトレンドを視覚的に見やすくするための一種のテクニカル指標で、次のように計算されます。

平均足始値＝（1 日前の平均足の始り値＋1 日前の平均足の終値）÷ 2

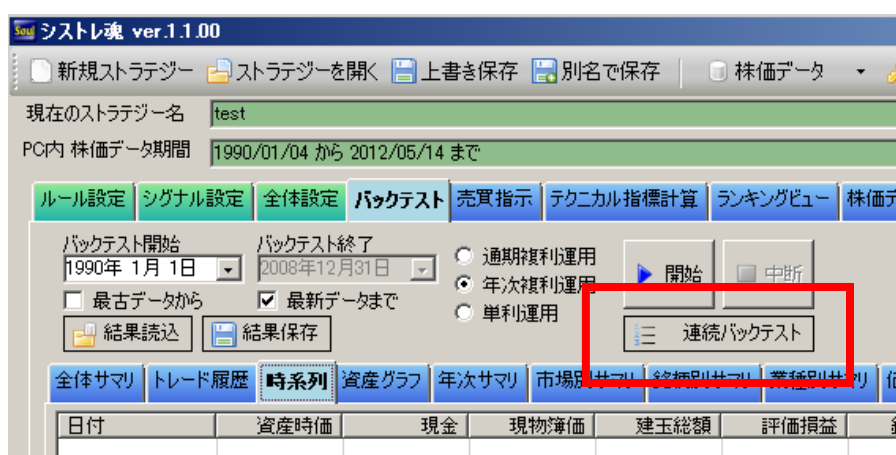
平均足高値＝ローソク足の高値

平均足安値＝ローソク足の安値

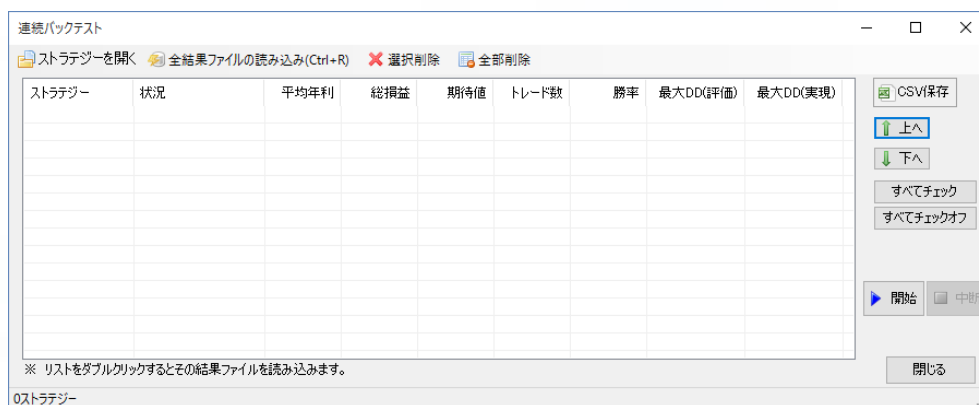
平均足終値＝（ローソク足の始値＋ローソク足の高値＋ローソク足の安値＋ローソク足の終値）÷ 4

●第 11 章：連続バックテスト機能

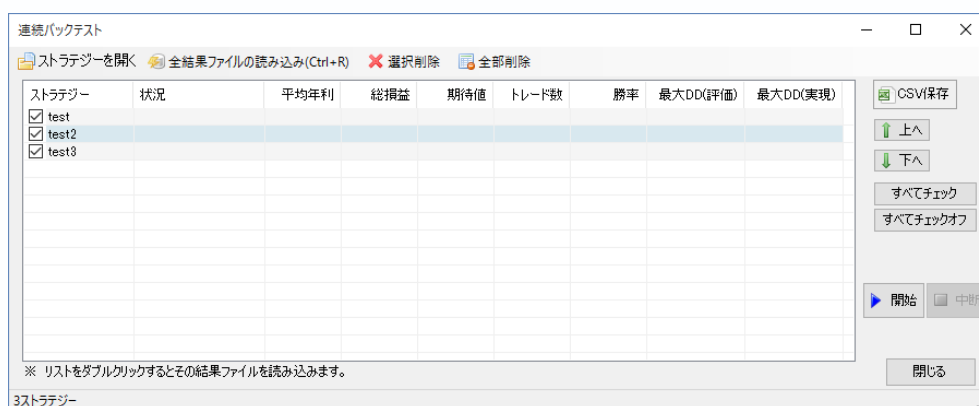
保存してある複数のストラテジーを選択して、連続してバックテストを行い、結果を自動保存する機能です。様々なアイデアのストラテジーを作成しておいて、夜寝ている間などに連続してバックテストすることが可能となります。



「バックテスト」画面の「連続バックテスト」ボタンをクリックすると利用できます。



「ストラテジーを開く」で複数のストラテジーファイルを開くことができます。



3つのストラテジーファイルを開いたところです。

「開始」ボタンを押すと「ストラテジー」列のチェックされているストラテジーが上から順番に連続でバックテストされます。バックテストの期間や単利・複利などの設定は、「バックテスト」画面の設定で実行されます。それぞれバックテストが終了すると、自動的に結果フォルダに結果ファイルが保存されます。自動的に保存される結果フォルダの位置は

※Vista, Windows7, Windows8, Windows10 の場合：

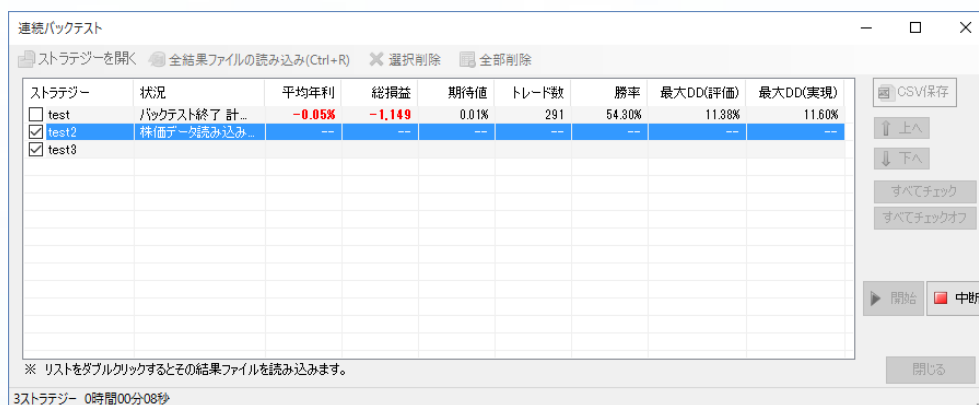
C:\¥Users¥ユーザ名¥Documents¥シストレ魂¥結果ファイル

※XP の場合：

c:\¥MyDocument¥シストレ魂¥結果ファイル

となります。

連続バックテストが終了（または中断）すると、フォームに結果の概要が表示されます。



リストビューのカラム名をクリックすることで、項目ごとにソートすることが出来ます。

ストラテジー	状況	平均年利	総損益	期待値	トレード数	勝率	最大DD(評価)	最大DD(実現)
<input type="checkbox"/> test3	バックテスト終了 計..	7.22%	2,166,140	1.89%	162	66.05%	10.64%	1.66%
<input type="checkbox"/> test	バックテスト終了 計..	-0.05%	-1,149	0.01%	291	54.30%	11.38%	11.60%
<input type="checkbox"/> test2	バックテスト終了 計..	-16.39%	-491,752	-0.51%	457	45.08%	23.07%	24.57%

※ リストをダブルクリックするとその結果ファイルを読み込みます。

3ストラテジー 0時間00分33秒

【結果ファイルの読み込み機能】

連続バックテストが停止している状態で、リストビューの行を選択してダブルクリックすると、上記結果フォルダに該当するストラテジーの結果ファイルが存在すれば、シストレ魂のメイン画面に結果ファイルを読み込んで表示します。同時に連続バックテスト画面にも結果概要が表示されます。

また、Ctrl+R を押すか「全結果ファイルの読み込み」ボタンを押すと、リストにあがっているすべてのストラテジーの結果ファイルを連続して読み込み、結果概要が表示されます。

● 第 12 章：過去パフォーマンス集計機能

この機能を使うと「不調な戦略は切り捨てて、好調な戦略だけを選んで運用する・・・」といったレジームスイッチングモデルの戦略を構築できるようになります。