

「Excelを用いた売買検証法」【編集】[システムトレード]

エクセルでトレーディングシステムを作成する方法について、以前、次の書籍を紹介したことがあります。これは、基本的な理解は得られるかもしれないものの、実際に自分で運用するシステムを作成するには、やや物足りない感があります。



Excelシートで簡単にできる 実践システムトレード入門

作者: 山本 哲也

出版社/メーカー: 日本実業出版社

発売日: 2007/06/14

メディア: 単行本(ソフトカバー)

エクセルによってトレーディングシステムを作成する方法については、書籍以外にも、いくつかのブログやサイトで紹介されています。

このブログでも簡単な説明を行なっていますが、複雑なシステムについては、十分な解説が成されていないかもしれません。

そんな中、PanRolling社のサイトで、有用な解説を見つけました。もっとも、新たに見つけたというよりも、かなり以前にブックマークしていたものを再発見したのですが。

それは、「Excelを用いた売買検証法」(谷口和弘氏)という研究発表で、発表されたのはかなり以前のことで。

PanRolling社のサイト(<http://www.panrolling.com/>)の左側にある"CONTENTS!"メニューから"研究発表"を選択し、その中の"研究発表"から、"■Excelを用いた売買検証法(谷口和弘)"を選択します。

解説は第1回から第7回まであり、その他に「Visual Basicの基本テクニック」という追加解説があります。発表者の谷口氏はオリエント貿易株式会社アセットマネジメント部システムトレーディング課に所属しており、貴重なテクニックを詳細に解説しています。

私がKFシステムクリエイターを開発していた時には、このサイトの存在はすっかり忘れていたのですが、今改めて読み返してみると、KFシステムクリエイターとの間に多くの共通点があることが分かり、驚きを覚えます。

ただし、KFシステムクリエイターとの決定的な違いは、KFシステムクリエイターが期待値の高いオリジナルなロジックを組み込んでいるのに対し、谷口氏の発表では既存のテクニカル指標でのシステム検証に留まっていることです。

しかし、その内容は、エクセルでトレーディングシステムを組む上で、大いに参考になると考えられます。その中には、エクセルのテーブル機能を用いて最適化を行なう方法まで解説されています。

これは別に目新しいことではないのですが、KFシステムクリエイターの解説においては、あえて明示を避けてきました。

それは、パラメータの最適化を容易に行なうこの方法は、トレーディングシステムにとって大きなアドバンテージの一つであるからです。

分かっしまえば常識的なことなのですが、このやり方を知っていると知らないのでは、そのシステムに大きな差が出てきます。

それ以外にも、多くの評価項目の計算方法や解説が成されています。これは、自分でトレーディングシステムを開発しようと考えている人のみならず、テクニカルトレードを志向する人にとっても、大いに参考になると思います。

このように、この研究発表は非常に有意義な内容なのですが、ただ一つ問題があるとすれば、それはエクセルの記述がR1C1(参照)形式で行なわれているということです。もっとも、問題といっても使い方が間違っているなどといった類のことではありません。

R1C1形式は、マクロとの整合性が高いなどといったメリットがあり、また、行と列とが対等であるため数式的にもすっきりします。

一時期は、この方式が推奨されたりもしましたが、現在では結局、列をアルファベットで表記するA1(参照)形式が主流となっているようです。

現在出版されているエクセル関係の解説書は、ほとんどがA1形式で記述されています。そのため、A1形式のみでエクセルを理解されている方が大半ではないかと思えます。

R1C1形式があまり主流にならなかったのは、最大行数が6万行以上であるのに対し、最大列数はわずかに256列しかないという、著しいアンバランスが原因なのではないでしょうか。

したがって、この谷口氏の解説を読んでも、数式の意味を理解することが難しく感じられます。A1形式に慣れてしまうと、R1C1形式の記述でセルの位置関係を咄嗟にイメージすることが困難に思われます。もっとも、これは私だけの感覚なのかもしれませんが。

そのような点はあるものの、この研究発表はエクセルでトレーディングシステムを開発しようとする人にとっては、非常に有用であることは間違いありません。

ただし、最終的にトレーディングシステムの有効性を決定するのは、あくまでも売買ロジックであるということを忘れてはいけません。

2007-09-10 18:20 nice!(0) コメント(0) トラックバック(0)
共通テーマ:株