

MT4 BackTest Tool 利用説明書

MT4 BackTest Tool
 ファイル(F) 設定(O)

EA一覧

- ☐ _MACDvsSignal.ex4
- ☐ 0 - Close Cross Kijun Sen.ex4
- ☐ 0 - Close Cross MA.ex4
- ☐ a_informer.ex4
- ☐ auto_m5.ex4
- ☐ Catcher Profit 1.0.ex4
- ☐ CCICOMA.ex4
- ☐ CHO.ex4
- ☐ D_ArtificialIntelligence.ex4
- ☐ D_auto_m5.ex4
- ☐ D_PriceAction.ex4
- ☐ D_VR---Overturn.ex4
- ☐ EA_Doten.ex4
- ☐ EA_Gods Gift EA.ex4
- ☐ EA_HMS_ADXm_NZDCHF.ex4
- ☐ EA_HMS_ADXm_SGDJPY.ex4
- ☐ EA_HMS_BolingerBand.ex4
- ☐ EA_HMS_HLBreakOut_NZDUSD.ex4
- ☐ EA_HMS_MACD_EURUSD.ex4
- ☐ EA_HMS_MACD_USDCHF.ex4
- ☐ EA_HMS_Repeat.ex4
- ☐ EA_HMS_Repeat2.ex4
- ☐ EA_HMS_RMS.ex4
- ☐ EA_HMS_SAR.ex4
- ☐ EA_HMS_Sniper_AUDCAD.ex4
- ☐ EA_MACD_REPEAT.ex4
- ☐ Elliott_Trader_Modify3_V1.ex4
- ☐ liquidex_V1.ex4

通貨ペア

通貨名	Sp
<input checked="" type="checkbox"/> USDJPY	21
<input type="checkbox"/> EURJPY	22
<input type="checkbox"/> EURUSD	20

時間

☐ M1 ☒ M5 ☐ M15 ☒ M30 ☒ H1 ☐ H4

☐ Daily

モデル

☒ EveryTick ☐ ControlPoint ☐ OpenOnly

* - - - -

☒ 期間1

開始日 2013年 1月 1日

終了日 2014年 1月 1日

☒ 最適化 ☒ 最適化繰り返し

テスト完了時: 何もしない

終了 実行

繰り返し

☒ 最適化 対象期間 期間3

繰越条件 (AND条件)

1 >= 2 > 3 >

4 > 5 > 6 >

ソート順 1 降順 2 降順 3 降順

繰越対象行数 10

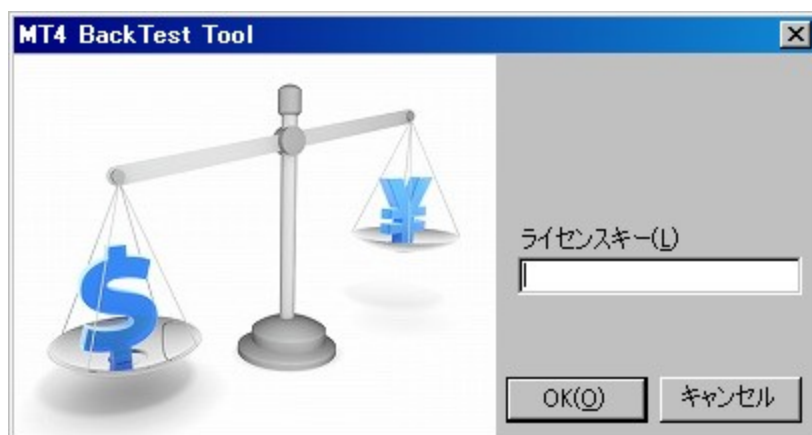
条件消去 全行削除 一行削除 挿入 追加

期間	最適化	繰越条件	ソート順	行数
期間1	X	総取引回数>=30 and プロフィットファクター>=1	損益 降順	10
期間2	O	取引回数>=25 and PF>1.2	損益 降順	10
期間3	O			10

機能

- 複数のEA、通貨ペア、時間足、期間を選択して、その全ての組み合わせでのバックテストを一括で行うことができます。
- 一つのEA、通貨ペア、時間足、期間で最適化バックテストを行った結果に対して、条件を満たした結果のパラメータのみを抽出して、別のパラメータの最適化バックテストを続けて実行できます。
- 一つのEA、通貨ペア、時間足の組み合わせに対して、複数の期間でのバックテストを一括で実行できます。

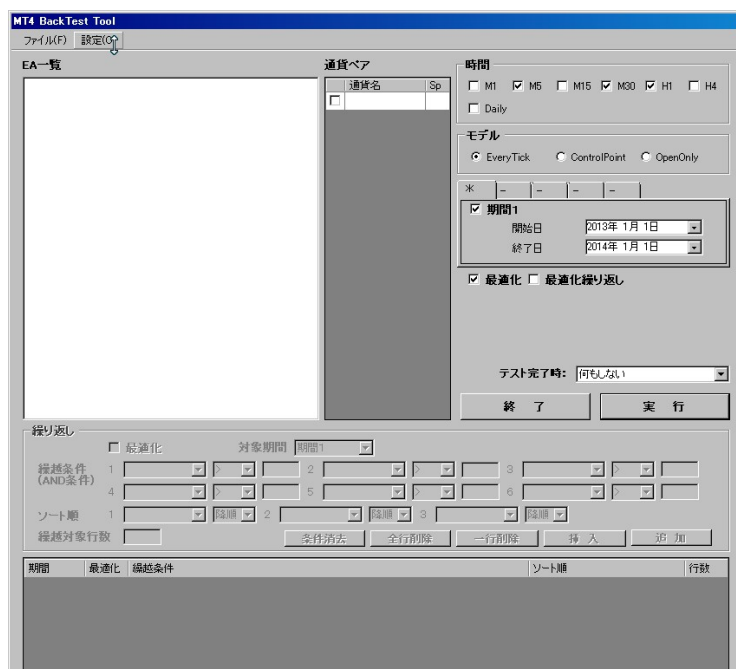
1. 起動・環境設定



初めて起動すると、最初にライセンス登録画面が表示されます。配布されたライセンスキーを入力してください。



上記の画面が表示されますので、環境設定を行います。



ツールバーの設定メニューを開きます。

環境設定

MT4System C:\MetaTrader 4 - Alpari Japan 設定

MT4Data C:\Users\画像動画\AppData\Roamir 設定

MT4Tester C:\Users\画像動画\AppData\Roamir 設定

結果保存先 D:\MT4 Backtest Tool 設定

☒ 日付時間フォルダを作る

MT4実行時オプション

OK キャンセル

MT4System : テストで使用するMT4がインストールされているメインのフォルダです。

MT4Data : MT4のデータフォルダです。MT4のツールバーメニューの「データフォルダを開く」を実行したときに表示されるフォルダです。

MT4Testet : MT4Dataの中にある[tester]フォルダです。

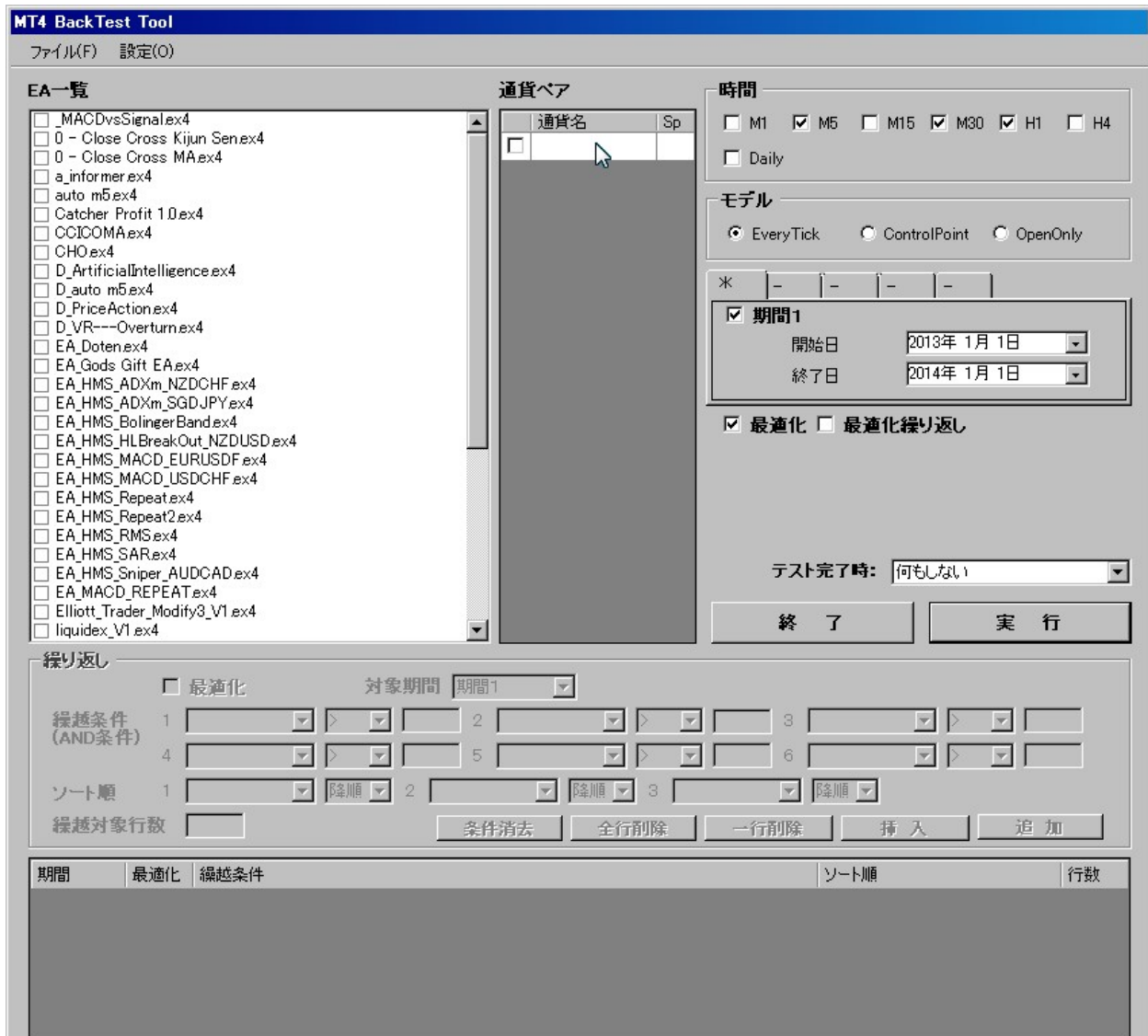
結果保存先 : MT4が作成したバックテストレポートファイルを任意の場所に移動させるための設定です。

日付時間フォルダを作る : 結果保存先フォルダにレポートファイルを移動する際に、テストを行った時間のフォルダを作成して、そこに保存します。

MT4実行時オプション : MT4起動時の追加オプションです。ポータブルモードでテストを行う場合は、[/portable]と入力します。

設定を変更した場合は、MT4 BackTest Toolを再起動してください。

2. メイン画面



EA一覧：MT4に登録されているEAの一覧が表示されます。

通貨ペア：[通貨ペアファイル]に登録されている通貨ペアの一覧が表示されます。

期間：期間 1～期間 5 まで設定、選択できます。選択中の期間はタブに「*」が表示されます。

最適化：通常の最適化バックテストを行います。

最適化繰り返し：画面下部で設定した条件でバックテストを繰り返して行います。

テスト完了時：以下が選択できます。

何もしない：何もしません

シャットダウン：Windowsをシャットダウンします

サスペンド：Windowsをサスペンド状態にします

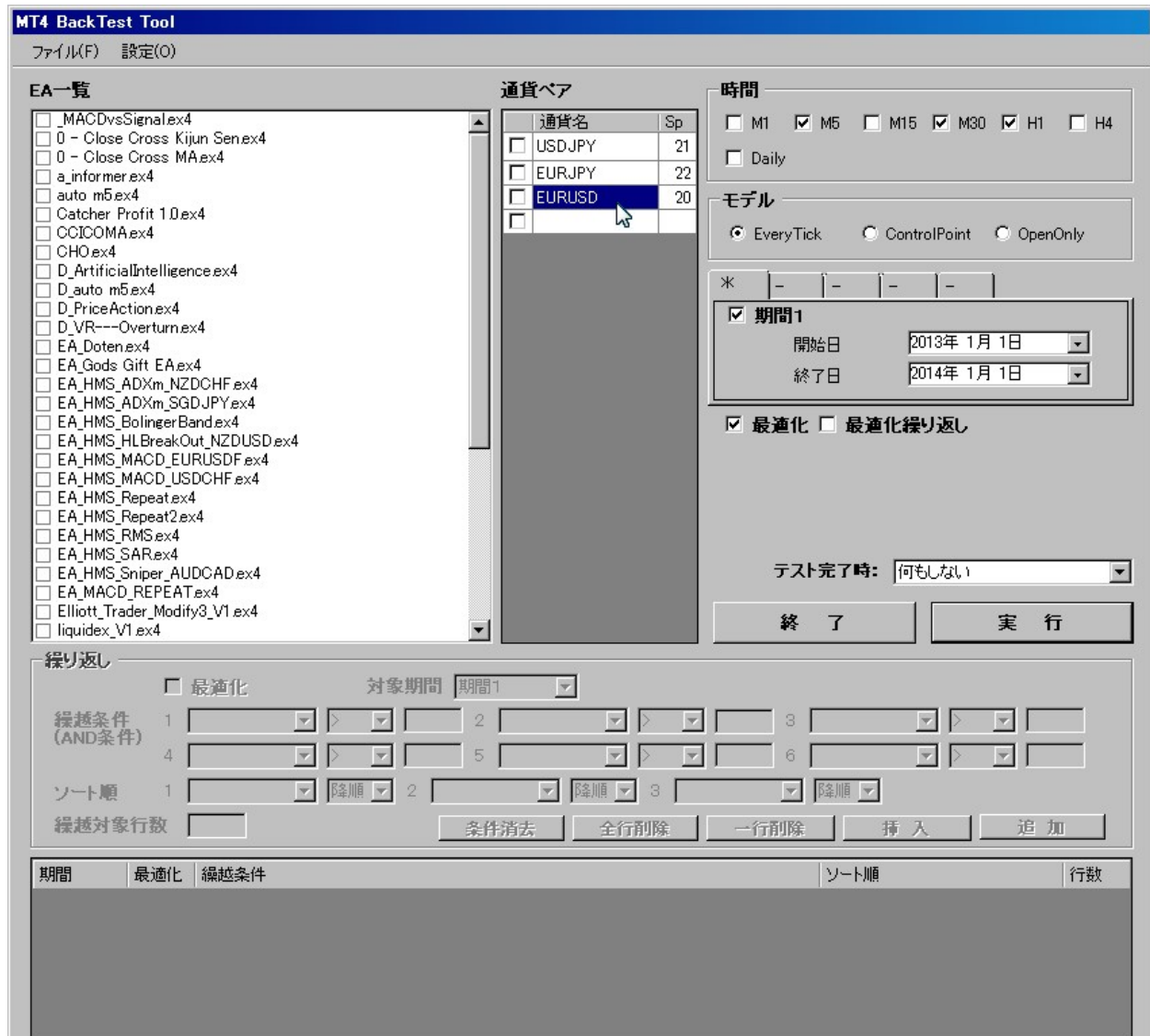
休止：Windowsを休止状態にします

MT4 BackTest Toolを終了：MT4 BackTest Toolを終了します

終了：MT4 BackTest Toolを終了します。

実行：設定した条件でバックテストを開始します。

3. 通貨ペアの編集



バックテストで使用する通貨ペアの追加削除を行います。

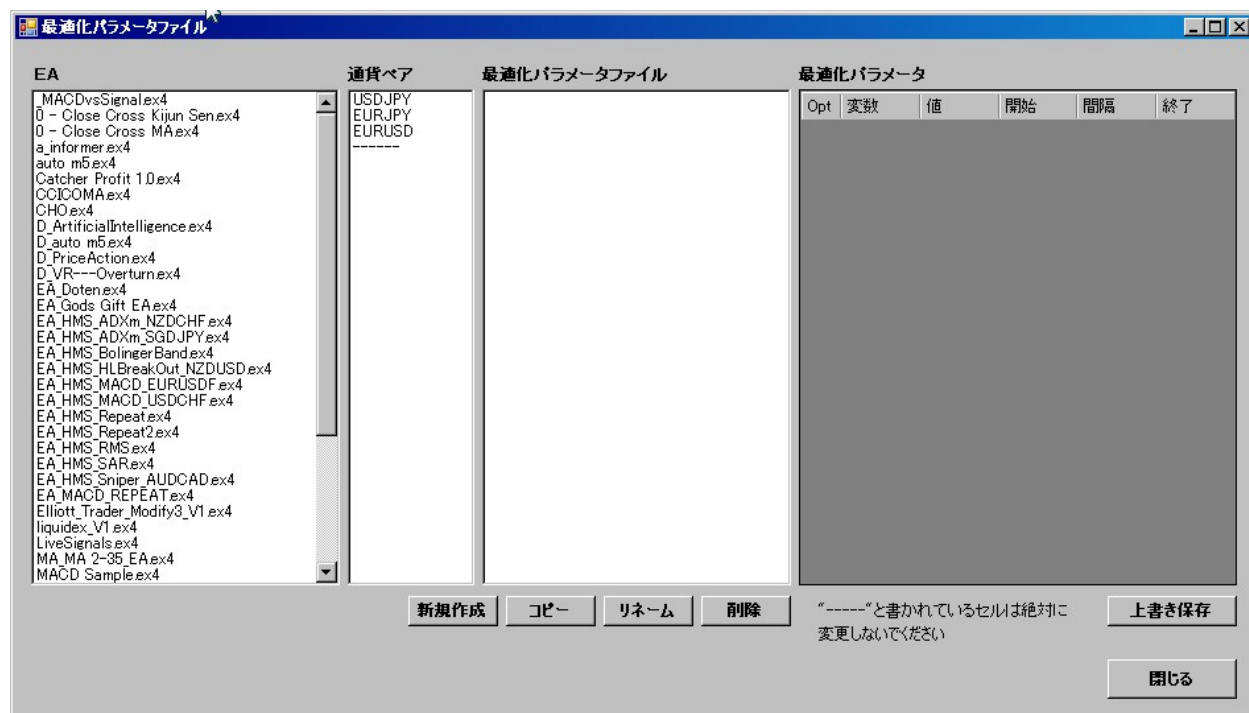
画面の「通貨ペア」の表に直接「通貨ペア名」「スプレッド」を入力、変更します。スプレッドはpipsではなく、MT4の「通貨ペアのプロパティ」ボタンを押したときに表示されるスプレッドになります。

追加したい場合は、一番下の空行に入力します。

また、MT4 BackTest Toolをインストールしたフォルダにある[Symbol.ini]ファイルを、メモ帳等のテキストエディタで編集することもできます。

[Symbol.ini]ファイルを編集した場合は、MT4 BackTest Toolを起動し直してください。

4. パラメータファイル編集画面



メイン画面のツールバーメニュー-[パラメータファイル]から開きます。

MT4で外部から起動してバックテストを行う場合、各EA用のバックテストパラメータ設定ファイル[* .set]が必要になります。

通常、MT4の「エキスパート設定」で保存できます。(下記の保存ボタン)



新規作成：選択されているEA、通貨ペアに対するパラメータファイルを作成します。

EAのみが選択されている場合は[EA名.set]ファイルが作成されます。

EA&通貨ペアが選択されている場合は[EA名_通貨ペア名.set]ファイルが作成されます。

通貨ペアごとにパラメータを変更したい場合は、通貨ペア名を含めたパラメータファイルを作成してください。

コピー：選択されているパラメータファイルを複写して新しいパラメータファイルを作成します。

リネーム：選択されているパラメータファイルのファイル名を変更します。

パラメータファイルは必ず[EA名]または[EA名_通貨ペア名]で始まる必要があります。

この部分を変更した場合は、バックテスト時に読み込まれません。

削除：選択されているパラメータファイルを削除します。

上書き保存：各パラメータの値、最適化対象有無（チェックボックス）、開始値、間隔値、終了値を入力された値で更新します。

注意 1) 各パラメータの変数名はEAで使用されるPG用の名称が表示されます。表示される項目、順番はMT4で表示さ

れているものと同じです。

注意 2) コメント部についてはMT4での表記そのままに表示されない場合があります。バックテスト時には問題ありません。

注意 3) パラメータファイルを本画面で読み込んだ場合、変数の型（数値型、文字型、Bool型等）の判別ができません。そのため数値の欄に文字、あるいはその逆を入力した場合、チェックは行いません。

違う型の値が入力された場合、バックテスト結果は取引 0 のレポートが作成されます。

注意 4) bool型の項目（True/False）については、MT4のエキスパート設定画面及び本設定画面で開始値/終了値を設定した場合、バックテストが正常に行われない場合があります。設定しないようにお願いします。

バックテスト時に使用されるファイル順)

繰り返し機能を利用しない場合、本画面の「最適化パラメータリスト」一覧で最上位に表示されるパラメータ設定ファイルが使用されます。

具体例でいうと[MACD Sample.ex4]をUSDJPYでテストする場合、まず[MACD Sample_USDJPY]で始まるファイルのうち、画面で最上位に表示されるパラメータファイルが存在すれば、それを使用します。

ない場合は[MACD Sample]で始まるパラメータファイルのうち、画面に最上位に表示されるパラメータファイルを使用します。どちらもない場合はテスト実行ボタンを押したときにエラーを表示します。

繰り返し機能を利用する場合、繰り返し条件行と同じ個数のパラメータファイルが一覧の上から順に使用されます。繰り返し 1 回目は「最適化パラメータリスト」一覧の 1 行目のパラメータファイル、繰り返し 2 回目は「最適化パラメータリスト」一覧の 2 行目のパラメータファイルが使用されます。

最適化パラメータファイル

EA	通貨ペア	最適化パラメータファイル	最適化パラメータ																																										
#Market#curious-chameleon-ea.ex4 #Market#di-ma-strategy.ex4 #Market#doublecontrol.ex4 #Market#rush-free.ex4 #MYEA#New Frontier#EA_ORG_MA Smoothed2.ex4 EA_ORG_MA Smoothed.ex4 MACD Sample.ex4 Moving Average.ex4	EURUSD EURJPY USDJPY AUDJPY EURAUD	macd sample_1.set macd sample_2.set macd sample_3.set MACD Sample_EURUSD.set MACD Sample_GBPUSD_1.set macd sample_org.set	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Opt</th> <th>変数</th> <th>値</th> <th>開始</th> <th>間隔</th> <th>終了</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td><input checked="" type="checkbox"/></td> <td>TakeProfit</td> <td>50</td> <td>50</td> <td>0</td> <td>0</td> </tr> <tr> <td><input type="checkbox"/></td> <td>Lots</td> <td>0.1</td> <td>0.1</td> <td>0</td> <td>0</td> </tr> <tr> <td><input type="checkbox"/></td> <td>TrailingS...</td> <td>30</td> <td>30</td> <td>0</td> <td>0</td> </tr> <tr> <td><input type="checkbox"/></td> <td>MACDOp...</td> <td>3</td> <td>3</td> <td>0</td> <td>0</td> </tr> <tr> <td><input type="checkbox"/></td> <td>MACDCL...</td> <td>2</td> <td>2</td> <td>0</td> <td>0</td> </tr> <tr> <td><input checked="" type="checkbox"/></td> <td>MATrend...</td> <td>26</td> <td>20</td> <td>10</td> <td>70</td> </tr> </tbody> </table>	Opt	変数	値	開始	間隔	終了	<input checked="" type="checkbox"/>	TakeProfit	50	50	0	0	<input type="checkbox"/>	Lots	0.1	0.1	0	0	<input type="checkbox"/>	TrailingS...	30	30	0	0	<input type="checkbox"/>	MACDOp...	3	3	0	0	<input type="checkbox"/>	MACDCL...	2	2	0	0	<input checked="" type="checkbox"/>	MATrend...	26	20	10	70
Opt	変数	値	開始	間隔	終了																																								
<input checked="" type="checkbox"/>	TakeProfit	50	50	0	0																																								
<input type="checkbox"/>	Lots	0.1	0.1	0	0																																								
<input type="checkbox"/>	TrailingS...	30	30	0	0																																								
<input type="checkbox"/>	MACDOp...	3	3	0	0																																								
<input type="checkbox"/>	MACDCL...	2	2	0	0																																								
<input checked="" type="checkbox"/>	MATrend...	26	20	10	70																																								

新規作成 コピー リネーム 削除

“-----”と書かれているセルは絶対に
変更しないでください

上書き保存 閉じる

MT4 BackTest Tool

ファイル(F) 設定(O)

EA一覧

- ☐ #Market#curious-chameleon-ea.ex4
- ☐ #Market#di-ma-strategy.ex4
- ☐ #Market#doublecontrol.ex4
- ☐ #Market#rush-free.ex4
- ☐ #MYEA#New Frontier#EA_ORG_MA Smoothed2.ex4
- ☐ EA_ORG_MA Smoothed.ex4
- ☐ MACD Sample.ex4
- ☐ Moving Average.ex4

通貨ペア

通貨名	Sp
<input checked="" type="checkbox"/> EURUSD	20
<input type="checkbox"/> EURJPY	
<input type="checkbox"/> USDJPY	
<input type="checkbox"/> AUDJPY	
<input type="checkbox"/> EURAUD	

時間

☐ M1 ☐ M5 ☐ M15 ☐ M30 ☐ H1 ☐ H4

☐ Daily

モデル

☒ EveryTick ☐ ControlPoint ☐ OpenOnly

* | - | - | - | - |

☒ 期間1

開始日 2013年 1月 1日

終了日 2014年 1月 1日

☐ 最適化 ☒ 最適化繰り返し

テスト完了時: 何もしない

終了 実行

繰り返し

☐ 最適化 対象期間 期間3

繰越条件 (AND条件)

1		>		2		>		3		>	
4		>		5		>		6		>	

ソート順

1		降順	2		降順	3		降順
---	--	----	---	--	----	---	--	----

繰越対象行数

条件消去 全行削除 一行削除 挿入 追

期間	最適化	繰越条件	ソート順	行数
期間1	O	損益>0		1
期間2	O	損益>0		1
期間3	X			1

5. 繰り返し条件設定

MT4 BackTest Tool

ファイル(F)

設定(O)

EA一覧

☐ _MACDvsSignalex4
☐ 0 - Close Cross Kijun Sen.ex4
☐ 0 - Close Cross MA.ex4
☐ a_informer.ex4
☐ auto m5.ex4
☐ Catcher Profit 1.0.ex4
☐ CCICOMMA.ex4
☐ CHO.ex4
☐ D_ArtificialIntelligence.ex4
☐ D_auto m5.ex4
☐ D_PriceAction.ex4
☐ D_VR---Overturn.ex4
☐ EA_Doten.ex4
☐ EA_Gods Gift EA.ex4
☐ EA_HMS_ADXm_NZDCHF.ex4
☐ EA_HMS_ADXm_SGDJPY.ex4
☐ EA_HMS_BolingerBand.ex4
☐ EA_HMS_HLBreakOut_NZDUSD.ex4
☐ EA_HMS_MACD_EURUSDF.ex4
☐ EA_HMS_MACD_USDCHF.ex4
☐ EA_HMS_Repeat.ex4
☐ EA_HMS_Repeat2.ex4
☐ EA_HMS_RMS.ex4
☐ EA_HMS_SAR.ex4
☐ EA_HMS_Sniper_AUDCAD.ex4
☐ EA_MACD_REPEAT.ex4
☐ Elliott_Trader_Modify3_V1.ex4
☐ liquidex_V1.ex4

通貨ペア

通貨名	Sp
<input checked="" type="checkbox"/> USDJPY	21
<input type="checkbox"/> EURJPY	22
<input type="checkbox"/> EURUSD	20

時間

☐ M1 ☒ M5 ☐ M15 ☒ M30 ☒ H1 ☐ H4
☐ Daily

モデル

☒ EveryTick ☐ ControlPoint ☐ OpenOnly

＊

-

-

-

-

☒ 期間1

開始日

2013年 1月 1日

終了日

2014年 1月 1日

☒ 最適化 ☒ 最適化繰り返し

テスト完了時:

何もしない

終了

実行

繰り返し

☒ 最適化

対象期間

期間3

繰越条件 (AND条件)

1

>=

2

>

3

>

4

>

5

>

6

>

ソート順

1

降順

2

降順

3

降順

繰越対象行数

10

条件消去

全行削除

一行削除

挿入

追加

期間	最適化	繰越条件	ソート順	行数
期間1	X	総取引回数>=30 and プロフィットファクター>=1	損益 降順	10
期間2	O	取引回数>=25 and PF>1.2	損益 降順	10
期間3	O			10

最適化：最適化バックテストの実行有無を設定します。

対象期間：期間 1 ～ 期間 5 を選択します。

繰越条件 1 ～ 6：選択された期間を対象に行ったバックテスト結果から、次のバックテストに繰り越すパラメータの組み合わせを抽出する条件を設定します。条件は全てAND（かつ）で結合されます。

ソート条件 1 ～ 3：繰越条件に適合した結果を設定した条件でソートします。設定しない場合は、MT4が返した順番になります。

繰越対象行数：繰越を行う最大件数を設定します。ソートした結果の最上位から設定した行数までが次のバックテスト対象になります。

条件消去：選択中の条件を初期化します。

全行削除：繰越条件一覧を全行削除します。

一行削除：繰越条件一覧で選択されている行を削除します。

挿入：繰越条件一覧で選択されている行の上に新規条件行を挿入します。

追加：繰越条件一覧の最終行に新規条件行を追加します。

繰越設定例 1)

ある期間を対象に最適化を行って、成績の良いパラメータの組み合わせのみ直近の期間でテストを行う。
その結果、成績の良かったパラメータの組み合わせを使って長期データでのテストレポートを出力させたい。

- (1) 2014/01/01 ~ 03/31の期間を対象に最適化を行い、その結果のうち取引回数が25回以上かつPFが1.0以上のものから、損益の良い順にパラメータ組み合わせ最大10件を抽出する。
- (2) 上記結果を対象として、2014/04/01 ~ 06/16の期間を最適化なしでバックテストし、その結果のうち取引回数が25回以上かつPFが1.0のものから、上記同様に損益順上位10件を抽出する。
- (3) 上記結果を対象に2013/01/01 ~ 2013/12/31の期間を最適化なしでバックテストを行う。

1) 最適化パラメータファイルを 3 つ作成しておく。

1 つ目のパラメータファイルには最適化対象変数が設定されたもの、2 つ目、3 つ目は 1 つ目をそのままコピーしたファイルでかまわない。

2) [期間 1]、[最適化有]、繰越条件[取引回数>=30][PF>=1]、ソート条件[損益降順]、繰越対象行[10]を選択・入力して「追加」を実行する。

3) [期間 2]、[最適化無]、繰越条件[取引回数>=25][PF>=1]、ソート条件[損益降順]、繰越対象行[10]を選択・入力して「追加」を実行する。

4) 「条件消去」で条件を初期化、[期間 3] を選択して「追加」を実行する。

5) 「実行」でバックテストを開始する。

期間 1 ~ 期間 3 にはあらかじめ

[2014/01/01-2014/03/31][2014/04/01-2014/06/16][2013/01/01-2013/12/31]を設定しておく。選択チェックはチェックしてもしなくてもよい。

MT4 BackTest Tool

ファイル(F) 設定(O)

EA一覧

- ☐ %Market%curious-chameleon-ea.ex4
- ☐ %Market%di-ma-strategy.ex4
- ☐ %Market%doublecontrol.ex4
- ☐ %Market%rush-free.ex4
- ☐ %MYEA%New Frontier%EA_ORG_MA Smoothed2.ex4
- ☐ CHECK_MA.ex4
- ☐ EA_ORG_MA Smoothed.ex4
- ☒ EA_Perfect_Gambling_System.ex4
- ☐ MACD Sample.ex4
- ☐ Moving Average.ex4

通貨ペア

通貨名	Sp
<input checked="" type="checkbox"/> EURUSD	18
<input checked="" type="checkbox"/> GBPUSD	21
<input checked="" type="checkbox"/> USDJPY	22
<input checked="" type="checkbox"/> AUDCAD	41
<input checked="" type="checkbox"/> AUDJPY	40
<input checked="" type="checkbox"/> EURAUD	57
<input checked="" type="checkbox"/> EURCHF	28
<input type="checkbox"/> EURGBP	22
<input type="checkbox"/> EURJPY	28
<input type="checkbox"/> GBPCAD	46
<input type="checkbox"/> NZDCAD	65
<input type="checkbox"/> NZDJPY	47
<input type="checkbox"/> NZDUSD	20
<input type="checkbox"/> SGDJPY	50
<input type="checkbox"/> USDCAD	23

時間

☐ M1 ☒ M5 ☐ M15 ☐ M30 ☒ H1 ☐ H4

☐ Daily

モデル

☒ EveryTick ☐ ControlPoint ☐ OpenOnly

* ☐ 期間1 開始日: 2014年 1月 1日 終了日: 2014年 3月31日

☐ 最適化 ☒ 最適化繰り返し

テスト完了時: [何もしない]

繰り返し

☐ 最適化 対象期間: 期間3

繰越条件 (AND条件)

1 >= 2 >= 3 >

4 > 5 > 6 >

ソート順 1 降順 2 降順 3 降順

繰越対象行数: 10

条件消去 全行削除 一行削除 挿入 追加

期間	最適化	繰越条件	ソート順	行数
期間1	O	取引回数>=25 and PF>=1	損益 降順	10
期間2	X	取引回数>=25 and PF>=1	損益 降順	10
期間3	X			10

A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	
パス	損益	総取引数	プロフィットファクター	期待利得	トローダウン	トローダウン%				
9	251.36	46	1.26	5.46	231.22	0.02%	0	TSL=50	MAPeriod=12	MagicNo=
15	242.6	44	1.25	5.51	246.19	0.02%	0	TSL=50	MAPeriod=17	MagicNo=
8	124.19	63	1.11	1.97	193.19	0.02%	0	TSL=40	MAPeriod=12	MagicNo=
16	112.84	31	1.13	3.64	250.53	0.03%	0	TSL=60	MAPeriod=17	MagicNo=
17	51.07	28	1.06	1.82	276.01	0.03%	0	TSL=70	MAPeriod=17	MagicNo=
14	49.1	61	1.04	0.8	296.58	0.03%	0	TSL=40	MAPeriod=17	MagicNo=
3	19.49	50	1.02	0.39	301.66	0.03%	0	TSL=50	MAPeriod=7	MagicNo=
11	-9.26	29	0.99	-0.32	300.86	0.03%	0	TSL=70	MAPeriod=12	MagicNo=
18	-10.79	21	0.99	-0.51	323.59	0.03%	0	TSL=80	MAPeriod=17	MagicNo=
28	-10.95	29	0.99	-0.38	289.47	0.03%	0	TSL=60	MAPeriod=27	MagicNo=

最適化 1 回目の結果のうち合格した 7 件を次のテスト実行

パラメーター		MagicNo=30000001; ManyDigits=true; MoneyManagement=0; Indicator=0; TSL=50; Scale=1; Lots=0.01; InitialBalance=100000; Riset=10; BS=0; Doten=false; NRiset=false; MAPeriod=12; FPeriod=12; SPeriod=26; SgPeriod=9; RSIPeriod=14; WeeklyFilter=""; TimeFilter1=0; TimeFilter2=0; reLot=0;							
テストバー 数	18821	モデルテック数		36636	モデリング品質				n/a
不整合 チャートエ ラー	0								
初期証拠金	1000000.00				スプレッド				現在の (8)
総損益	251.36	総利益		1228.83	総損失				-977.46
プロフィット ファクター	1.26	期待利得		5.46					
絶対ドロー ダウン	118.71	最大ドローダウン		231.22 (0.02%)	相対ドローダウン				0.02% (231.22)
総取引数	46	ショートポジション(勝率%)		2 (100.00%)	ロングポジション(勝率%)				44 (54.55%)
		勝率(%)		26 (56.52%)	負率 (%)				20 (43.48%)
		最大 勝トレード		50.00	負トレード				-50.28
		平均 勝トレード		47.26	負トレード				-48.87
		最大 連勝(金額)		4 (199.16)	連敗(金額)				4 (-190.48)
		最大化 連勝(トレード数)		199.16 (4)	連敗(トレード数)				-190.48 (4)
		平均 連勝		2	連敗				2

最適化なしでテストを行った7件のうち合格したものを次の期間 3 で最終レポート作成

繰越設定例 2)

最適化を行いたいパラメータが複数ある場合、全てを選択して一括で最適化を実行しようとする非常に時間がかかることがある。このとき、まずAというパラメータのセットで最適化を行い、その結果良かったものに対して今度はBのパラメータセットでの最適化を行いたい。その結果良かったパラメータの組み合わせで最適化なしのテストレポートを出力したい。

- (1) 2014/01/01～2014/03/31の期間を対象にストップ/リミット幅の最適化を行い、その結果のうち損益が10000以上かつドロダウが10000以下のものからドロダウ%順に最大10件を抽出する。
- (2) 上記結果を対象に2014/01/01～2014/03/31の期間を対象にインジケータの変数Aと変数Bの最適化を行い、その結果のうちPFが1.5以上のものを損益順上位5件を抽出する。
- (3) 上記結果を対象に2013/01/01～2014/06/16の期間を最適化なしでバックテストを行う。

1) 最適化パラメータファイルを 3 つ作成しておく。

1 つ目のパラメータファイルはストップ幅、リミット幅を最適化対象にしたもの、2 つ目のパラメータファイルは変数A、変数Bを最適化対象にしたもの、3 つ目は 1 つ目または 2 つ目をそのままコピーしたファイルでかまわない。

2) [期間 1]、[最適化有]、繰越条件[損益>=10000][DD<=10000]、ソート条件[DD%昇順]、繰越対象行 [10] を選択・入力して「追加」を実行する。

3) [期間 1]、[最適化有]、繰越条件[PF>=1.5]、ソート条件[損益降順]、繰越対象行[5]を選択・入力して「追加」を実行する。

4) 「条件消去」で条件を初期化、[期間 2] を選択して「追加」を実行する。

5) 「実行」でバックテストを開始する。

期間 1 ～ 期間 2 にはあらかじめ

[2014/01/01-2014/03/31][2013/01/01-2014/06/16]を設定しておく。選択チェックはチェックしても しなくてもよい。

The screenshot shows the MT4 BackTest Tool interface. The 'EA一覧' (EA List) on the left includes various EA files like 'chameleon-ee4', 'ma-strategy4', 'doublecontrol4', 'rush-free4', 'New Frontier#EA_ORG_MA Smoothed2x4', 'EA_ORG_MA Smoothed4', 'MAOD Sample4', and 'Moving Average4'. The '通貨ペア' (Currency Pairs) list on the right shows pairs like EURUSD, GBPUSD, USDJPY, AUDCAD, AUDJPY, EURAUD, EURCHF, EURGBP, EURJPY, GBPCAD, NZDCAD, NZDJPY, NZDUSD, SGDJPY, USDCAD, and USDJPYmicro. The '時間' (Time) section shows 'M1', 'M5', 'M15', 'M30', 'H1', and 'H4' options, with 'M1' selected. The 'モデル' (Model) section shows 'EveryTick', 'ControlPoint', and 'OpenOnly' options, with 'EveryTick' selected. The '期間1' (Period 1) section shows '開始日' (Start Date) as 2014年 1月 1日 and '終了日' (End Date) as 2014年 3月 31日. The '繰り返し' (Repeat) section shows '最適化' (Optimization) checked and '最適化繰り返し' (Optimization Repeat) checked. The 'テスト完了時' (Test Complete) section shows '何もしない' (Nothing). The '終了' (End) and '実行' (Execute) buttons are visible. The '繰り返し' (Repeat) section also includes a table for '繰越条件' (Carryover Conditions) and 'ソート順' (Sort Order).

繰越条件 (AND条件)	ソート順	繰越対象行数
1 1 > 2 > 3 > 4 > 5 > 6 > 7 > 8 > 9 > 10	1 降順 2 降順 3 降順	5

期間	最適化	繰越条件	ソート順	行数
期間1	O	損益>=10000 and DD<=10000	DD% 昇順	10
期間1	O	PF>=1.5	損益 降順	5
期間2	X			5

パス	損益	総取引数	プロフィットファクター	期待利得	トロータウン	トロータウン%			
3	61217.53	53	1.6	1155.05	28084.64	2.78%	0	TSL=50	Magich
5	59996.78	29	1.84	2068.85	26657.51	2.64%	0	TSL=70	Magich
6	47825.36	25	1.66	1913.01	41349.33	4.09%	0	TSL=80	Magich
1	39350.17	120	1.24	327.92	32769.74	3.10%	0	TSL=30	Magich
4	25874.33	34	1.29	761.01	38874.02	3.85%	0	TSL=60	Magich
2	19733	82	1.13	240.65	20381.21	2.02%	0	TSL=40	Magich

最適化 1 回目ですべて合格なので、全件に対して2回目の最適化を実行。

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	
	パス	損益	総取引数	プロフィットファクター	期待利得	トロータウン	トロータウン%				
2	90	72257.34	53	1.73	1363.35	24742.11	2.43%	0	FPeriod=1 SPeriod=40		SgPe
3	195	66880.85	52	1.68	1286.17	28064.96	2.77%	0	FPeriod=7 SPeriod=40		SgPe
4	146	66840.7	52	1.68	1285.4	18669.57	1.80%	0	FPeriod=6 SPeriod=20		SgPe
5	145	66723.45	52	1.68	1283.14	18742.02	1.81%	0	FPeriod=5 SPeriod=20		SgPe
6	65	61595.98	53	1.6	1162.19	28718.06	2.82%	0	FPeriod=9 SPeriod=60		SgPe
7	60	61595.98	53	1.6	1162.19	28718.06	2.82%	0	FPeriod=1 SPeriod=50		SgPe
8	35	61590.38	53	1.6	1162.08	28718.06	2.82%	0	FPeriod=9 SPeriod=70		SgPe
9	30	61590.38	53	1.6	1162.08	28718.06	2.82%	0	FPeriod=1 SPeriod=60		SgPe
0	126	61217.54	53	1.6	1155.05	28133.84	2.78%	0	FPeriod=1 SPeriod=40		SgPe
1	196	61217.53	53	1.6	1155.05	28064.96	2.77%	0	FPeriod=8 SPeriod=40		SgPe
2	161	61217.53	53	1.6	1155.05	28133.84	2.78%	0	FPeriod=9 SPeriod=40		SgPe
3	125	56324.3	52	1.55	1083.16	32810.05	3.24%	0	FPeriod=9 SPeriod=40		SgPe
4	78	56296.85	54	1.52	1041.53	17461.47	1.67%	0	FPeriod=1 SPeriod=20		SgPe
5	155	56291.97	52	1.55	1082.54	24742.11	2.43%	0	FPeriod=9 SPeriod=30		SgPe

TSL=50での最適化結果。

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	
	パス	損益	総取引数	プロフィットファクター	期待利得	トロータウン	トロータウン%				
	9	92791.41	32	2.4	2899.73	21139.53	2.10%	0	FPeriod=7	SPeriod=30	Sg
	5	92791.41	32	2.4	2899.73	21139.53	2.10%	0	FPeriod=9	SPeriod=20	Sg
	39	77709.53	32	2.07	2428.42	26631.88	2.64%	0	FPeriod=7	SPeriod=20	Sg
	4	77679.59	32	2.06	2427.49	21139.53	2.10%	0	FPeriod=8	SPeriod=20	Sg
	36	74972.12	29	2.15	2585.25	21606.12	2.12%	0	FPeriod=1	SPeriod=70	Sg
	106	74961.94	29	2.15	2584.89	21606.12	2.12%	0	FPeriod=8	SPeriod=70	Sg
	74	70167.45	33	1.88	2126.29	26631.88	2.64%	0	FPeriod=6	SPeriod=20	Sg
	73	70167.45	33	1.88	2126.29	26631.88	2.64%	0	FPeriod=5	SPeriod=20	Sg
)	20	62968.19	34	1.73	1852.01	30688	3.02%	0	FPeriod=6	SPeriod=50	Sg
	15	62968.19	34	1.73	1852.01	30688	3.02%	0	FPeriod=7	SPeriod=40	Sg
?	6	62784.83	30	1.86	2092.83	21642.4	2.11%	0	FPeriod=1	SPeriod=20	Sg
}	79	62681.18	34	1.72	1843.56	30688	3.02%	0	FPeriod=5	SPeriod=30	Sg
	49	62681.18	34	1.72	1843.56	30688	3.02%	0	FPeriod=5	SPeriod=40	Sg
	44	62681.18	34	1.72	1843.56	30688	3.02%	0	FPeriod=1	SPeriod=100	Sg

TSL=70での最適化結果。

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	
	パス	損益	総取引数	プロフィットファクター	期待利得	ドロータウン	ドロータウン%				
	73	93283.13	26	2.59	3587.81	31600.3	3.04%	0	FPeriod=5	SPeriod=20	Sg
	207	81834.75	25	2.4	3273.39	20202.76	1.98%	0	FPeriod=7	SPeriod=60	Sg
	43	75984.44	26	2.14	2922.48	31701.8	3.05%	0	FPeriod=5	SPeriod=30	Sg
	109	75976.71	26	2.14	2922.18	31600.3	3.04%	0	FPeriod=5	SPeriod=20	Sg
	79	75976.71	26	2.14	2922.18	31701.8	3.05%	0	FPeriod=5	SPeriod=30	Sg
	74	75976.71	26	2.14	2922.18	31600.3	3.04%	0	FPeriod=6	SPeriod=20	Sg
	40	75976.71	26	2.14	2922.18	31701.8	3.05%	0	FPeriod=8	SPeriod=20	Sg
	39	75976.71	26	2.14	2922.18	31387.15	3.02%	0	FPeriod=7	SPeriod=20	Sg
)	32	73720.09	24	2.25	3071.67	31701.8	3.05%	0	FPeriod=6	SPeriod=70	Sg
	26	73720.09	24	2.25	3071.67	31701.8	3.05%	0	FPeriod=6	SPeriod=60	Sg
?	21	73720.09	24	2.25	3071.67	31701.8	3.05%	0	FPeriod=7	SPeriod=50	Sg
}	20	73720.09	24	2.25	3071.67	31701.8	3.05%	0	FPeriod=6	SPeriod=50	Sg
!	15	73720.09	24	2.25	3071.67	31701.8	3.05%	0	FPeriod=7	SPeriod=40	Sg
	14	73720.09	24	2.25	3071.67	31701.8	3.05%	0	FPeriod=6	SPeriod=40	Sg

TSL=80での最適化結果。

	パス	損益	総取引数	プロフィットファクター	期待利得	ドロータウン	ドロータウン%				
	73	93283.13	26	2.59	3587.81	31600.3	3.04%	0	FPeriod=5	SPeriod=20	SegF
	9	92791.41	32	2.4	2899.73	21139.53	2.10%	0	FPeriod=7	SPeriod=30	SegF
	5	92791.41	32	2.4	2899.73	21139.53	2.10%	0	FPeriod=9	SPeriod=20	SegF
	207	81834.75	25	2.4	3273.39	20202.76	1.98%	0	FPeriod=7	SPeriod=60	SegF
	39	77709.53	32	2.07	2428.42	26631.88	2.64%	0	FPeriod=7	SPeriod=20	SegF
	4	77679.59	32	2.06	2427.49	21139.53	2.10%	0	FPeriod=8	SPeriod=20	SegF
	43	75984.44	26	2.14	2922.48	31701.8	3.05%	0	FPeriod=5	SPeriod=30	SegF
	109	75976.71	26	2.14	2922.18	31600.3	3.04%	0	FPeriod=5	SPeriod=20	SegF
)	79	75976.71	26	2.14	2922.18	31701.8	3.05%	0	FPeriod=5	SPeriod=30	SegF
	74	75976.71	26	2.14	2922.18	31600.3	3.04%	0	FPeriod=6	SPeriod=20	SegF
2	40	75976.71	26	2.14	2922.18	31701.8	3.05%	0	FPeriod=8	SPeriod=20	SegF
}	39	75976.71	26	2.14	2922.18	31387.15	3.02%	0	FPeriod=7	SPeriod=20	SegF
4	36	74972.12	29	2.15	2585.25	21606.12	2.12%	0	FPeriod=1	SPeriod=70	SegF
5	106	74961.94	29	2.15	2584.89	21606.12	2.12%	0	FPeriod=8	SPeriod=70	SegF
6	32	73720.09	24	2.25	3071.67	31701.8	3.05%	0	FPeriod=6	SPeriod=70	SegF
7	26	73720.09	24	2.25	3071.67	31701.8	3.05%	0	FPeriod=6	SPeriod=60	SegF
}	21	73720.09	24	2.25	3071.67	31701.8	3.05%	0	FPeriod=7	SPeriod=50	SegF
	20	73720.09	24	2.25	3071.67	31701.8	3.05%	0	FPeriod=6	SPeriod=50	SegF
)	15	73720.09	24	2.25	3071.67	31701.8	3.05%	0	FPeriod=7	SPeriod=40	SegF
	14	73720.09	24	2.25	3071.67	31701.8	3.05%	0	FPeriod=6	SPeriod=40	SegF
2	11	73720.09	24	2.25	3071.67	31701.8	3.05%	0	FPeriod=9	SPeriod=30	SegF

全6件に対する最適化結果を一つにまとめて抽出・ソートを行い、上位5件に対して最終テストを実行する。

繰越設定例 3)

複数期間でバックテストを行いたい。

- ・ 2008/01/01～2008/12/31の期間を対象に最適化なしでバックテストを行い、取引回数が500回以上、PFが1.5以上、相対DDが10%以下なら次の期間のバックテストを行う。
- ・ 同条件で2009年、2010年、2011年、2012年、2013年で順にバックテストを行う。

1) 最適化パラメータファイルを5つ作成しておく。

全て同じ内容でファイル名のみ変更して作成する。[EA名_01.set][EA名_02.set][EA名_03.set]
[EA名_04.set][EA名_05.set]

2) [期間 1]、[最適化無]、繰越条件[取引回数>=500][PF>=1.5][相対DD<=10]、ソート順なし、繰越対象行数[1]を選択・入力して「追加」を実行する。

3) 期間のみ[期間 2]～[期間 5]に変更して、4回「追加」を実行する。

4) 「実行」でバックテストを開始する。

注意) 最終行は次の行への繰越が必要ないため、条件が設定されていても無視されます。

最適化繰り返しを使わず[期間 1]～[期間 5]を選択して行った場合は全ての年のテストが実行されます。

MT4 BackTest Tool

ファイル(F) 設定(O)

EA一覧

- ☐ #Market%curious-chameleon-ea.ex4
- ☐ #Market%di-ma-strategy.ex4
- ☐ #Market%doublecontrol.ex4
- ☐ #Market%rush-free.ex4
- ☐ #MYEA%New Frontier%EA_ORG_MA_Smoothed2.ex4
- ☐ EA_ORG_MA_Smoothed.ex4
- ☐ MACD_Sample.ex4
- ☐ Moving_Average.ex4

通貨ペア

通貨名	Sp
<input checked="" type="checkbox"/> EURUSD	18
<input type="checkbox"/> GBPUSD	21
<input type="checkbox"/> USDJPY	22
<input type="checkbox"/> AUDCAD	41
<input type="checkbox"/> AUDJPY	40
<input type="checkbox"/> EURAUD	57
<input type="checkbox"/> EURCHF	28
<input type="checkbox"/> EURGBP	22
<input type="checkbox"/> EURJPY	28
<input type="checkbox"/> GBPCAD	46
<input type="checkbox"/> NZDCAD	65
<input type="checkbox"/> NZDJPY	47
<input type="checkbox"/> NZDUSD	20
<input type="checkbox"/> SGDJPY	50
<input type="checkbox"/> USDCAD	23
<input type="checkbox"/> USDJPYmicro	
<input type="checkbox"/>	

時間

☐ M1 ☐ M5 ☐ M15 ☐ M30 ☐ H1 ☐ H4

☐ Daily

モデル

☒ EveryTick ☐ ControlPoint ☐ OpenOnly

*

☒ 期間1

開始日

終了日

☐ 最適化 ☒ 最適化繰り返し

テスト完了時:

繰り返し

☐ 最適化 対象期間

繰越条件 (AND条件)

1 2 3

4 5 6

ソート順 1 2 3

繰越対象行数

期間	最適化	繰越条件	ソート順	行数
期間1	X	取引回数>=500 and PF>=1.5 and 相対DD<=10		1
期間2	X	取引回数>=500 and PF>=1.5 and 相対DD<=10		1
期間3	X	取引回数>=500 and PF>=1.5 and 相対DD<=10		1
期間4	X	取引回数>=500 and PF>=1.5 and 相対DD<=10		1
期間5	X	取引回数>=500 and PF>=1.5 and 相対DD<=10		1

6. その他

バックテストで出力されるファイル名)

繰り返し機能を使わない場合 :

最適化有 : 001_(EA名)_(通貨ペア名)_(時間足)_(開始日)-(終了日)_0.htm

001_(EA名)_(通貨ペア名)_(時間足)_(開始日)-(終了日)_0.gif

最適化有 : 001_OptimizationReport_(EA名)_(通貨ペア名)_(時間足)_(開始日)-(終了日)_0.htm

001_OptimizationReport_(EA名)_(通貨ペア名)_(時間足)_(開始日)-(終了日)_0.gif

繰り返し機能を使った場合 :

最適化有 : (最適化繰返回数)_(EA名)_(通貨ペア名)_(時間足)_(開始日)-(終了日)_0.htm

(最適化繰返回数)_(EA名)_(通貨ペア名)_(時間足)_(開始日)-(終了日)_0.gif

最適化有 :

(最適化繰返回数)_OptimizationReport_(EA名)_(通貨ペア名)_(時間足)_(開始日)-(終了日)_0.htm

(最適化繰返回数)_OptimizationReport_(EA名)_(通貨ペア名)_(時間足)_(開始日)-(終了日)_0.gif

バックテスト中のキャンセル)

MT 4 が起動している間は、キャンセルボタンは押しても効きません。

MT4の画面が消えてから次のテストが始まるまでの時間が約 3 秒ありますので、その間にキャンセルボタンを押すか、ESCキーを押し続けてください。

メイン画面)

ツールバーメニュー

MT4起動 : MT4を起動します。

パラメータファイル : 最適化パラメータファイル設定画面を開きます。

結果フォルダ : テスト結果が保存されているフォルダを開きます。