

STage 시뮬레이션 차트 최적화 사용 안내

1. STage 시뮬레이션 차트

STage 시뮬레이션 차트에서는 과거데이터를 바탕으로 전략검증을 수행할 수 있습니다. 매매전략의 변수 최적화를 통해 변수 변화에 따른 전략 성과의 변화를 확인할 수 있습니다.



2. 최적화 사용 방법

SStage 시뮬레이션 차트의 최적화 사용 방법을 살펴보겠습니다. 예를 들기 위해, [매매전략]의 이동평균 크로스를 클릭하여 전략을 적용하겠습니다.



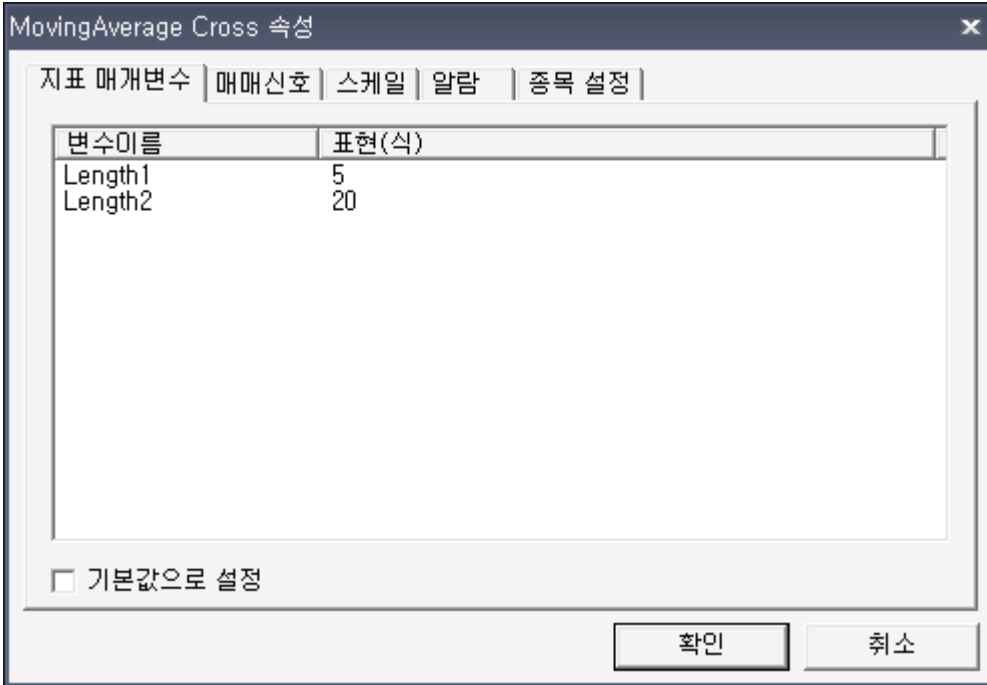
차트의 지표명 [이동평균 크로스]를 오른쪽 클릭하면 아래와 같은 메뉴가 표시됩니다. 아래의 메뉴에서 [지표 속성]을 클릭합니다.

- ✓ MovingAverage Cross
 - 지표 속성
 - 지표 편집
 - 지표 삭제

- 차트 설정
- 차트 저장
- 차트 불러오기
- 템플릿 저장
- 템플릿 열기
- 지표관리

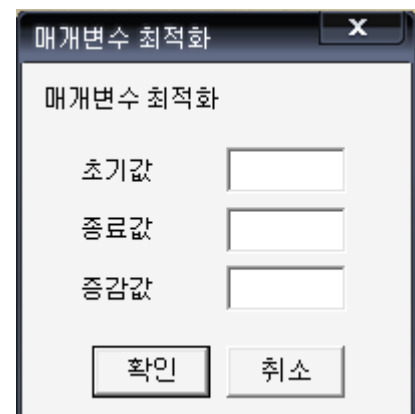
- 새 탭 추가
- 현재 탭 삭제
- 탭 리스트 ▶

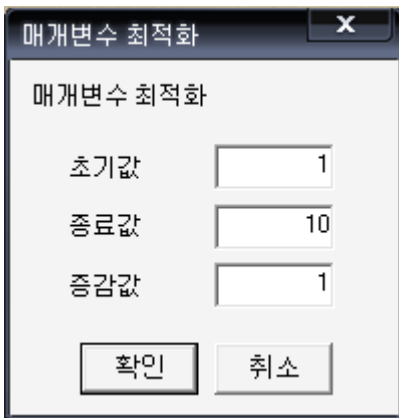
[지표 속성]을 클릭하면 차트에 적용된 지표의 속성 화면이 나타납니다. [지표 매개변수]를 보시면 [이동평균 크로스]지표의 변수이름과 표현(식)이 나타나있습니다.



[지표 속성]의 [지표 매개변수]에는 적용된 전략의 변수가 표시되며, 해당 변수에 대한 최적화 작업을 수행할 수 있습니다. 최적화를 수행하기 위해서는 최적화 하고자 하는 변수를 클릭합니다.

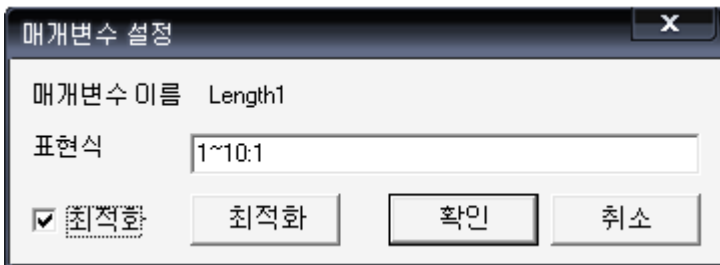
위의 Length1 을 클릭하면 아래의 왼쪽 창이 나타납니다. [매개변수 설정] 창에서 [최적화]의 체크박스를 클릭하게 되면 아래의 오른쪽 창이 나타나게됩니다.





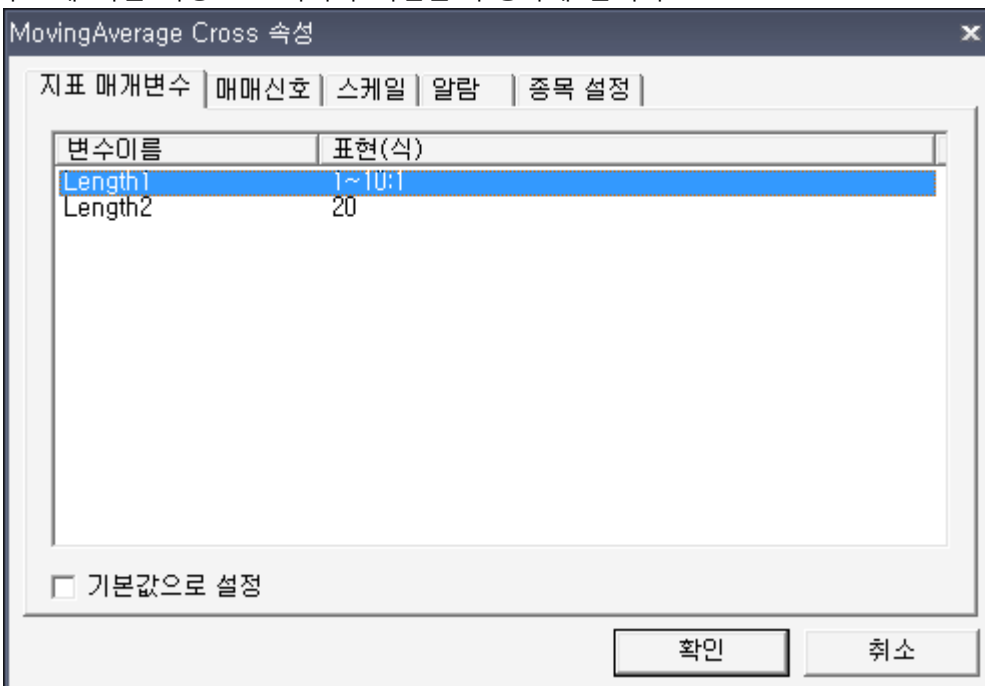
매개변수 최적화] 창에 초기값, 종료값, 증감값을 입력합니다. 왼쪽의 경우 초기값 1 부터 종료값 10 까지 해당변수를 1 씩 증가시켜가며 최적화 작업을 수행하는 것을 의미합니다.

확인을 클릭하면 [매개변수 설정]창으로 돌아갑니다.



최적화 설정을 마치고 나면 [매개변수 설정] 화면의 표현식이 변하게 됩니다. 여기서 다시 확인을 클릭합니다.

아래의 [지표 속성] 창의 표현식이 변경된 것을 확인하실 수 있습니다. 여기서 확인버튼을 한번 더 누르게 되면 자동으로 최적화 작업을 수행하게 됩니다.



최적화 수행작업이 완료되면 다음과 같은 최적화 보고서 화면이 나타나게 됩니다. 이 화면을 통해 변수 값 설정에 따른 전략성과의 차이를 확인할 수가 있습니다.

No	Length1	순손익	미청산 손익	총 이익	총 손실	최대 평가 손실폭	보상비율	승률	총 거래 회수	수익 거래회수	손실 거래회수	최대 이익
9	6	6,201,016	0	26,364,585	-20,163,569	-9,236,613	1.31	27.59	58	16	42	5,362,864
7	9	5,418,330	-125,000	25,116,650	-19,698,320	-13,161,635	1.28	40.00	50	20	30	4,987,865
10	10	4,916,496	-50,000	26,579,844	-21,663,348	-14,110,406	1.23	43.75	48	21	27	4,887,873
5	7	3,948,276	0	24,690,550	-20,742,274	-10,386,641	1.19	33.33	54	18	36	5,112,866
6	5	1,752,689	0	25,865,618	-24,112,929	-9,964,689	1.07	27.59	58	16	42	5,262,871
8	8	1,569,798	-125,000	23,603,258	-22,033,460	-12,161,610	1.07	34.00	50	17	33	5,037,868
3	3	-518,605	200,000	25,631,209	-26,149,814	-11,287,150	0.98	33.87	62	21	41	5,137,878
4	2	-1,079,904	175,000	26,358,444	-27,438,348	-11,049,865	0.96	28.05	82	23	59	5,237,873
2	4	-2,821,019	200,000	24,901,905	-27,722,924	-13,564,604	0.90	28.33	60	17	43	5,137,878
1	1	-2,911,184	175,000	26,732,570	-29,643,754	-14,156,109	0.90	22.55	102	23	79	5,237,873

최적화 작업을 한번 실행하고 난 이후에는, STage 시뮬레이션 차트의 [시스템트레이딩] 메뉴의 [최적화 리포트]를 통해 다시 확인하실 수가 있습니다.

STage에서는 한 개의 변수뿐 아니라 여러 개의 변수에 대해서도 동시에 최적화가 가능합니다. 이 경우 [지표 매개변수] 속성의 각각의 변수에 대해 최적화 설정을 하시면 됩니다.