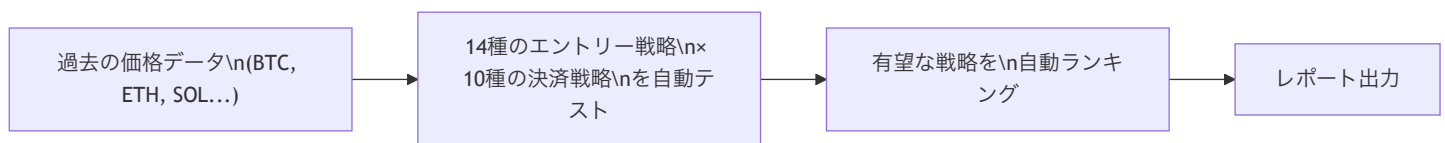


Prism ユーザーガイド

仮想通貨の売買戦略を自動で探索・検証するツール。

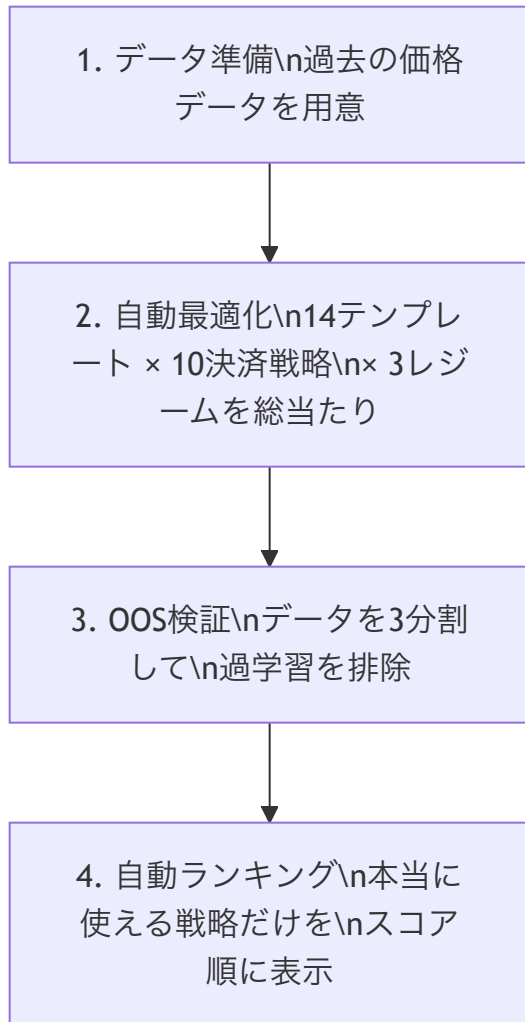
「どのルールで売買すれば利益が出たか？」を過去データで網羅的にテストし、有望な戦略を見つける。

このツールで何ができる？



- 30銘柄 × 複数の時間足 × 2年分のデータ を一括検証
- 「過去1年で利益が出た」だけでなく「未知のデータでも利益が出たか」を3分割検証（OOS）
- 過学習（たまたまハマっただけ）の戦略を自動で警告

全体の流れ



データ

価格データ（OHLCV = 始値・高値・安値・終値・出来高）をCSVで用意する。

読み込み方法は3つ:

- Binance CSV/ZIP（ディレクトリ指定で一括読み込み）
- TradingView CSV（手動エクスポート）
- ドラッグ&ドロップ（複数ファイル対応）

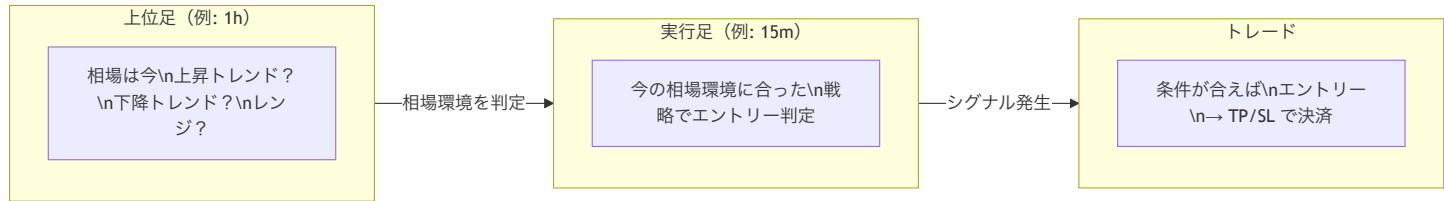
ポイント:

- 最低1つの時間足があれば動作する

- 2つの時間足（実行足 + 上位足）を読むと、相場環境に応じた戦略切り替えが可能

時間足の組み合わせ

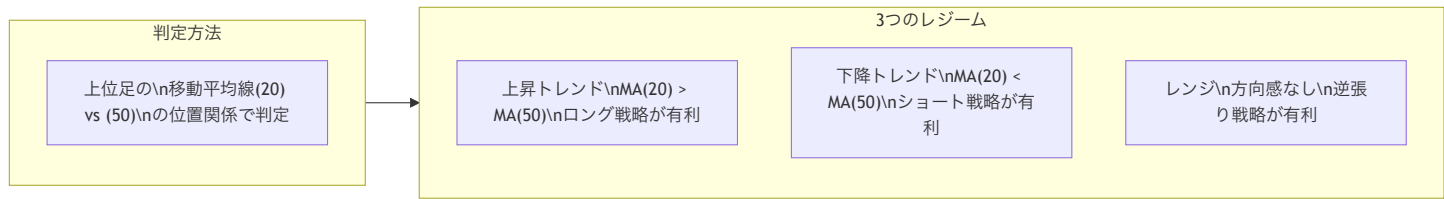
2つの時間足を使う。「実行足」でエントリー判定、「上位足」で相場環境を判定。



実行足	上位足	特徴
1m	15m	超短期スキャルピング
15m	1h	標準。バランスが良い
15m	4h	中期スイング向け
1h	4h	スイングトレード

レジーム（相場環境）

相場は常に同じ状態ではない。大きく3つの環境に分け、それぞれに最適な戦略を使い分ける。



上昇トレンドでは買い戦略、下降トレンドでは売り戦略、レンジでは逆張り。
最適化ではレジームごとに最適な戦略を自動で選ぶ。

14種のエントリーテンプレート

自動で試すエントリー戦略の一覧。

ロング（買い）戦略 – 6種

テンプレート	何をするか	狙い
ma_crossover	短期移動平均が長期移動平均を上抜け	トレンド転換の初動
rsi_reversal	RSIが売られすぎ水準から反発	下がりすぎの反動
bb_bounce	ボリンジャーバンド下限にタッチ	バンド下限からの反発
macd_signal	MACDラインがシグナルを上抜け	勢いの転換
volume_spike	出来高急増 + 陽線	大口の買いを察知
stochastic_reversal	ストキャスティクスが売られすぎから反転	短期的な反発

ショート（売り）戦略 – 6種

上記6種の逆バージョン（上抜け→下抜け、売られすぎ→買われすぎ、等）。
下降トレンドや天井圏で使用。

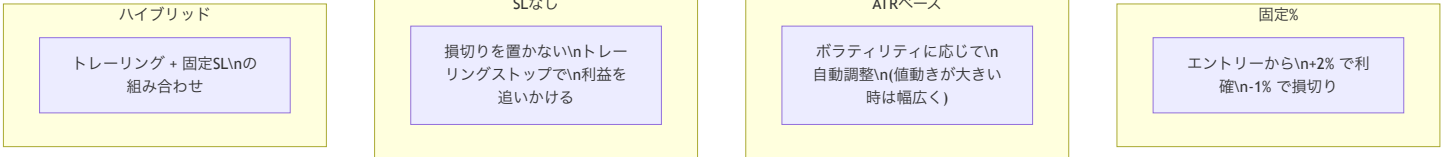
トレンド追従戦略 – 2種

テンプレート	何をするか
trend_pullback_long	上昇トレンド中の押し目で買い
trend_pullback_short	下降トレンド中の戻りで売り

各テンプレートはパラメータの範囲を持っており（例: 移動平均の期間を10～30で変える）、
全組み合わせを自動で試す。

決済戦略（Exit Profiles）

「いつ利確/損切りするか」のルール。エントリー戦略とは独立に設定できる。
全10種が用意されており、エントリー × 決済 の全組み合わせが自動テストされる。



決済戦略	利確	損切り	向いている場面
固定% (3種)	+2% 等	-1% 等	シンプルに使いたい
ATR (3種)	ATR×3 等	ATR×1.5 等	ボラが変わる銘柄
SLなし (2種)	なし	なし (トレーリングで管理)	利益を伸ばしたい
ハイブリッド (2種)	なし	固定 or ATR	バランス型

ATR（Average True Range）とは？

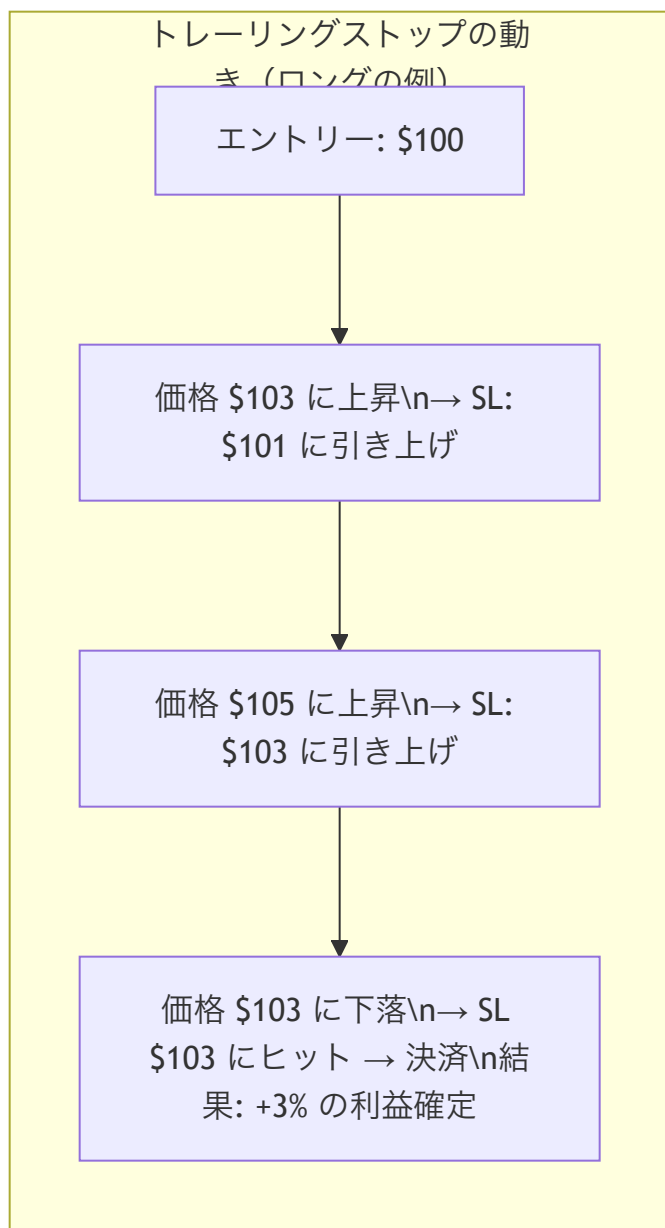
直近14本の平均的な値動き幅を測る指標。

- BTC が1日に \$2,000 動く時期 → ATR大 → TP/SLの幅も自動で広がる
- BTC が1日に \$500 しか動かない時期 → ATR小 → TP/SLの幅も自動で狭まる

固定%だとボラの高い時期にSLが狩られやすい問題を、ATRベースなら自動回避できる。

トレーリングストップとは？

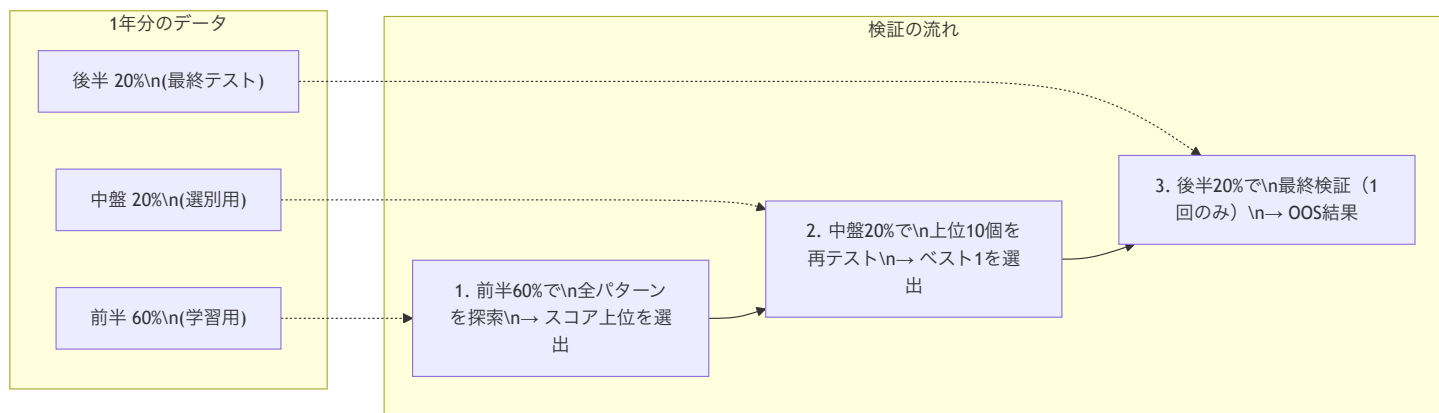
価格が有利な方向に動くたびに損切りラインも追従する仕組み。



利益が出ている間はポジションを持ち続け、反転したら自動決済。
固定のTPを置かないので、大きなトレンドに乗れる可能性がある。

OOS（Out-of-Sample）検証

「過学習していないか」を確かめる仕組み。このシステムの最も重要な機能。



なぜ必要か？

過去データで「たまたま上手くいった」戦略は、未来では通用しない。これが**過学習**。

例えば1,000パターンを試せば、偶然どれかは利益が出る。
それを「最強の戦略を発見した！」と信じてしまうのが一番危険。

データを3つに分け、最後の20%は一切チューニングに使わないことで、
「本当に未知のデータでも機能するか」をテストする。

結果	意味
OOS通過（Test区間で利益あり）	一定の信頼性がある
OOS不通過（Test区間で損失）	過学習の可能性が高い → 不採用

レポートの読み方

自動最適化後に生成されるレポートの見方。

推奨戦略ランキング

OOS通過率が高く、複数銘柄で有効な戦略が上位に来る。

見るべきポイント	意味
OOS通過率	高いほど信頼性あり（60%以上が目安）
平均PnL	OOS通過時の平均リターン

見るべきポイント	意味
銘柄数	何銘柄で有効だったか（多いほど汎用的）
期間一貫性	2024年と2025年の両方で有効か

Exit戦略比較

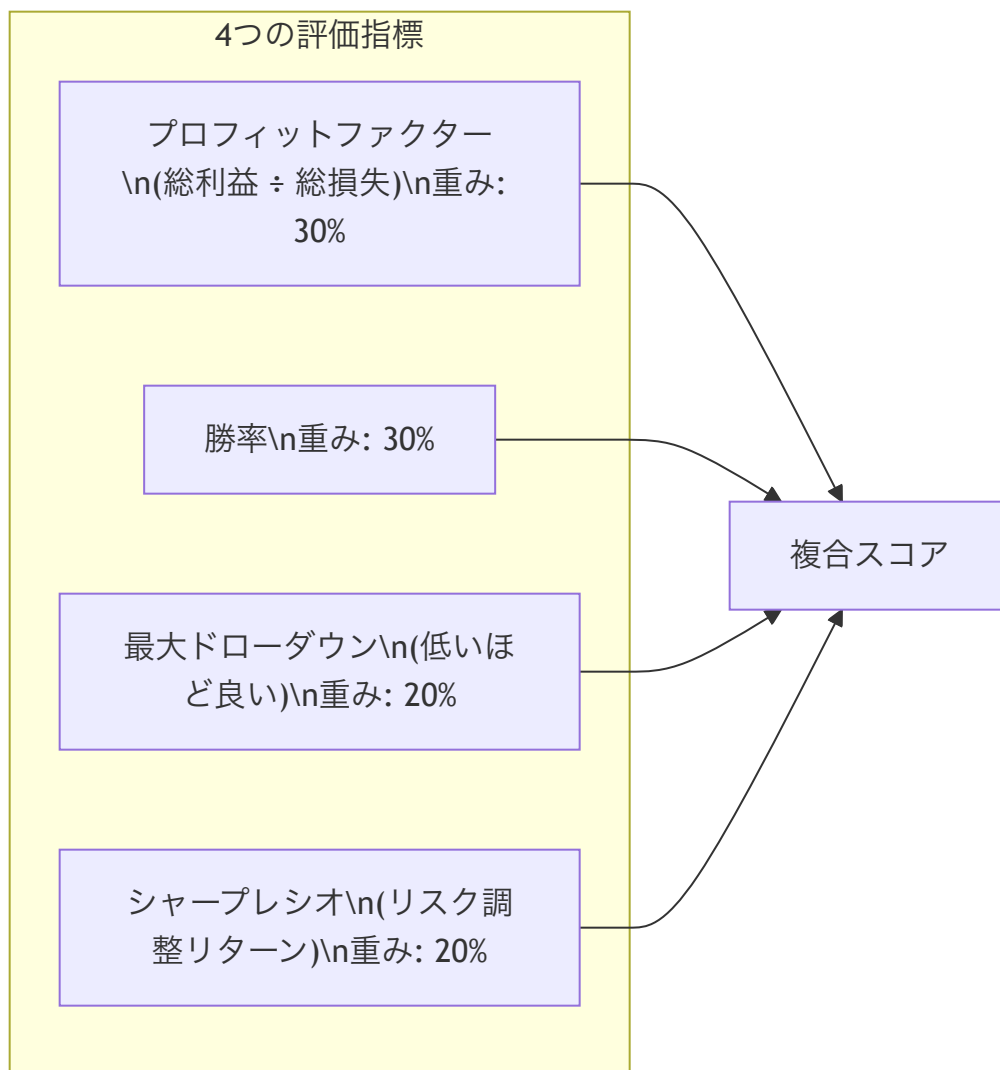
どの決済方法が全体的に良い成績だったかが分かる。
「固定%よりATRの方がOOS通過率が高い」といった傾向を見る。

レジーム別比較

上昇/下降/レンジのどの環境で、どの戦略が強いかが分かる。
一般に、上昇トレンドのロング戦略は過学習しやすい（上昇相場ならどんな買い戦略でも利益が出るため）。

スコアリング

戦略の良し悪しは4つの指標の加重平均で判定される。



指標	意味	良い値の目安
プロフィットファクター	利益÷損失。1以上で利益が出ている	1.5 以上
勝率	全トレード中の勝ち割合	50% 以上
最大ドローダウン	資産が一時的に最大何%減ったか	15% 以下
シャープレシオ	リスクに見合ったリターンか	1.0 以上

注意点

- **OOS通過 = 未来でも儲かる保証ではない。** あくまで「過学習でない可能性が高い」という意味。
- **レポートで上位の戦略でも、必ずリスクがある。** 少額からのテスト運用が推奨。

- **相場環境は変化する。** 2024-2025年で有効だった戦略が2026年でも有効とは限らない。定期的な再検証が必要。
- **バックテストには手数料・スリッページが含まれている**（片道0.04%）が、実際の約定はもっと悪い場合がある。