

本格的なシステム構築で
安定運用を目指す

「村居式システムトレード」

補講資料：「想定外のイベントに対する
売買の扱いについて」

この資料で学ぶこと

- **それまでに検証ができないような
「想定外のイベント」があったとき
その前後で発生する
売買結果のとらえかた、対処方法**

◆2019年 GW10連休について◆

今年の10連休は、
これまでのマーケットにはなかった
初めての出来事



こういったイベントは
そもそも事前の検証自体ができない

**このようなイベントの前後で
売買サインが出たときは**

**「再現性が期待できるのか？」
を良く考慮して**

**リスクを検討したうえで
売買するかどうかの判断をしましょう**

「再現性が期待できない」と判断した場合は？

- 実際の**売買は見送る**
- KENSHIRO-225で表示される**売買結果は損益にかかわらず無視する**

のがよいでしょう

◆KENSHIRO-225で売買結果を除外する方法① 「イベントフィルタ」

※イベントフィルタは有料オプションです

システム名 システムを登録する
システム名変更

メモ

設定条件

・シミュレーション対象: 日経225mini

シミュレーション開始 システム追加 システム再登録 元に戻す システム削除

シミュレーション対象

●日経225mini ○日経225large

検証期間指定

運用結果グラフ

金額

期間別運用実績

期間	運用実績	利回り	最大DD	トレード数	勝率
2006/07/18~2006/12/31	37,500	20.0%	-53,500	12	66.7%
2007/01/01~2007/12/31	55,000	29.3%	-41,000	21	55.0%
2008/01/01~2008/12/31	0	0.0%	0	0	0.0%
2009/01/01~2009/12/31	-24,500	-13.1%	-28,500	2	50.0%
2010/01/01~2010/12/31	-14,500	-7.7%	-64,000	12	50.0%
2011/01/01~2011/12/31	44,000	23.5%	-43,000	16	68.8%
2012/01/01~2012/12/31	77,500	41.3%	-23,500	13	53.8%
2013/01/01~2013/12/31	90,000	48.0%	-18,500	4	75.0%
2014/01/01~2014/12/31	19,000	10.1%	-60,000	16	60.0%
2015/01/01~2015/12/31	113,000	60.3%	-63,000	17	64.7%
2016/01/01~2016/12/31	179,000	95.5%	-33,000	17	82.4%
2017/01/01~2017/12/31	318,500	169.9%	-97,500	43	68.3%
2018/01/01~2018/12/31	250,500	133.6%	-58,000	19	66.7%
2019/01/01~2019/06/20	-49,500	-26.4%	-71,500	12	41.7%



システム名 システムを登録する
システム名変更

メモ

設定条件

・シミュレーション対象: 日経225mini

シミュレーション開始 システム追加 システム再登録 元に戻す システム削除

シミュレーション対象

●日経225mini ○日経225large

検証期間指定

運用結果グラフ

金額

期間別運用実績

期間	運用実績	利回り	最大DD	トレード数	勝率
2006/07/18~2006/12/31	37,500	20.0%	-53,500	12	66.7%
2007/01/01~2007/12/31	55,000	29.3%	-41,000	21	55.0%
2008/01/01~2008/12/31	0	0.0%	0	0	0.0%
2009/01/01~2009/12/31	-24,500	-13.1%	-28,500	2	50.0%
2010/01/01~2010/12/31	-14,500	-7.7%	-64,000	12	50.0%
2011/01/01~2011/12/31	44,000	23.5%	-43,000	16	68.8%
2012/01/01~2012/12/31	77,500	41.3%	-23,500	13	53.8%
2013/01/01~2013/12/31	90,000	48.0%	-18,500	4	75.0%
2014/01/01~2014/12/31	19,000	10.1%	-60,000	16	60.0%
2015/01/01~2015/12/31	113,000	60.3%	-63,000	17	64.7%
2016/01/01~2016/12/31	179,000	95.5%	-33,000	17	82.4%
2017/01/01~2017/12/31	318,500	169.9%	-97,500	43	68.3%
2018/01/01~2018/12/31	250,500	133.6%	-58,000	19	66.7%
2019/01/01~2019/06/20	7,500	4.0%	-44,000	10	50.0%

・ユーザーイベント
改元前10連休前の当日と、その前3日間を省く

ユーザーイベント設定

ユーザーイベント1

ユーザーイベント2

イベント名 改元前10連休前 変更

2019/04/26

日付リスト

継続イベント

期間別運用実績

期間	運用実績	利回り	最大DD	トレード数	勝率
2006/07/18~2006/12/31	37,500	20.0%	-53,500	12	66.7%
2007/01/01~2007/12/31	55,000	29.3%	-41,000	21	55.0%
2008/01/01~2008/12/31	0	0.0%	0	0	0.0%
2009/01/01~2009/12/31	-24,500	-13.1%	-28,500	2	50.0%
2010/01/01~2010/12/31	-14,500	-7.7%	-64,000	12	50.0%
2011/01/01~2011/12/31	44,000	23.5%	-43,000	16	68.8%
2012/01/01~2012/12/31	77,500	41.3%	-23,500	13	53.8%
2013/01/01~2013/12/31	90,000	48.0%	-18,500	4	75.0%
2014/01/01~2014/12/31	19,000	10.1%	-60,000	16	60.0%
2015/01/01~2015/12/31	113,000	60.3%	-63,000	17	64.7%
2016/01/01~2016/12/31	179,000	95.5%	-33,000	17	82.4%
2017/01/01~2017/12/31	318,500	169.9%	-97,500	43	68.3%
2018/01/01~2018/12/31	250,500	133.6%	-58,000	19	66.7%
2019/01/01~2019/06/20	7,500	4.0%	-44,000	10	50.0%

総合運用実績

最低運用資金	187,500
損益累計	1,152,500
利回り	614.7%
勝率	64.0%
最大ドローダウン(DD)	-97,500

◆KENSHIRO-225で売買結果を除外する方法② 「エントリー期日設定」

システム名 システムを登録する

システム名変更

メモ

設定条件

・シミュレーション対象: 日経225mini

シミュレーション開始 システム追加 システム再登録 元に戻す システム削除

シミュレーション対象

日経225mini 日経225large

検証期間指定

運用結果グラフ

金額

期間別運用実績

期間	運用実績	利回り	最大DD	トレード数	勝率
2006/07/18~2006/12/31	37,500	20.0%	-53,500	12	66.7%
2007/01/01~2007/12/31	55,000	29.3%	-41,000	21	55.0%
2008/01/01~2008/12/31	0	0.0%	0	0	0.0%
2009/01/01~2009/12/31	-24,500	-13.1%	-28,500	2	50.0%
2010/01/01~2010/12/31	-14,500	-7.7%	-64,000	12	50.0%
2011/01/01~2011/12/31	44,000	23.5%	-43,000	16	68.8%
2012/01/01~2012/12/31	77,500	41.3%	-23,500	13	53.8%
2013/01/01~2013/12/31	90,000	48.0%	-18,500	4	75.0%
2014/01/01~2014/12/31	19,000	10.1%	-60,000	16	60.0%
2015/01/01~2015/12/31	113,000	60.3%	-63,000	17	64.7%
2016/01/01~2016/12/31	179,000	95.5%	-33,000	17	82.4%
2017/01/01~2017/12/31	318,500	169.9%	-97,500	43	68.3%
2018/01/01~2018/12/31	250,500	133.6%	-58,000	19	66.7%
2019/01/01~2019/06/20	-49,500	-26.4%	-71,500	12	41.7%

システム名 システムを登録する

システム名変更

メモ

設定条件

・シミュレーション対象: 日経225mini

毎年4月25日~5月7日を省く

エントリー期日設定

エントリー期日設定

システム削除

運用結果グラフ

金額

期間別運用実績

期間	運用実績	利回り	最大DD	トレード数	勝率
2006/07/18~2006/12/31	37,500	20.0%	-53,500	12	66.7%
2007/01/01~2007/12/31	48,000	25.6%	-41,000	19	50.0%
2008/01/01~2008/12/31	0	0.0%	0	0	0.0%
2009/01/01~2009/12/31	-24,500	-13.1%	-30,000	2	50.0%
2010/01/01~2010/12/31	-14,500	-7.7%	-65,500	12	50.0%
2011/01/01~2011/12/31	38,000	20.3%	-44,500	14	64.3%
2012/01/01~2012/12/31	88,000	46.9%	-23,500	12	58.3%
2013/01/01~2013/12/31	90,000	48.0%	-18,500	4	75.0%
2014/01/01~2014/12/31	48,000	25.6%	-31,000	15	64.3%
2015/01/01~2015/12/31	170,500	90.9%	-17,000	16	68.8%
2016/01/01~2016/12/31	179,000	95.5%	-33,000	17	82.4%
2017/01/01~2017/12/31	311,500	166.1%	-97,500	42	67.5%
2018/01/01~2018/12/31	219,500	117.1%	-58,000	16	66.7%
2019/01/01~2019/06/20	6,000	3.2%	-44,000	11	45.5%

※この方法では
2019年以外の年もすべて除外されます。
ご注意ください。

エントリー期日設定

エントリー期日設定

毎年 月 日 ~ 月 日 を省く

◆KENSHIRO-225で売買結果を除外する方法③ 「メモ機能」を活用する

システム名 システムを登録する

システム名変更

■ メモ

2019年 GWまたぎの取引で出た損失は無視する。-55,500円
(初めての10連休による例外)

登録日

更新日

■ 設定条件

・シミュレーション対象: 日経225mini

運用結果グラフ

※実際は除外できませんが、メモしておくことで覚えておくことができます。

2007/01/01~2007/12/31	55,000	29.5%	-41,000	21	55.0%
2008/01/01~2008/12/31	0	0.0%	0	0	0.0%
2009/01/01~2009/12/31	-24,500	-13.1%	-28,500	2	50.0%
2010/01/01~2010/12/31	-14,500	-7.7%	-64,000	12	50.0%
2011/01/01~2011/12/31	44,000	23.5%	-43,000	16	68.8%
2012/01/01~2012/12/31	77,500	41.3%	-23,500	13	53.8%
2013/01/01~2013/12/31	90,000	48.0%	-18,500	4	75.0%
2014/01/01~2014/12/31	19,000	10.1%	-60,000	16	60.0%
2015/01/01~2015/12/31	113,000	60.3%	-63,000	17	64.7%
2016/01/01~2016/12/31	179,000	95.5%	-33,000	17	82.4%
2017/01/01~2017/12/31	318,500	169.9%	-97,500	43	68.3%
2018/01/01~2018/12/31	250,500	133.6%	-58,000	19	66.7%
2019/01/01~2019/06/20	-49,500	-26.4%	-71,500	12	41.7%