

用語集

名称	意味
ストラテジ	テクニカル指標などを組み合わせ、構築された売買プログラムをいいます。
シグナル	一般的に、テクニカル指標におけるテクニカルポイントの発生をいい、システムトレードでは売買のサインをいいます。シグナルは売買シグナルといわれる場合もあります。
ポートフォリオ	一般的には、資産を複数の金融商品に分散投資することをさします。システムトレードでは、複数のストラテジを組みあわせることで、リスクの分散とリターンの安定化をはかることを手法をさす場合があります。
最大建玉	そのストラテジーが同時に保有することができる建玉の数が表示されます。最大ポジションが「2」のストラテジは、取引単位が10(千)の場合、 $2 \times 10(千) = 20(千)$ まで、建玉を保有することが可能です。
プロフィット・ファクター	純益対純損失の比率が表示されます。この比率は利益がどの程度損失を上回ったかを表します。例えば1を超える値はストラテジが損失より多く利益を生み出したことを意味します。
期間内取引数	指定期間中の取引回数を言います。 期間内に新規、その後決済した取引を1回とします。
平均取引期間	そのストラテジが建玉を保有している平均期間を言います。 期間の短いストラテジほど、頻繁に取引が行われます。
損益(Pips)	期間内における建玉の新規から決済のレート差を合計した数値を言います。 建玉を保有中は、評価損益のことを言います。
損益率	売買検証期間内における総利益(勝ちトレードの合計)と総損失(負けトレードの合計)の割合です。 「総利益／総損失」で求められます。より大きい方が優れている数値で、「1」より小さい場合は総利益より総損失の方が大きいことを意味します。従って、損益率が「1」より小さいストラテジは対象期間内はあまりいい成績を残せなかった、と言えます。

用語集

名称	意味
平均損益 (Pips)	各トレード毎の平均損益値幅 (Pips)を言います。 この数値は期待値とも言われ、ストラテジの取引1回あたりの平均的な収益の参考とします。
平均利益 (Pips)	指定した期間内における利益を出した取引を抽出し、1回あたりの平均利益を計算したものを言います。
平均損失 (Pips)	指定した期間内における損失を出した取引を抽出し、1回あたりの平均損失を計算したものを言います。
最大ドローダウン	売買検証期間内における損益の落ち込みを指し、その中で落ち込み幅が最も大きいものをいいます。複数回の損失も含むことから、損失を伴い取引が多くなった時にどれくらい損益が落ち込んだことがあるか、を表した指標であり、将来の最大損失の目安として利用できます。(価格の値幅(pips)または損益額で表示されます)
最大利益	指定した期間内に、最も利益(金額またはPips)を得られた取引の「実現利益」のことを言います。
最大損失	指定した期間内に、最も損失(金額またはPips)の大きかった取引の「実現損失」のことを言います。
勝率	売買検証期間内における総取引回数の中で、利益の出た取引の比率を言います。 「利益を生じた取引回数÷総取引回数」で求められます。
負率	売買検証期間内における総取引回数の中で、損失の出た取引の比率を言います。 「損失を生じた取引回数÷総取引回数」で求められます。
リスクリターン率	期間内における累積実現損益が最大ドローダウンの何倍かを表す比率のことを言います。 1以上のストラテジが、期間内で利益を出しているストラテジとなります。

用語集

名称	意味
最大損失率	口座全体の証拠金に対する、指定期間中の最大ドローダウンの比率のことを言います。
最大評価利益／最大評価損失	新規で約定した建玉が決済されるまでに記録された最大の評価利益と最大の評価損失をそれぞれ言います。