

# Golden Tree iAbtOptimizer、iStdOptimizer

[創造の館](#)

Copyright Since 2014-2018

本ソフトはライセンスフリーで、転載・配布も自由です。

## 1. 概要

GoldenTree シリーズのバックテストを全自動で行うインジケータです。通貨ペアのシンボルを指定するだけで自動的にバックテストを行い、トレードに有利なパラメータの探索ができます。求めたパラメータは、同シリーズの Professional 版にセットしてトレードできます。

## 2. 機能

1. 最大 100 通貨ペアのシンボルについてバックテストを全自動で行います。
2. 計算の途中経過を csv ファイルで確認できます。
3. 計算の最終結果を csv 形式で出力します。LibreOffice などに読み込んで分析できます。

## 3. インストールと実行

本インジケータの実行中、他の操作は一切できなくなりますので MT4 をトレードに使っている場合は、別途 MT4 を別のフォルダにインストールするなどして実行してください。

MT4 の[ファイル][データフォルダを開く]として、MQL4\Indicator フォルダの中に ex4 ファイルを置いてください。

同じ MQL4\Files フォルダの下に結果が出力されますので開いた状態にしておいてください。

MT4 の上に適当なチャートを表示させ、本インジケータを Drag&Drop してください。計算の時間足はチャートの設定が適用されます。チャートの内容そのものはソフトの実行に関係しません。

Drag&Drop するとパラメータの入力画面が表示され、OK を押すと実行が開始されます。

実行すると MT4 が (応答なし) で固まったようになりますが正常です。

実行が始まると Files フォルダの下に csv ファイルが次々に作られます。新たな計算結果が出るたびに新しい csv ファイルが追加されていきます。

計算が終了するとチャート画面に Complete!!と表示され Files フォルダの下に csv ファイルが作られます。日付の一番新しいデータがすべての結果が記録された最終結果です。

計算が終わったら必ず本ソフトを貼り付けたチャートを削除してください。これを忘れると MT4 起動時にまた再計算が開始されてしまいます。

計算を途中でとめる場合は MT4 をいったん強制終了させ、MT4 を再度起動させてすぐに本インジケータを貼りつけたチャートを削除してください。

	A	B	C	D	E	F	G	H	I	J	K	L	M	N	O	P
1	DATE 2014	5:31:54														
2	Time Frame H4															
3	Sym1	Sym2	Algo	EntryHt	CloseH	Weight	RevF	CCF	Total	MaxPF	MaxDD	All	Won	Work%	PF	TradeLegs
4	CADJPY	NZDJPY	2	100	50	67.7	TRUE	0.15	133140	32220	-6350	27	16	59	4.26	5544
5	EURDKK	USDJPY	2	100	50	21.5	FALSE	-0.46	75427	40469	-5794	30	17	56	3.91	6785
6	USDOKK	USDZAR	2	80	50	23.6	TRUE	0.37	308493	54716	-13818	46	27	58	3.82	7229
7	CADCHF	EURAUD	2	100	50	51.2	TRUE	-0.07	443439	139289	-22347	34	22	64	3.63	7267
8	USDONH	USDTRY	2	100	50	53.6	TRUE	0.45	168906	81163	-11322	23	13	56	3.6	5688
9	EURSEK	USDHUF	2	100	50	266.1	FALSE	-0.01	322906	89865	-16010	40	22	55	3.59	7357
10	EURDKK	AUDJPY	2	80	50	16.6	TRUE	0.15	43687	9949	-1922	45	27	60	3.58	6785
11	NZDCAD	EURJPY	2	100	50	78	FALSE	0.65	442922	136942	-15321	40	24	60	3.5	8627
12	USDONH	EURCHF	3	100	50	327.9	TRUE	0.36	313006	35758	-18610	37	22	59	3.32	5688
13	NZDCAD	CADJPY	3	100	50	106.7	TRUE	-0.33	331616	40158	-21019	33	22	66	3.31	5545
14	EURTRY	EURCZK	2	100	50	262.6	TRUE	0.21	369943	103180	-15631	41	22	53	3.27	8758
15	EURDKK	GBPUSD	2	100	50	17.7	FALSE	0.27	38038	13612	-2754	33	20	60	3.21	6785
16	USDONH	EURCHF	2	100	50	343	FALSE	0.36	252048	116779	-12621	24	11	45	3.2	5688
17	EURNOK	AUDCHF	2	100	50	674.3	FALSE	-0.35	318630	54969	-13368	40	23	57	3.17	7263
18	USDOKK	AUDUSD	2	100	50	168.6	TRUE	-0.67	396382	88324	-18204	37	21	56	3.16	8727
19	USDOKK	EURCZK	2	80	50	247.9	TRUE	0.06	320623	102400	-11556	49	27	55	3.13	7360
20	USDONH	CADCHF	2	60	50	166.7	FALSE	0.74	215250	64485	-12004	40	19	47	3.13	5688
21	EURDKK	EURJPY	1	100	50	13.8	FALSE	0.04	47177	19826	-1598	55	23	41	3.12	6785
22	EURCZK	USDZAR	2	100	50	10	FALSE	0.51	276043	90678	-15828	31	19	61	3.09	7229
23	USDTRY	USDHUF	2	100	50	178.1	TRUE	-0.47	185358	50707	-11432	31	18	58	3.09	6505
24	EURNOK	EURGBP	3	100	50	1239.1	FALSE	0.33	470383	45051	-25122	51	33	64	3.04	7354
25	USDONH	AUDUSD	3	80	50	146.7	FALSE	-0.41	136285	15448	-10918	35	21	60	3.02	5688
26	USDOKK	AUDUSD	2	100	50	370.5	TRUE	-0.69	408831	118012	-20926	36	22	61	3.01	7360
27	USDONH	NZDCHF	3	100	50	145.6	TRUE	-0.35	236295	32104	-12974	41	22	53	2.99	5688
28	SGDJPY	EURPLN	2	80	50	30.7	TRUE	-0.04	263339	61521	-15276	37	22	59	2.96	7359
29	EURDKK	EURJPY	1	80	50	13.8	FALSE	0.22	47155	16030	-1644	71	29	40	2.96	6785
30	USDTRY	EURCHF	2	100	50	656	FALSE	0.68	331890	64047	-24149	44	23	52	2.94	8732
31	SGDJPY	ZARJPY	2	80	50	458.6	TRUE	0.89	127160	31540	-6900	49	30	61	2.93	7359
32	USDONH	EURCHF	2	100	50	327.9	TRUE	0.36	184492	115198	-14603	26	13	50	2.92	5688
33	USDONH	ZARJPY	2	80	50	788.1	TRUE	-0.48	273832	76481	-20867	32	18	56	2.91	5688
34	USDOKK	GBPUSD	2	100	50	71.4	FALSE	0.5	331541	85140	-16223	40	21	52	2.9	8488
35	AUDNZD	USDZAR	2	100	50	127.1	TRUE	-0.44	360690	82123	-14173	50	31	62	2.87	10686

実行後の csv ファイルの例

## 4. 詳細

最初に Sym で指定した全通貨ペアのチェックを行います。足数が不足する通貨ペアや価格情報が入り読み取れない通貨ペアがあると MQL4Files フォルダ内に DataFail ファイルが作られます。ここで問題の通貨ペアと取得できた足数を確認できます。

計算期間やスプレッドはお使いの FX 会社が提供するサーバに依存します。

MT4 をインストールした PC の中には最初から十分なデータがありません。足りないデータは FX 会社のサーバーから順次 DL する仕組みですので、DataFail が出てもそのまましばらく待ってください。

計算が開始されると Optimize Start という名前のファイルが作られます。

いつまで経っても計算が開始されない場合や、上記 DataFail ファイルから問題が消えない場合は次の原因が考えられます。

- Sym で指定した通貨ペアが実在しない。
- Sym で指定した通貨ペアのデータが足りない。MinimumBars の値を小さくしてみてください。
- Sym で指定したシンボルの補完がうまくいっていない。AutoSymbol = false に設定してシンボルの添え字を含め正確に入力してください。

これらの対処をしても DataFail のリストから消えない通貨ペアは Sym の指定から外してください。

注:仮想通貨は IronFX や BITPoint の口座で取引できます。IronFX では通貨ペアの添え字がまちまちなので、AutoSymbol を False にして通貨ペアのシンボルを正確に入力してください。

最後に作られる Complite ファイルにすべての結果が記録されています。項目の意味は次の通りです。

プログラムを開始すると CPU のタスクを 30%程度消費します。

1つの口座に対し複数の本インジケーターを実行するとサーバーに負荷をかける可能性がありますのでおやめください。

SYM1,SYM2 :通貨ペア。

Algo,RevF,EntryN,CloseN,Weight: 計算に用いたパラメータ。(他のパラメータはデフォルト)

CCF:相関係数

TotalResult:総損益

TotalPF:利益の合計

TotalDD:損失の合計

MaxPF:最大利益

MaxDD:最大損失

All:トレードの総数

Won: 価値トレードの数

Won(%):勝率

PF:プロフィットファクター

APF:調整プロフィットファクター

TradeLegs: 計算に利用された足数

## 6. 結果の評価方法

添付のオプティマイザー分析シート.ods を利用すると僅か3ステップで有効な戦略を抽出できます。このシートは LibreOffice の Calc (フリーソフト) で読み込んで利用できます。

詳細は同シートの「使い方」タブをご参照ください。

## 7. パラメーター

MagicNumber(0)

複数の EA が同時に走っている場合は他の EA と重複しない番号を指定してください。

30000 に Forex で取引できる全通貨ペア(84 種類, 2018 月 3 時点)がプリセットされています。

MinimumBars(500)

計算に必要な最低足数を指定します。ここで指定した値以下のデータしか得られない通貨ペアは無視します。DateLimit=True のときこの値は無視されます。

DateLimit(true)

計算を開始する時間を StartDate で指定します。サーバーから得られるデータに欠損がある場合、時間を指定して除外できます。

false のとき StartDate を無視して口座から取得できる最大期間で計算を行います。

UnderLimPF

勝率の悪い結果を除外するための閾値です。値はプロフィットファクターです。得られた答えが少なすぎて分析に支障が出る場合この値を小さくしてみてください。多すぎる場合は値を高くしてください。

Balance: 資金 (円)

トレードの基準資金。結果に応じて増減されず毎回この一定値になります。

Sym

計算の対象にする通貨ペアのシンボルを指定します。

取引しているFXが提供する通貨ペアのリストを参考に「EURUSD」「GBPJPY」「USDJPY」などと入力します。USDJPYpro など末尾に添え字(pro,FXF など)が付く場合は省略してください(内部で自動的に補完されます)。

空欄のところは計算から除外されます。

自動補完される添え字が不適当な場合は AutoSymbol = false に設定してシンボルを省略せずに正確に入力してください。

他のパラメータの設定と意味はそれぞれの GoldenTree で共通です。

以下は 0 に設定することで自動可変にできます。

Algorithm:0(デフォルト)にすると 1,2,3 自動可変します。

EntryN:0(デフォルト)にすると 50～140 の範囲で自動可変します。

iAbtOptimizer では RevF の True,False の切り替えを自動で行います。

注: 自動可変を使うと計算時間が長くなり、完了まで**1週間以上かかる**場合があります。パソコンが勝手に再起動しないようアップデート等の設定にご注意ください。

## バージョンの履歴

2018/03/07 AbtOptimizerVer1.03、iStdOptimizerVer1.02 公開

2014/06/28 AbtOptimizerVer1.01 公開

2014/06/15 AbtOptimizerVer1.00 公開

### 2018/3/4 変更点

FOREX や IronFX の全通貨ペア、CFD に対応した。  
設定できる通貨ペアの数を増やした(50→100)

### Ver1.00→1.01 変更点

- 損益の計算にスプレッドを考慮するようにした。
- Algorithm と EntryN の設定値のデフォルトをゼロに変更
- EntryN の可変範囲をより細かくした。