

# マルチチャート 設定マニュアル

2019/12/26

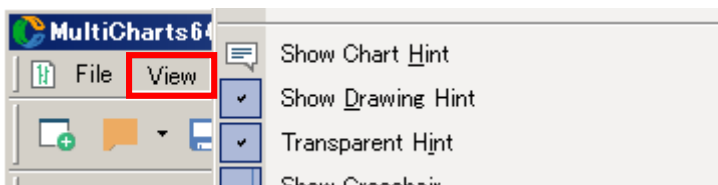
## 第9編 パフォーマンス・レポートの基本的な読み方

皆さんがマルチチャートにストラテジーを適用した際、必ず行うことのひとつに、ストラテジーのパフォーマンス・チェックを上げることができるでしょう。

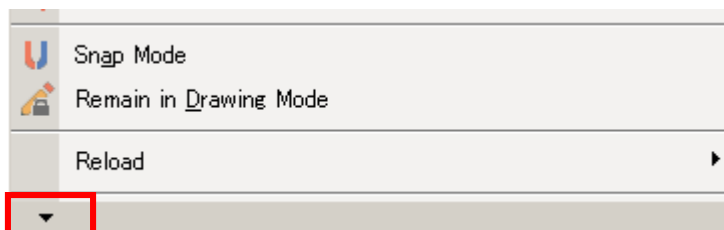
本編では、マルチチャートで表示されるパフォーマンス・レポートの読み方をご紹介します。マルチチャートのパフォーマンス・レポートでは、数多くの数値（指標）やグラフを見ることができますが、そのすべてをいきなり理解して頂くより、まずは有名なものを中心に主要な指標やグラフをご紹介します。

①マルチチャートで、ストラテジーの入ったチャートを表示したら、下記のような手順で、パフォーマンス・レポートを表示させることができます。

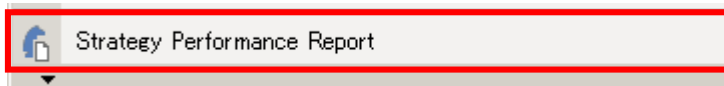
（手順1）マルチチャートの View をクリックします。



（手順2）View をクリックし、ウィンドウの一番下に行きます。一番下の▼をクリックします。

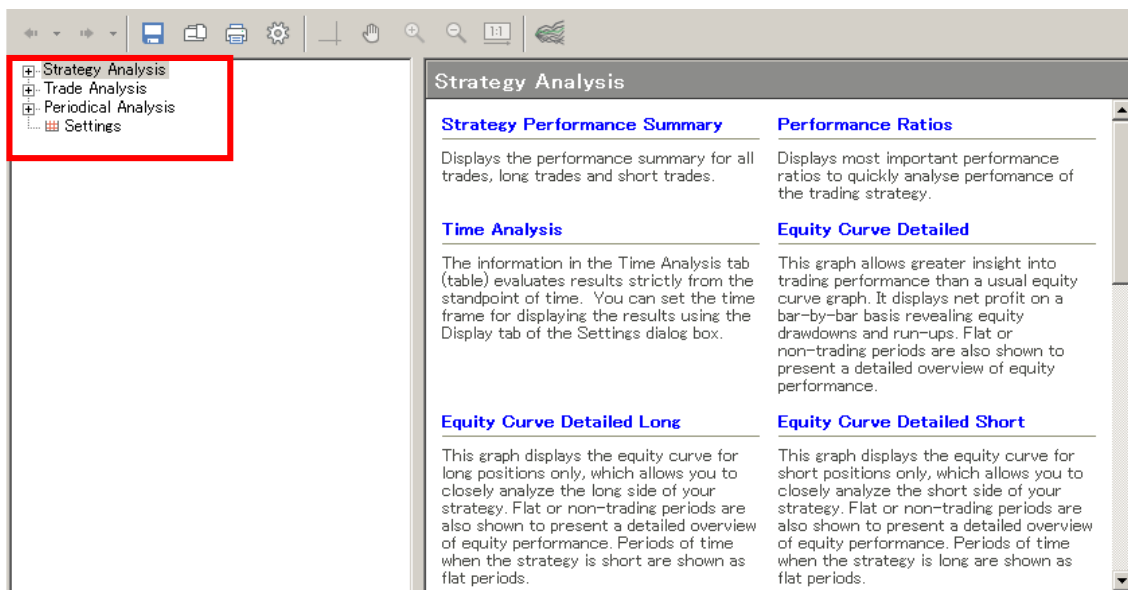


（手順3）Strategy Performance Report が表示されますので、クリックして下さい。▼をクリックする前に、コンピュータの解像度によりすでに表示されていることもあります

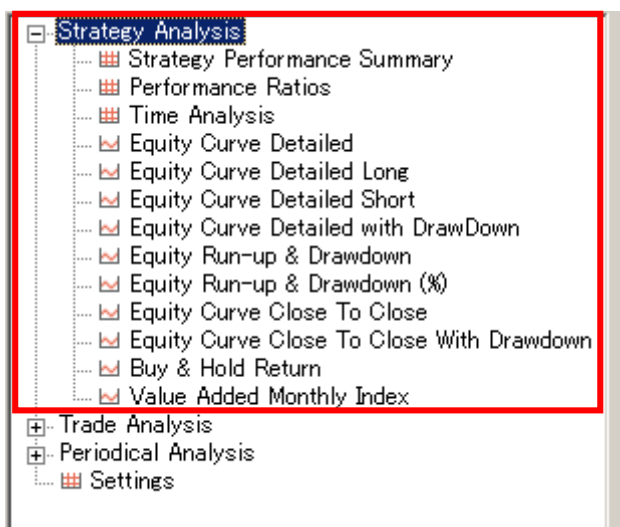


以上で、パフォーマンス・レポートが表示されます。次項以降で、具体的に、レポート内の指標やグラフのご紹介をしていきます。

②表示されたパフォーマンス・レポートは通常の場合、下図のような形式で表示されます。



③左側のカラムの一番上にある「Strategy Analysis」の + をクリックしますと下図のように - になり項目が表示されます。



一番上に表示されている Strategy Performance Summary をクリックして下さい。

Strategy Analysis		Strategy Performance Summary			
	<b>Strategy Performance Summary</b>	(1)	All Trades	Long Trades	Short Trades
	Performance Ratios				
	Time Analysis				
	Equity Curve Detailed				
	Equity Curve Detailed Long	(2)			
	Equity Curve Detailed Short				
	Equity Curve Detailed with DrawDown				
	Equity Run-up & Drawdown				
	Equity Run-up & Drawdown (%)				
	Equity Curve Close To Close				
	Equity Curve Close To Close With Drawdown				
	Buy & Hold Return				
	Value Added Monthly Index				
	Trade Analysis				
	List of Trades				
	Total Trade Analysis				
	Outliers				
	Run-up/Drawdown				
	Trade Series Analysis				
	Trade Series Statistics				
	Total Trades	(3)			
	Winning Trades				
	Losing Trades				
	Drawdown				
	Drawdown P/L	(4)			
	Maximum Adverse Excursion				
	Maximum Adverse Excursion (%)				
	Run-up				
	Run-up P/L				
	Maximum Favorable Excursion				
	Maximum Favorable Excursion (%)				
	Periodical Analysis				
	Settings				
	Net Profit		¥123,700	¥123,700	n/a
	Gross Profit		¥229,400	¥229,400	n/a
	Gross Loss		(¥105,700)	(¥105,700)	n/a
	Adjusted Net Profit		¥67,141	¥67,141	n/a
	Adjusted Gross Profit		¥194,417	¥194,417	n/a
	Adjusted Gross Loss		(¥127,276)	(¥127,276)	n/a
	Select Net Profit		¥79,300	¥79,300	n/a
	Select Gross Profit		¥146,300	¥146,300	n/a
	Select Gross Loss		(¥67,000)	(¥67,000)	n/a
	Account Size Required		¥42,700	¥42,700	n/a
	Return on Account		289.7%	289.7%	n/a
	Return on Initial Capital		123.7%	123.7%	n/a
	Max Strategy Drawdown		(¥54,400)	(¥54,400)	n/a
	Max Strategy Drawdown (%)	(3)	(34.45%)	(34.45%)	n/a
	Max Close To Close Drawdown		(¥42,700)	(¥42,700)	n/a
	Max Close To Close Drawdown (%)		(27.3%)	(27.3%)	n/a
	Return on Max Strategy Drawdown		2.27	2.27	n/a
	Profit Factor	(4)	2.17	2.17	n/a
	Adjusted Profit Factor		1.53	1.53	n/a
	Select Profit Factor		2.18	2.18	n/a
	Max # Contracts Held		1000	1000	0
	Slippage Paid		¥0	¥0	¥0
	Commission Paid		¥0	¥0	n/a
	Open Position P/L		n/a	n/a	n/a
	Annual Rate of Return		137.39%	137.39%	n/a
	Monthly Rate of Return		11.45%	11.45%	n/a
	Buy Hold Return		¥807	¥807	n/a
	Avg Monthly Return		¥12,370		
	Monthly Return StdDev		¥22,426		
	Total # of Trades	(5)	69	69	0
	Percent Profitable		62.32%	62.32%	0%

( ) 内の数字の順にご紹介します。

(1) レポートは全トレード、ロング、ショートに区分され表示されます。

- All Trades : 全検証期間の全てのトレードの成績
- Long Trades : ロング (買い) の成績
- Short Trades : ショート (売り) の成績

※上図の Short Trades の欄が全て n/a となっていますが、n/a とは、not/analysis (検証不可) という意味であり、ショートのトレードが一度もない場合を表しています。

(2) 総損益を表示しています。

- Net Profit : 総損益 (Gross Profit (総収益) - Gross Loss (総損失)) で計算されます。

(3) ドローダウンの数値を表示しています。

- Max Strategy Drawdown : 日中の含み損までを加味した最大ドローダウン (含み損失) を示します。

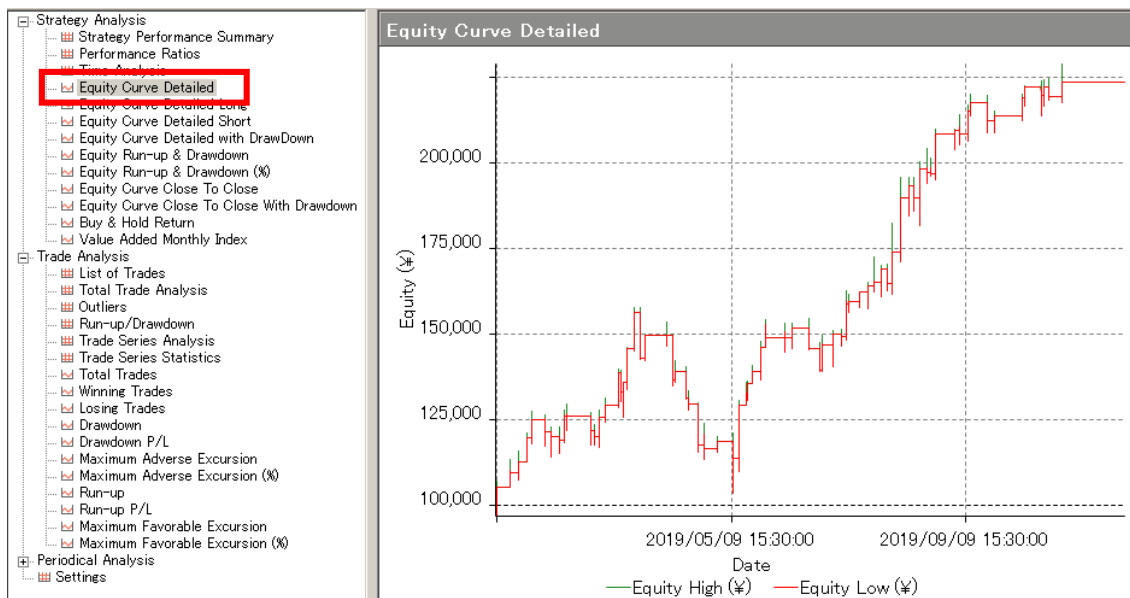
(4) プロフィットファクターを表示しています。

- Profit Factor : (2) の Gross Profit ÷ Gross Loss で計算され、総利益が総損失の何倍になっているかを表す指標です。

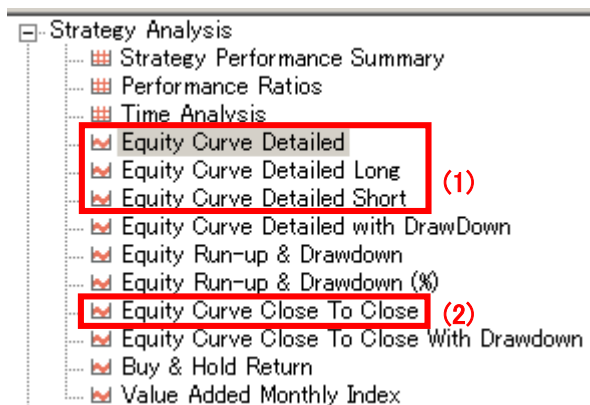
(5) トレード回数と勝率を表示しています。

- Total # of Trades : トレード回数
- Percent Profitable : 勝率 (%)

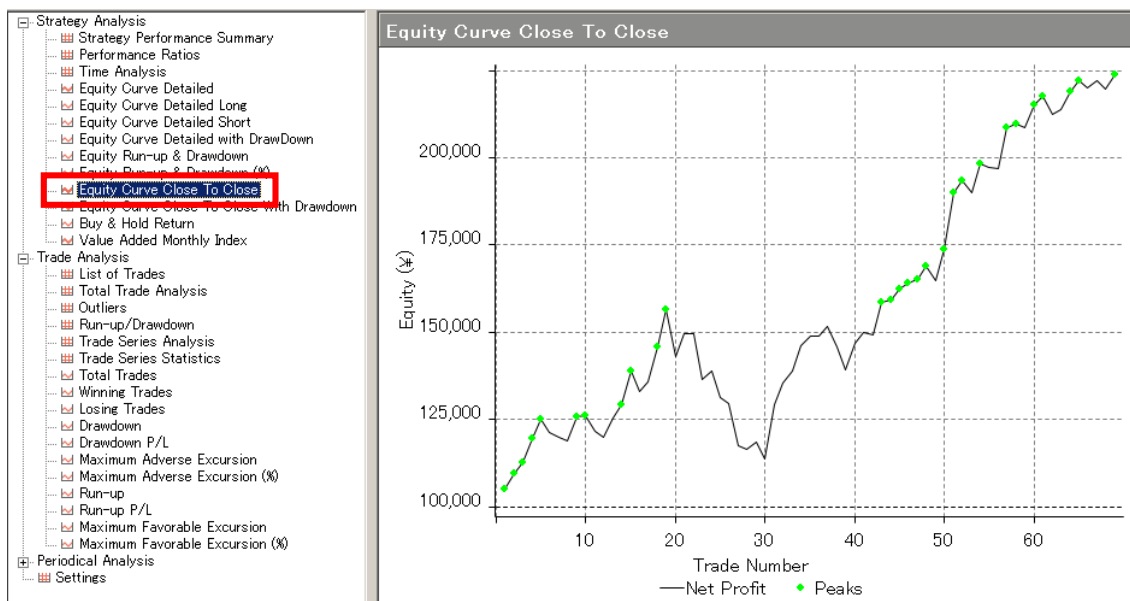
次に、「Equity Curve Detailed」をクリックしてみましょう。



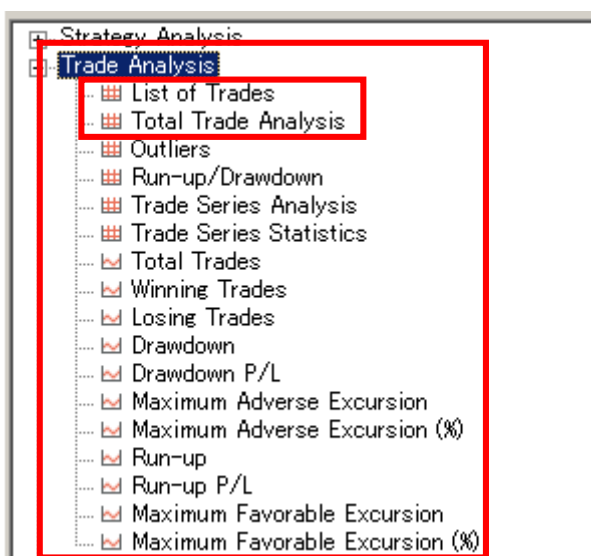
マルチチャートでは、Equity Curve (エクイティ・カーブ：資産曲線と呼んだりします) は、いくつかの表示形式があります。その中から、よく利用するものを下記でご紹介します。



- (1) 縦軸は総損益の推移を表し、横軸は日付を表しています。
- Equity Curve Detailed：ロングとショートの合算の資産曲線
  - Equity Curve Detailed Long：ロングのみの資産曲線
  - Equity Curve Detailed Short：ショートのみの資産曲線
- (2) 縦軸は総損益の推移を表し、横軸はトレードの回数を表します。
- Equity Curve Close To Close：一回毎の損益を回数ごとに累積し、プロットしたもの。



④左側のカラムの二番目にある「Trade Analysis」の + をクリックして下さい。



この中からは、List of Trades、および、Total Trade Analysis 欄をご紹介します。

・ List of Trades : 一回ごとのトレードの詳細を表示しています。

Trade #	Order #	Type	Signal	Date/Time	Price	Contract s	Profit	
							¥	%
1	1	EntryLong	Buy	2019/01/08 9:25:00	108.703	1000	¥5,000	0.05%
	2	ExitLong	Sell	2019/01/08 9:55:00	108.753	1000		

下記でトレード・リストの基本的なご紹介します。

- **Trade #** : 何回目のトレードなのかを表示します。
- **Type** : エントリー (Entry) とエグジット (Exit) に分けて表示されます。
- **Signal** : ストラテジーのシグナル名が表示されます。
- **Date/Time** : エントリー、および、エグジットの日付、時間が表示されます。
- **Price** : エントリーとエグジットの価格が表示されます (あくまでも、チャート上の価格を示し、実際のエントリーとエグジット価格とは、ズレが生じている可能性があります)。
- **Contracts** : エントリー、および、エグジットの枚数が表示されます。
- **Profit** : 各回のトレード損益が表示されます。

次に、Total Trade Analysis を表示してみましょう。

	All Trades	Long Trades	Short Trades
Total # of Trades	69	69	0
Total # of Open Trades	0	0	0
Number Winning Trades	43	43	0
Number Losing Trades	24	24	0
Percent Profitable	62.32%	62.32%	0%
Avg Trade (win loss)	¥1,793	¥1,793	n/a
Average Winning Trade	¥5,335	¥5,335	n/a
Average Losing Trade	(¥4,404)	(¥4,404)	n/a
Ratio Avg Win / Avg Loss	1.21	1.21	n/a
Largest winning Trade	¥16,000	¥16,000	n/a
Largest Losing Trade	(¥13,500)	(¥13,500)	n/a
Avg # Bars in Trades	7	7	n/a
Avg # Bars in Winning Trades	7	7	n/a
Avg # Bars in Losing Trades	7	7	n/a
Avg # Bars Between Trades	7	7	n/a
Avg # Bars Between Winning Trades	1583.9	1583.9	n/a
Avg # Bars Between Losing Trades	2943.4	2943.4	n/a

ここには、最初にご説明した「Strategy Performance Summary」と重なった指標も入っています。

(1) トレード回数と勝率を表示しています。

- **Total # of Trades** : トレード回数
- **Number Winning Trades** : 勝ちトレードの回数
- **Number Losing Trades** : 負けトレードの回数
- **Percent Profitable** : 勝率

(2) 各種の平均損益を表示しています。

• **Ave Trade(win loss)** : 一回当たりの平均損益を表し、最初にご紹介した Strategy Performance Summary 内の Net Profit ÷ Total # of Trades (トレード回数) で計算されます。

• **Average Winning Trade** : 一回当たりの勝ちトレードの平均利益を表し、最初にご紹介した Strategy Performance Summary 内の Gross Profit ÷ Number Winning Trades (勝ちトレード回数) で計算されます。

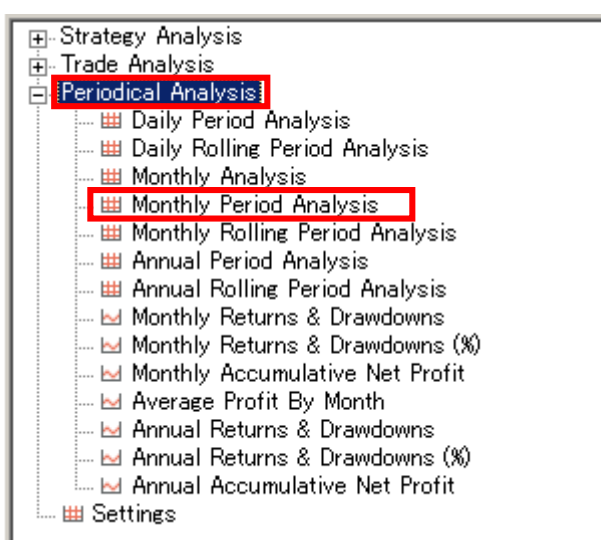
• **Average Losing Trade** : 一回当たりの負けトレードの平均損失を表し、最初にご紹介し

た Strategy Performance Summary 内の Gross Loss ÷ Number Losing Trades (負けトレード回数) で計算されます。

・ Ratio Ave Win / Ave Loss : リスク・リワード・レシオ等、呼び方は様々です。

一回当たりの平均損益率を示し、Average Winning Trade ÷ Average Losing Trade で計算されます。プロフィット・ファクターと似た指標ですが、プロフィット・ファクターが総損益に対して計算されるものであるのに対し、一回当たりの平均損益に対して計算されます。

⑤左側のカラムの三番目にある「Periodical Analysis」の + をクリックして下さい。



「Periodical Analysis」では、日ごと、月ごと、四半期ごとの分析等が行われていますが、この中からは Monthly Period Analysis 欄をご紹介します。

Monthly Period Analysis をクリックしますと、下図が表示されます。

Period	Profit		Gross Profit	Gross Loss	# Trades	% Profitable
	¥	%				
10/2019	¥10,000	4.68%	¥15,000	(¥5,000)	6	66.67%
09/2019	¥5,100	2.44%	¥11,500	(¥6,400)	6	66.67%
08/2019	¥43,700	26.5%	¥48,400	(¥4,700)	8	62.5%
07/2019	¥18,200	12.41%	¥23,200	(¥5,000)	9	77.78%
06/2019	(¥2,100)	(1.41%)	¥10,100	(¥12,200)	5	40%
05/2019	¥32,400	27.84%	¥37,400	(¥5,000)	7	85.71%
04/2019	(¥33,200)	(22.19%)	¥2,500	(¥35,700)	7	14.29%
03/2019	¥29,700	24.77%	¥49,000	(¥19,300)	9	77.78%
02/2019	(¥5,100)	(4.08%)	¥7,300	(¥12,400)	7	28.57%
01/2019	¥25,000	25%	¥25,000	¥0	5	100%

・ Monthly Period Analysis : 各月 (Period) ごとの損益 (Profit、Gross Profit & Loss)、トレード回数 (# Trades)、勝率 (% Profitable) が表示されます。