

MILLION TRADER・MILLION TRADER D を使ったバックテスト例

※ ご注意ください ※

掲載された設定は参考資料であり、記載されている銘柄やパラメータ数値は弊社が推奨・助言するものではありません。

また、掲載されたパフォーマンスや集計結果はストラテジーテスターによる結果を表示したものであり利益を保証するものではありません。

あくまでご利用の際の参考資料としてご活用ください。

直近20日間の最安値を割った銘柄を空売りでデイトレードを行ってみた例 vol.1

1分足で計測した場合、下記のような条件を満たす場合のパラメータ設定です。

【エントリーロジック解説】

MACDの短期MAと長期MAのデッドクロスを空売りエントリーの基本としています。

その他の条件は以下の通りです。

MILLION TRADER

「条件1」:前日終値より当日始値が0.1%以上低い場合はエントリー

「条件2」:前日終値より当日現在値が0.1%以上低い場合はエントリー

「条件3」:当日のエントリー上限回数は2回

「条件4」:その日の損益合計で【0.3】%以上の利益が取れたらエントリーしない

「条件5」:その日の損益合計で【3】%以上の損が出たらエントリーしない

MILLION TRADER D

「条件1」:エントリー株価指定の株価上限を「前日の終値の1円下」

「条件2」:許容 GapUp/Down率が「GapUp率(%以下)=0.1」

「条件3」:当日のエントリー上限回数は2回

「条件4」:その日の損益合計で【0.3】%以上の利益が取れたらエントリーしない

「条件5」:その日の損益合計で【3】%以上の損が出たらエントリーしない

【決済ロジック】

「条件1」:MACDが反転したら決済買い

「利確1」:14時50分以降に株価が更新された場合、銘柄を強制決済

■ストラテジーテスター集計結果

計測日 2021/10/07

検証銘柄 : 日経400採用銘柄(2021/10/07 時点)

足種 : 1分足

計測期間 : 2020/10/07

勝ち取引	4回	全合計勝率	66.67%
負け取引	2回	1エントリー利益率	0.43%
勝ち平均利益	0.71%	利益率合計	2.6%
負け平均損失	-0.12%		

■設定したパラメータ

パラメータセグメント	パラメータ名	MILLION TRADER入力値	MILLION TRADER D 入力値
表示	日足移動平均線 表示	"ON"	"ON"
	移動平均線 表示	"1分足"	"1分足"
基本エントリー条件	手数料	0	0
	エントリー開始日	20211007	20211007
	時間	900	900
	開始日当日限定エントリー	"OFF"	"OFF"
	リアル／バックテスト	"バックテスト"	"バックテスト"
	エントリー選択	空売り	空売り
	逆指値エントリー	"OFF"	"OFF"
	買いトリガー株価	9999	9999
	買いエントリー株価	9999	9999
	空売りトリガー株価	9999	9999
	空売りエントリー株価	9999	9999
基本エントリーロジック	エントリーロジック選択	"MACD"	"MACD"
	指定時間	900	900
	MACD エントリー判定足	1本前	1本前
	EMA or SMA選択	"EMA"	"EMA"
	短期MA	12	12
	長期MA	26	26
	シグナルMA	9	9
	新値足スタート時間	900	900
	基準新値足	3	3
	連続新値足数	3	3
	エントリー条件有効カウント	"OFF"	"OFF"
デイトレ エントリー条件	最大エントリー回数	"上限なし"	"上限なし"
	同日再エントリー制限	"OFF"	"OFF"
	1日エントリー上限	"2"	"2"
	日足MA基準エントリー	"OFF"	"OFF"
	判定足	"1本前"	"1本前"
	VWAP基準エントリー	"OFF"	"OFF"
	判定足	"1本前"	"1本前"
	乖離 順行率(%)	100	100
	乖離 逆行率(%)	0	0
	RSI基準 反発/反落狙い	"OFF"	"OFF"
	RSI期間(足数)	14	14
	判定足	"1本前"	"1本前"
	上限(%)	70	70

	下限(%)	30	30
	条件キャンセル%	"45-55%"	"45-55%"
	寄付きエントリーキャンセル	"OFF"	"OFF"
	許容 GapUp/Down率	"OFF"	"ON"
	GapUp率(%以下)	100	-0.1
	GapDown率(%以上)	-100	-100
	エントリー株価指定	"OFF"	"ON"
	株価上限	99999999	前日終値の1円下を 銘柄ごとに入力
	株価下限	0	0
	日々エントリータイム	"ON"	"ON"
	開始時間(時分)	900	900
	終了時間(時分)	1450	1450
	寄付き様子見/見送り時間	"OFF"	"OFF"
	分数	1	1
	当日利益確保エントリー制限	"ON"	"ON"
	確保ライン利益率(%)	0.3	0.3
	逃避ライン損失率(%)	3	3
	分足MA昇降判定		
	5MA昇降判定	"OFF"	"OFF"
	25MA昇降判定	"OFF"	"OFF"
	75MA昇降判定	"OFF"	"OFF"
決済条件	日足基準線反転決済	"OFF"	"OFF"
	反転決済 判定時間	1450	1450
	日足MA 反転利確	"5MA"	"5MA"
	反転利確 判定時間	1300	1300
	VWAP 反転決済	"OFF"	"OFF"
	判定足	"1本前"	"1本前"
	MACD 反転決済	"ON"	"ON"
	判定足	"1本前"	"1本前"
	強制決済発動日数	1	1
	発動時間	1450	1450
	利確チェック開始時間	1450	1450
	利確判定含み益(%)	0.2	0.2
	銘柄保有日数	1	1
	株価指定 利確/損切	"OFF"	"OFF"
	利確 株価	99999999	99999999
	ロスカット 株価	0	0
トレーリングストップ	ロスカット下落%	100	100
	第1通常TSトリガー利益率%	999	999
	決済 利益率%	0	0

	第1%TSトリガー 含み益%	999	999
	決済 含み益減少率%	0	0
	第2通常TSトリガー利益率%	999	999
	決済 利益率%	0	0
	第2%TSトリガー 含み益%	999	999
	決済 含み益減少率%	0	0
日足エントリー条件	指定値 許容乖離率	"条件2"	
	当日指定値1	"当日 現在値"	
	前日指定値1	"前日 終値"	
	順行率1(%)	100	
	逆行率1(%)	0.1	
	当日指定値1	"当日 始値"	
	前日指定値1	"前日 終値"	
	順行率1(%)	100	
	逆行率1(%)	0.1	
新値足用 パラメータ	1分足MA基準 新値足エントリー	"OFF"	"OFF"
	判定足	"1本前"	"1本前"
	新値足エントリー想定ロス回避	"OFF"	"OFF"
	回避想定ロス上限(%)	0	0
	回避想定ロス上限(呼値)	0	0
	新値足反転ロスカット	"OFF"	"OFF"
	TOPIX100 対応呼び値	"OFF"	"OFF"
	呼値 逆指値	"OFF"	"OFF"
	第1呼値 逆指値発動	999	999
	逆指呼値1	0	0
逆指値	第2呼値 逆指値発動	999	999
	逆指呼値2	0	0
	分足25or75MA 新値足逆指値	"25&75MA"	"25&75MA"
	利確条件 含み益%	0.3	0.3