

【23_215技術系メルマガ】検証の種類

〇〇さん

こんにちは、クロです。

今回、メルマガ読者の方から頂いた質問にお答えしようと思います。

～～以下、質問内容～～

クロさんは過去検証をされてますでしょうか？

勝っているトレーダーはみなフォレックステスターで過去検証してるように思います！クロさんも再現性、優位性を持つためにされてますでしょうか？
よろしくお願いします。

～～

僕の発信を日頃見ている皆さんのなかには『検証』といっても目的に応じて色々なやり方があるという話をしたのを覚えてくれている人もいます。

そこで、今日はザックリとトレードスタイル(型)を作り、それを安定運用させるために段階を踏んだ『目的別の検証』を順番に紹介したいと思います。

まず、検証と言えば過去チャートの検証だったり、フォレックステスターなどのシミュレーターを利用したものをイメージする人が多いと思います。

これは、どちらが優れているか？という議論は意味がなく、どちらも異なる目的を果たすために段階を踏んで行くと良いというのが、僕の考えです。

では、その段階を踏まえた検証の種類について説明します。

(1)トレードの型作り(言語化)のための『過去検証』

まず、多くの人が最初に取り組むものであり、検証と言えばこれをイメージするのではないのでしょうか。

これは、すでに出来上がっているチャートから「値が伸びやすい条件」をテクニカル軸で規格化し（僕の場合は、3波理論や、MAの収縮⇒発散など）そのパターンの出現頻度を確認するもの。

この時点で、決めた条件に合うパターンが少なすぎたりする場合は、ルールを細かく変えたりしながら検証を行います。

ただ、既に完成されて右側の値動きが見えているチャートなので、実際そのルール通りに運用した場合の勝率などは正確に測れません。

（2）実際のルールがワークするかを確認するための『シミュレーション』

これが、FT5などのシミュレーションソフトを使用した、『トレードの練習』のような段階です。

この段階では、（1）の検証で言語化したルールを実際に通貨ペア・期間を決めてトレードし期間中のトレード頻度・勝率・利回りを確認します。

これが思うような結果にならない場合には、（1）に戻ってルールを再構築して、改めてテストを行います。

この時のパフォーマンスの目安ですが、基本的に月利回り+5～10%が出せるかで見るように勧めています。

（3）実際のブローカーでトレードしてみる『フォワードテスト』

さて、いよいよ実戦に近づいてきました。

（2）のテストで、自分のトレードルールの勝率・利回りの見込みもこの時点で分かっているはずなので、デモトレードや少額リアル口座で実運用を行ってみます。

これでシミュレーションと同じようなパフォーマンスが出れば、おめでとうございます。

あなたのルール（型）が一つ完成です。あとはそのルールに忠実に運用をしていきましょう。

この1～3の段階を踏むのが、型を作る一連の検証の流れです。

目的によって、用いるツールや意識するポイントが変わってきますが、どの段階でも共通して大事なことは

気付いた事や自分のやったことを『ノートに記録する』ということです。

その場で気付いたことが新たな検証のテーマになる場合もあるし、調子が崩れた時の修正の手がかりになる事も多いです。

面倒がらずに、自分の行動履歴を残す意識でやってみてください。