

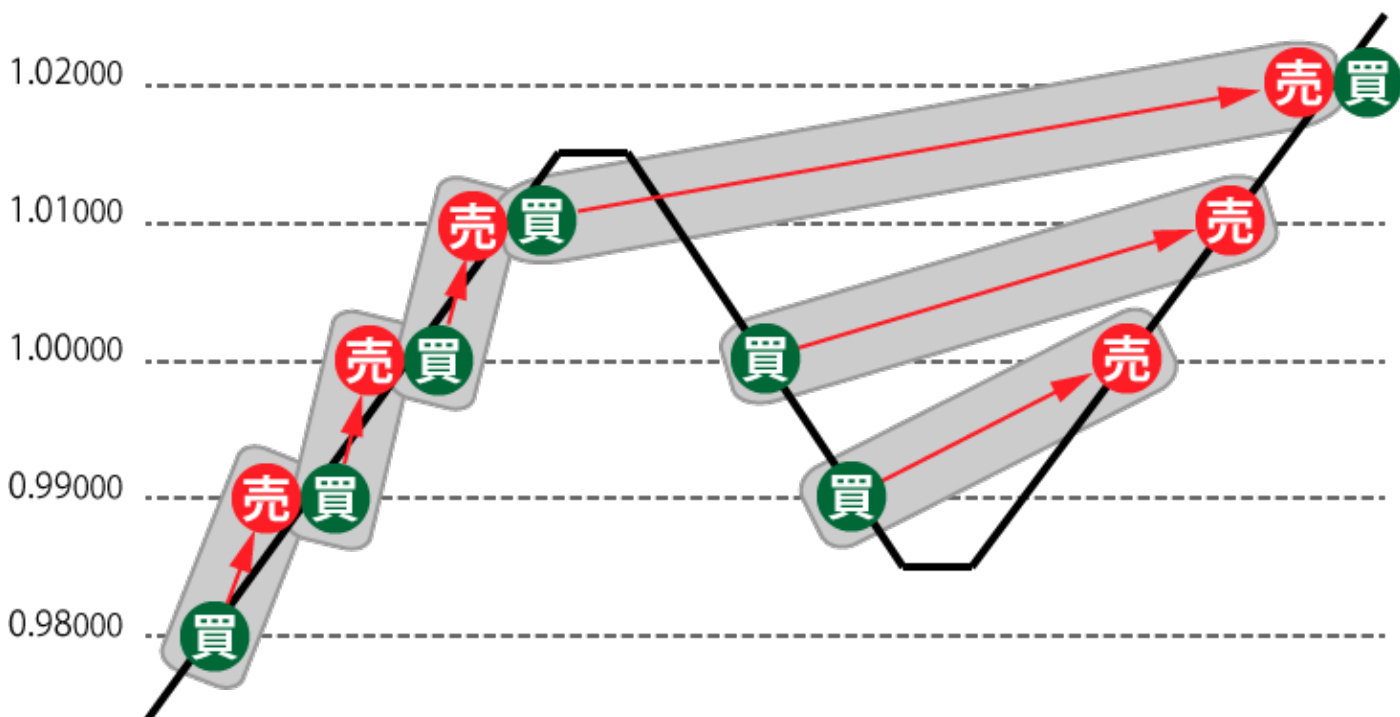
オートレンジトレーディング

ART (Auto Range Trading)

■概要

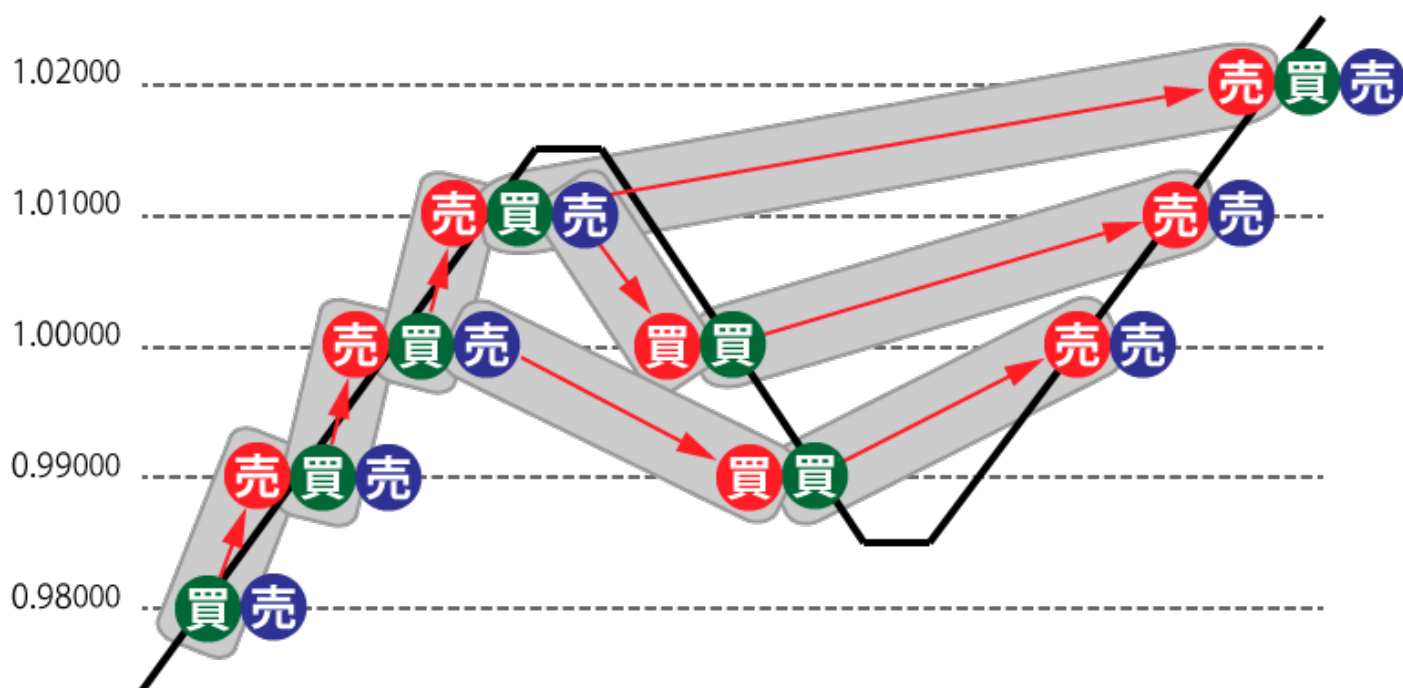
決められた価格帯の中で、規則的な間隔をレートが通過すると新規注文と決済指値(利食い)注文を実行します。決済注文が成立後、レートが再度、決済された規則的な間隔を通過すると、新規注文と決済指値(利食い)注文を実行します。価格帯は、固定と変動から選択します。これらが自動的に繰り返し行う連続注文プログラムです。

図: 新規注文を買いのみにした場合のイメージ



※新規注文を売りのみにした場合は、動作が逆になります。

図: 新規注文を買い売りの両方にした場合のイメージ



■新規注文

規則的な間隔をレートが通過すると新規注文を実行します。

順張りとは逆張りの区分なく、事前に決められた価格をレートが通過することで、新規注文が実行されます。

売買種別は、パラメーター[SellBuy]で、(1)買いのみ、(2)売りのみ、(0)買いと売りの両方、3つから選択し設定します。

事前に決められた価格で建つ最大ポジション数は、買い1つ、売り1つです。決済されると、改めてポジションが建つようになります。同じ価格で買いや売りポジションが2つ以上建つことはありません。

■決済注文

決済指値(利食い)注文を新規注文と同時に実行します。

決済逆指値(損切り)注文を新規注文と同時に行う機能は、ありません。

決済逆指値(損切り)注文を行う場合は、保有ポジションに対し手動で設定してください。

■手仕舞い機能

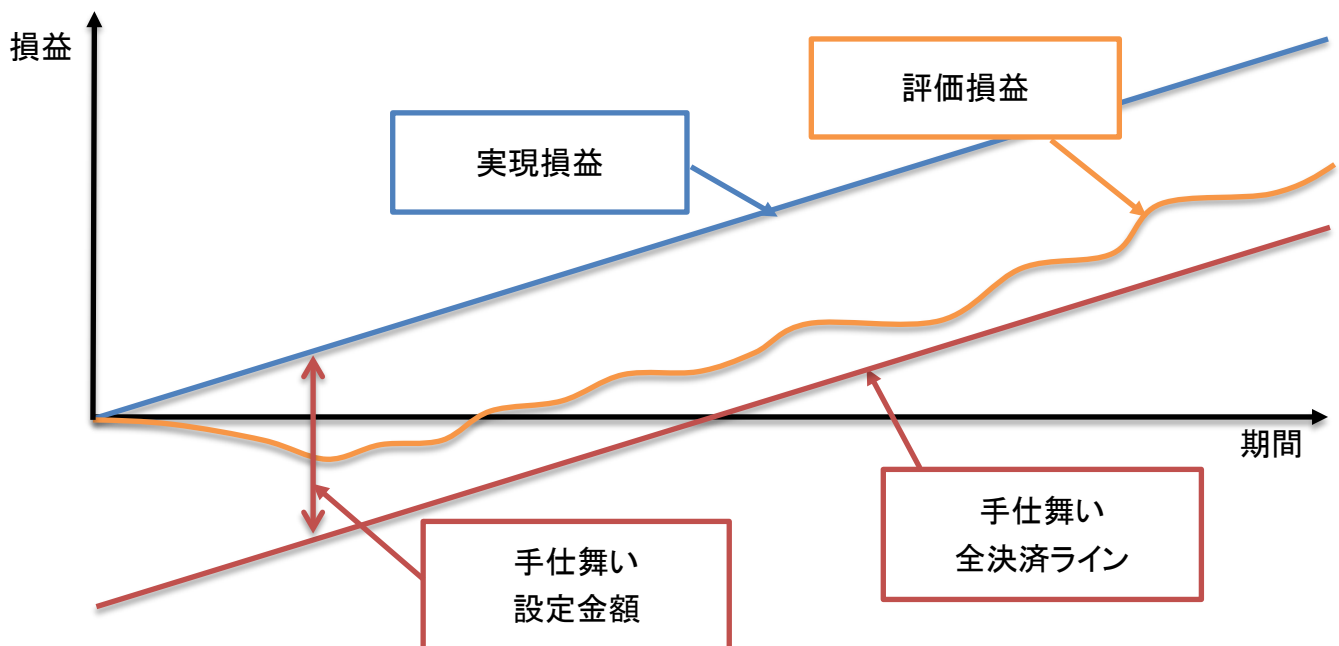
※手仕舞いとは、損失拡大を防ぐために保有しているポジションを決済することです。

図は、レンジ相場における ART 取引シミュレーションの損益イメージです。

実現損益は、確定損益です。これは、取引システムの総残高で確認できます。

評価損益は、保有ポジション(未決済注文)の損益を反映したラインです。これは、取引システムの有効証拠金で確認できます。

手仕舞い機能は、評価損益ラインが手仕舞いラインを下回ったら、自動的に保有ポジションを全て決済し、ART が停止する機能です。



※損益イメージ図は、実際のトレード結果ではありません。また、実際の取引結果を保証するものでもありません。

■新規注文を実行する価格帯の決定方法

・選択1

高低値を設定します。

レートが設定した高低値の中なら新規注文します。

レートが設定した高低値の外なら新規注文しません。

価格帯(高低値)は、固定となります。

・選択2&3

移動平均線(SMA or EMA)で、新規注文の価格帯(高低値)を決めます。

指定期間の移動平均線(SMA or EMA)の価格帯(高低値)を使用します。

価格帯(高低値)は、変動します。

・選択4

一目均衡表の雲(先行スパン1と2)の高低値を新規注文の価格帯(高低値)とします。

指定期間の雲(先行スパン1と2)の価格帯(高低値)を使用します。

価格帯(高低値)は、変動します。

■パラメーター

<基本設定>

[StartFresh] (初めての設定 True/同じ設定で継続 False)

True(有効) / False(無効)

週末のログアウト等、本 Algo プログラムの停止と再開に対応する機能です。

True(有効)の場合、

初めて本 Algo プログラムを実行する場合や、銘柄や設定を変更する場合は、True(有効)を選択してください。

開始の前に、保有しているポジションを全て自動で決済します。(本 Algo プログラムが建てたポジションのみ対象)

手動や他の Algo プログラムのポジションは、自動で決済されません。この場合、Algo の Log で決済できないエラーが繰り返し表示されます。Algo を停止し、保有ポジションをすべて手動で決済してから実行し直してください。

パラメーターの設定値がローカルディスクに保存します。保存は、「ParameterFileLocation(設定パラメーターの保存先)」で指定した場所です。以降、本 Algo プログラムは、ここで保存したパラメーターを参照します。

「True(有効)」で実行後は、手動や他の Algo プログラムの取引が可能です。但し、再度「True(有効)」で実行する場合は、手動や他の Algo プログラムの保有ポジションを全て決済する必要があります。

False(無効)の場合、

一度、「True(有効)」で実行して停止した本 Algo プログラムを同じ銘柄、同じ設定で継続実行する場合は、False(無効)を選択してください。すでに保有しているポジションは、決済されずに本 Algo プログラムが実行されます。手動や他の Algo プログラムのポジションも自動決済されません。

Algo 実行で設定したパラメーターと、ローカルディスクに保存されているパラメーター(ParameterFileLocation(設定パラメーターの保存先))が、一致しているかを確認し、一致の場合は、プログラムを実行します。不一致の場合は、プログラムを停止します。

[ParameterFileLocation] (設定パラメーターの保存先)

設定したパラメーターの保存場所とファイル名です。

※フォルダーの区切りは、「/」で記入ください。

例 C:/Algo/ART-USDCHF-Parameter.sav

※新しいフォルダーを設定する場合は、事前に新しいフォルダーを作成してから設定してください。

※パラメーターの「ParameterFileLocation」と「TradeFileLocation」は、異なるファイル名を設定してください。

※Windows10 の場合、C:(ルート)への保存ができません。サブフォルダーを設定してください。

[TradeFileLocation] (ポジション記録の保存先)

ポジションの記録ファイルです。

このプログラムは、本ファイルを参照し、ポジションの状況を把握しています。

※フォルダーの区切りは、「/」で記入ください。

例 C:/Algo/ART-USDCHF-Trade.sav

※新しいフォルダーを設定する場合は、事前に新しいフォルダーを作成してから設定してください。

※パラメーターの「ParameterFileLocation」と「TradeFileLocation」は、異なるファイル名を設定してください。

※Windows10 の場合、C:(ルート)への保存ができません。サブフォルダーを設定してください。

[Lots] (1取引の注文枚数)

1取引の注文量です。1~500の整数で指定します。

東岳証券のFXの場合、1枚が1万通貨単位です。

[AllStopRate] (終了する含み損合計額)

変動幅が拡大するなど含み損の合計が増加した場合、自動的に全ての保有ポジションを決済し、ART を停止する手仕舞い機能です。

許容する含み損合計額を設定します。

手仕舞い機能発動(全 ART ポジション決済 & ART 停止) = (口座総残高 - 設定値) > 有効証拠金

無効にするには、0(ゼロ)を入力します。

※自動決済の対象は ART が建てたポジションです。ART 以外が建てたポジション(裁量取引等)は自動決済されません。

※手仕舞い後、改めて ART をご利用になる場合、口座残高を ART の最小資金目安以上にしてから実行してください。

[KeepPositionsMaximum] (最大同時保持ポジション数)

最大同時保持ポジション数の上限値を設定します。

未決済注文のポジション数合計が設定値になると、新規注文が実行されなくなります。

全ての未決済注文のポジション(本 Algo プログラム、他の Algo プログラム、手動の注文などの全ポジション)数を保有ポジションと見ます。これら全てのポジションの合計が設定値になると、新規注文が実行されなくなります。

例:「最大同時保持ポジション数」が 1 で、本 Algo プログラムを2つ同時実行した場合、どちらか一方のポジションが建ったら、もう片方は、ポジションが建たなくなります。早くポジションを建てたプログラムが最大同時保持ポジション数の枠を使用できます。

[SellBuy] (売買種別(1=買,2=売,0=買 & 売))

新規注文を(1)買いのみ、(2)売りのみ、(0)買いと売りの両方、3つから選択し設定します。

[TPPoints] (利食い T/P ポイント(決済指値))

保有したポジションの利益が増加したとき、その利益を確定(決済注文)する設定です。利食い値をポイントで設定します。

新規注文が約定した直後に、そのポジションに利食いが設定されます。この利食い設定は、取引システムのサーバー側に設定されます。取引システムを稼働させている PC を停止しても、利食いは、有効です。

ポイント(points)とは、為替レートの最小単位です(1pip=10points)。米ドル/円の場合、50 銭が 500 ポイントです。

FX の場合は、150 以上の整数を設定してください。

無効にするには、0(ゼロ)を入力します。無効の場合、利食い設定しません。

[OpenOrderRatePoints1~10] (新規注文レート)

新規注文レートを 1~1000 Points で設定します。

ポイント(points)とは、為替レートの最小単位です(1pip=10points)。米ドル/円の場合、50 銭が 500 ポイントです。

最大 10 まで設定できます。0(ゼロ)の入力で無効となります。

例:USDJPY で以下のパラメーターを設定した場合

OpenOrderRatePoints1 = 300

OpenOrderRatePoints2~10 = 0

レートが 30 銭の場所になったら新規注文を実行します。設定値の 0(ゼロ)は、無効の扱いとなります。

... 110.300, 111.300, 112.300, 113.300, 115.300, ...

例:USDJPY で以下のパラメーターを設定した場合

OpenOrderRatePoints1 = 250

OpenOrderRatePoints2 = 500

OpenOrderRatePoints3 = 750

OpenOrderRatePoints4 = 1000

OpenOrderRatePoints5～10 = 0

レートが、25 銭、50 銭、75 銭、00 銭、の場所になったら新規注文を実行します。

設定値の 1000 は、00 銭の場所となります。

・・・ 100.250, 100.500, 100.750, 101.000, 101.250, 101.500, 101.750, 102.000, ...

例:EURUSD で以下のパラメーターを設定した場合

OpenOrderRatePoints1 = 250

OpenOrderRatePoints2 = 500

OpenOrderRatePoints3 = 750

OpenOrderRatePoints4 = 1000

OpenOrderRatePoints5～10 = 0

レートが_00250ドル、_00500ドル、_00750ドル、_01000ドルの場所になったら新規注文を実行します。

設定値の 1000 は、_01000ドルの場所となります。設定値の 0(ゼロ)は、無効の扱いとなります。

・・・ 1.00250, 1.00500, 1.00750, 1.01000, 1.01250, 1.01500, 1.01750, 1.02000, ...

<オプション設定>

[OptionNumber] (1=Price, 2=SMA, 3=EMA, 4=Ichimoku)

<1=Price で動作する設定>

新規注文を実行する範囲をレートで設定します。

設定した高値と安値の範囲内でレートが変動する場合に、新規注文を実行します。

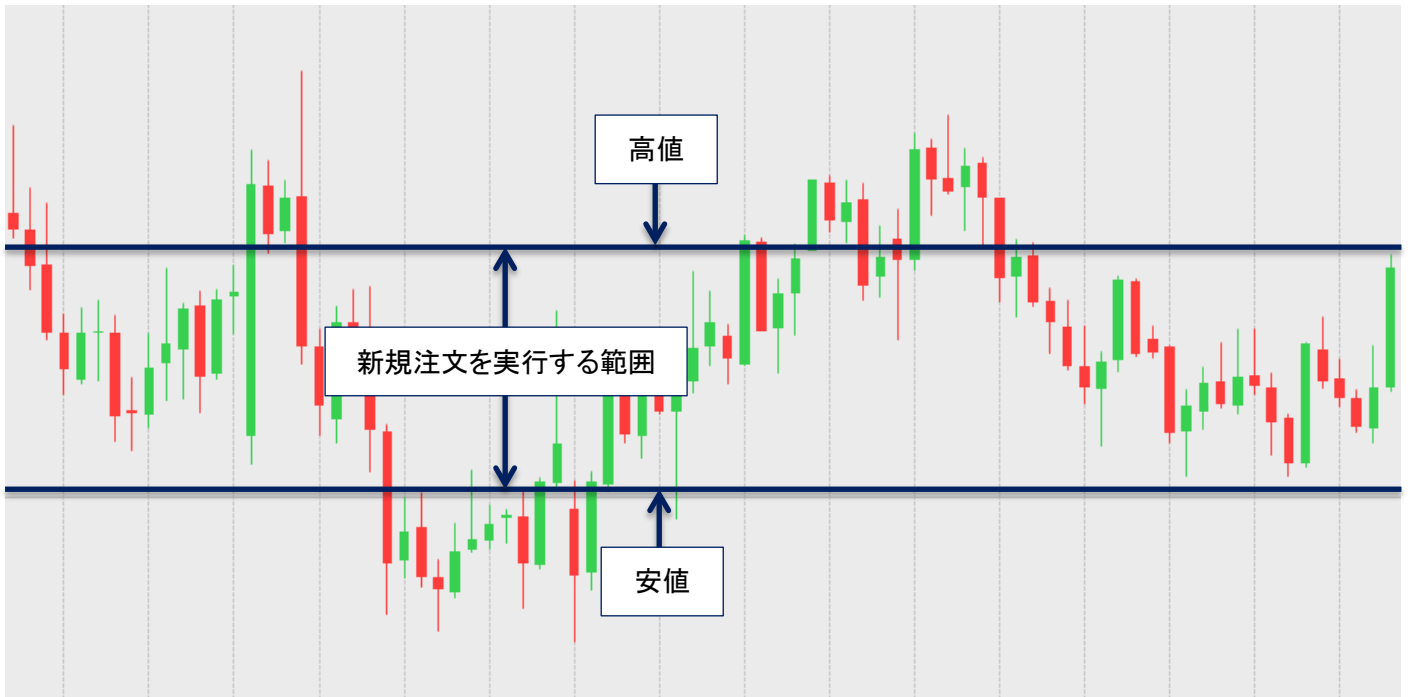
設定した高値と安値の範囲からレートが外れた(レートが設定高値より高い、レートが設定安値より低い)場合、新規注文は、実行されません。

[HighPriceRange] (レンジ高値(新規注文))

範囲の高値を設定してください。例:USDJPY で 120 円 50 銭を設定する場合、120.50 を入力します。

[LowPriceRange] (レンジ安値(新規注文))

範囲の安値を設定してください。例:USDJPY で 95 円 00 銭を設定する場合、95 を入力します。

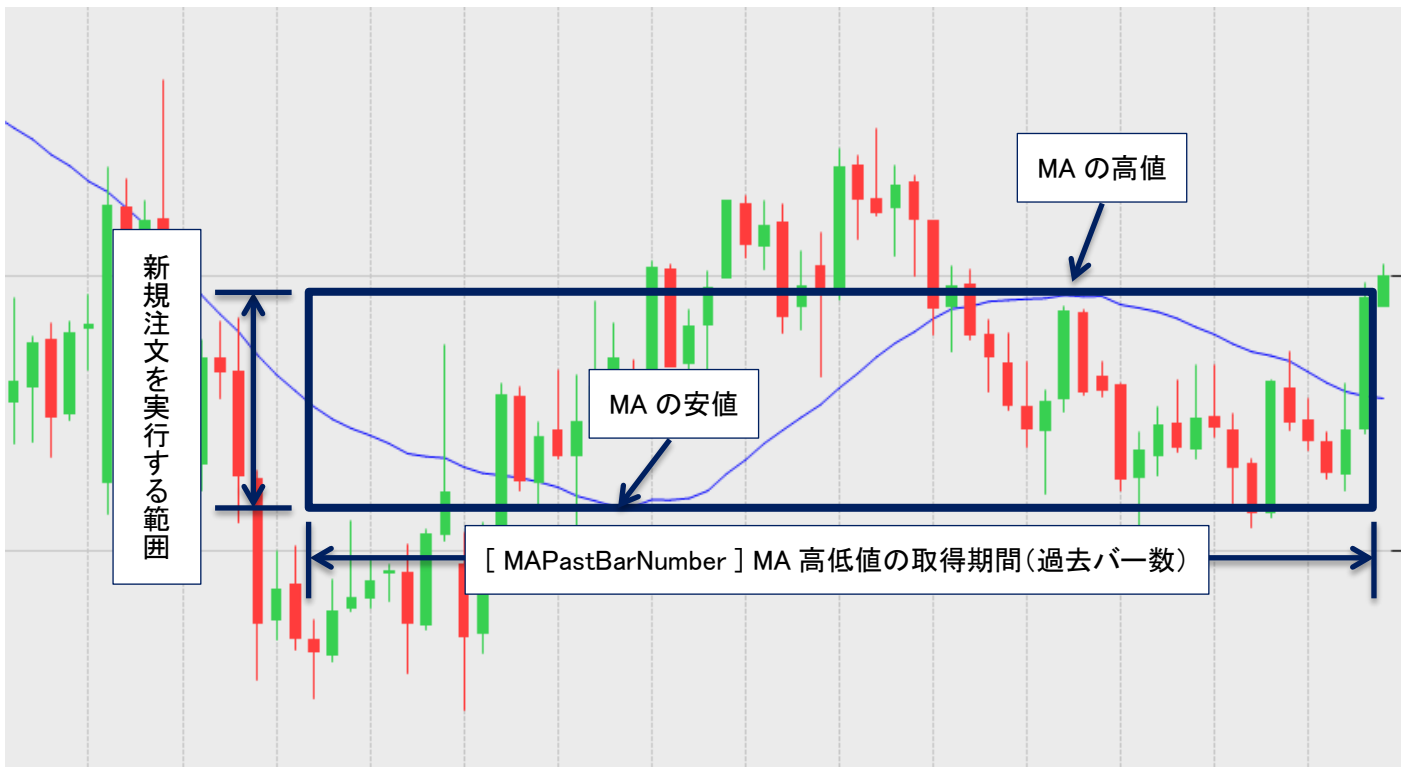


※Algo 始動画面で選択する時間軸の設定は、変更不要です。これは、テクニカル指標がある場合に影響します。

<2=SMA, 3=EMA で動作する設定>

移動平均線の高低範囲内で、新規注文が実行されます。

移動平均線の変化に合わせ、高低範囲が自動的に変化しつづけます。



[MAPeriod] (MA 期間)

移動平均線の期間を設定します。

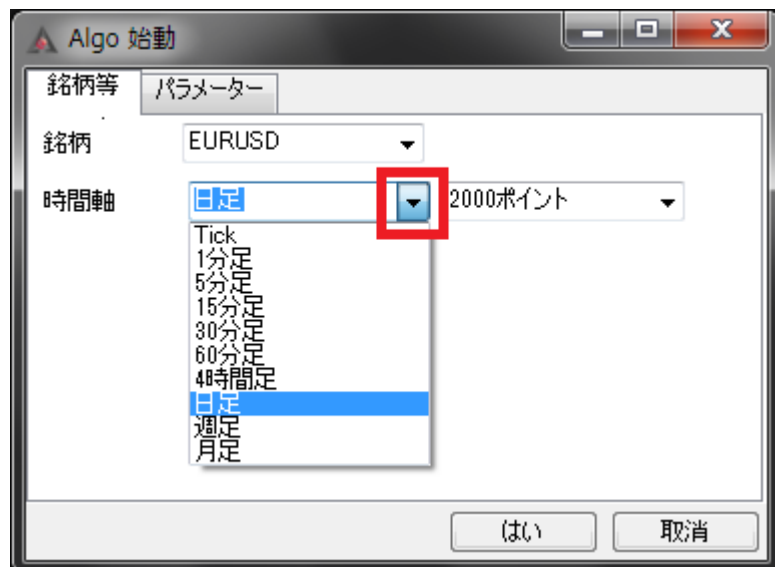
[MAPastBarNumber] (MA 高低値の取得期間(過去バー数))

移動平均線の高低値(新規注文を実行する範囲(高値と安値))取得期間を設定します。

チャートのバーの数で期間を設定します。1本過去(固定)から設定値の本数分の過去が取得期間となります。

2,000 以内で設定してください。

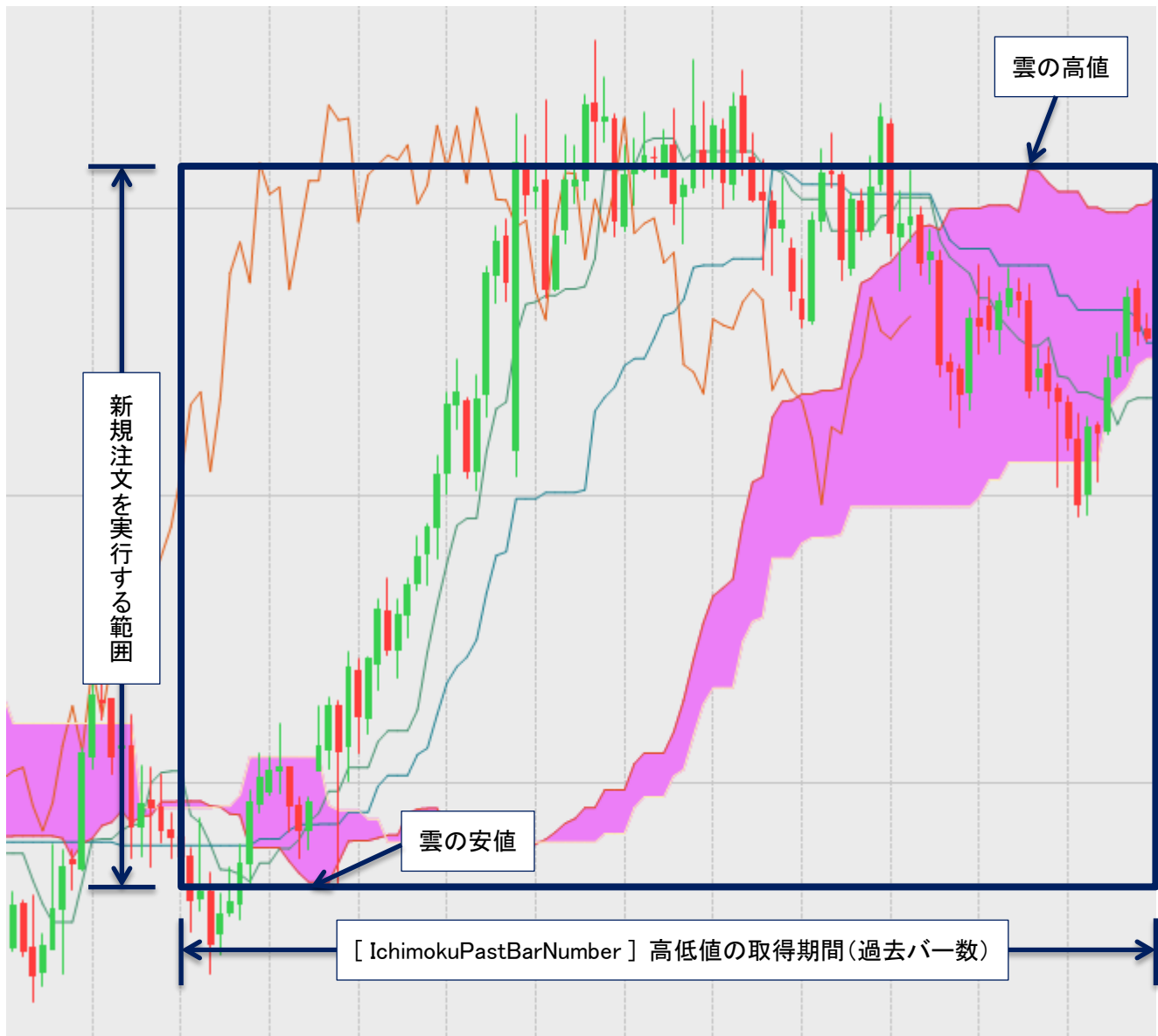
※テクニカル指標の時間軸設定は、Algo 始動画面で選択します。Tick 以外を選択してください。Tick では、エラーとなります。



<4=Ichimoku で動作する設定>

一目均衡表の雲の高低範囲内で、新規注文が実行されます。

一目均衡表の雲の変化に合わせ、高低範囲が自動的に変化しつづけます。



[TenkanSenPeriod] (転換線)

一目均衡表の転換線の値です。(初期値 9)

[KijunSenPeriod] (基準線)

一目均衡表の基準線の値です。(初期値 26)

[SenkouSpanBPeriod] (先行スパン 2)

一目均衡表の先行スパン 2 の値です。(初期値 52)

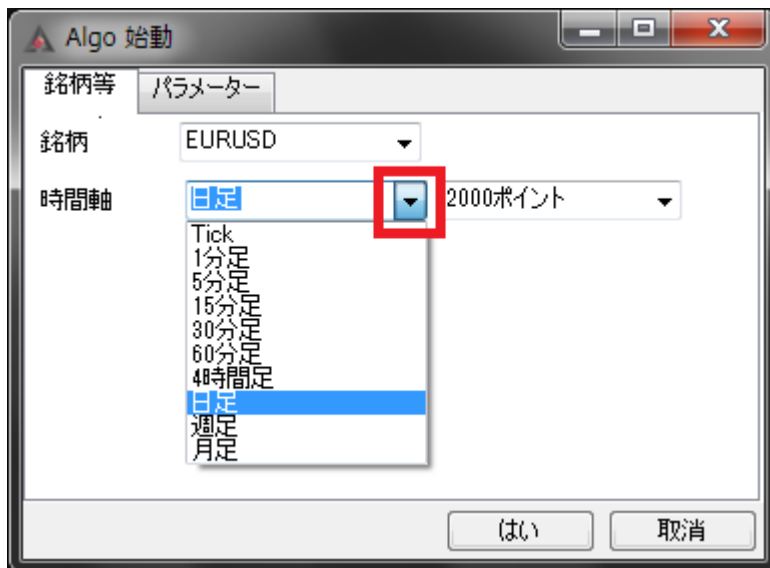
[IchimokuPastBarNumber] (高低値の取得期間(過去バー数))

一目均衡表の雲の高低値(新規注文を実行する範囲(高値と安値))取得期間を設定します。

チャートのバーの数で期間を設定します。

1 本過去(固定)から設定値の本数分の過去が取得期間となります。

※テクニカル指標の時間軸設定は、Algo 始動画面で選択します。Tick 以外を選択してください。Tick では、エラーとなります。



<その他>

[AcceptableSlippagePoints] (許容スリッページポイント)

スリッページとは、注文したレートと実際に約定したレートの差です。相場の変動が大きい場合等は、スリッページが発生する可能性があり、お客様にとって不利なレートまたは有利なレートで約定する場合があります。

スリッページ対策として、スリッページの限度幅をポイントで設定します。

ポイント(points)とは、為替レートの最小単位です(1pip=10points)。米ドル/円の場合、50銭が500ポイントです。

[OrderRetryIntervalSeconds] (新規注文非約定時リトライ間隔秒)

新規注文が約定しなかった場合の再注文間隔(秒)です。ここで設定した秒、新規注文が休止されます。

新規注文が約定しなかった場合は、改めて新規注文の条件が満たされたか判定し、条件成立で注文が実行されます。

30秒以上を設定してください。設定秒数が小さいと、同じ注文が複数約定する場合があります。

その他の仕様

[共通仕様(どの Algo プログラムでも共通した仕様)]

- ・本 Algo プログラムは、東岳証券の HorizonAuton でのみ実行します。
- ・本 Algo プログラムは、売買条件を満たすか常時監視するタイプです。ご利用にあたっては、取引システムをログイン状態で Algo プログラムを実行しつづけてください。
- ・HorizonAuton は、週末のマーケットクローズ後に取引システムのメンテナンスのため強制ログアウトします。Algo プログラムは、このログアウトで停止します。
- ・Algo プログラムの連続稼働は、最大 1 週間です。継続的にご利用する場合は、毎週月曜等に Algo プログラムを実行してください。
- ・Algo プログラムが停止するケース(Algo 実行画面の停止操作以外)として、Windows PC をシャットダウン、Windows がスリープ状態になった場合、HorizonAuton を「終了(ログアウト含む)」や「口座切替(FX 口座から商品口座へ切替など)」した場合、Algo プログラムが停止します。
- ・本 Algo プログラムは、Windows のファイル管理にてコピーや名前の変更ができます。初期値を変更しご利用になる場合は、コピーしたファイルをご利用ください。
- ・バックテストを行う場合は、当社ホームページ掲載のヒストリカルデータ(過去のレート データ 1 分足)をご利用ください。
- ・本 Algo プログラムの内部処理時間は、日本時間から-1 時間を基準に動作します。(例:日本時間 7:00/サーバー時間 6:00)これは、上級者の方が時刻に関する処理を行うときに考慮する必要があります。
- ・MT4 Magic Number に相当するパラメーターは、プログラム内部に組み込み乱数で付与しています。

[固有仕様(本 Algo プログラム固有の仕様)]

- ・本 Algo プログラムは、停止と再開の操作に対応しています。Algo プログラムを再開したとき、ポジションの保有状況を確認し、正常に作動するよう設計されています。
- ・本 Algo プログラムを停止した場合、新規注文が行われません。決済注文は、ポジションに指値が設定されます。取引システムをログアウトしても決済注文が行われます。
- ・本 Algo プログラムは、ひとつのみ実行を強く推奨します。
本 Algo プログラムを 2 つ以上、同時に実行する場合は、プログラムの仕様を十分にご理解された方のみ行ってください。初めての設定で、本 Algo プログラムを 2 つ以上、同時に実行する場合は、実行の開始を同じタイミングで行ってください。これは、本 Algo プログラム(1 つ目の実行)の保有ポジションがある場合、本 Algo プログラム(2 つ目の実行)が、本 Algo プログラム(1 つ目の実行)の保有ポジションを全て自動で決済するためです。(パラメーター[StartFresh](初めての設定 True/同じ設定で継続 False)の「True」が影響。) 同じ設定で継続利用の状況は、実行タイミングをずらせます。
- ・本 Algo プログラムは、手動売買と他の自動売買と条件付きで同時使用できます。但し、原則は、手動売買や他の自動売買との兼用を行わず、本 Algo プログラムのみの単体利用を推奨します。手動売買や他の自動売買と兼用利用は、プログラムの仕様を十分にご理解された方のみ行ってください。
- ・トレンドフォローイフダン(TFi)と同時使用した場合、トレンドフォローイフダン(TFi)の最大同時保有ポジション数の設定等が影響しトレンドフォローイフダン(TFi)側のポジションが建たなくなる可能性が大きいです。
- ・損切りを行う場合は、保有したポジションに対し手動で決済を行ってください。スマートフォンからも行えます。
- ・本 Algo プログラムが建てたポジションを本 Algo プログラム実行中に、手動で成行決済や、指値、逆指値設定ができます。手動決済した場合、本 Algo プログラムは、決済されたことを自動で認識します。スマートフォンからも行えます。
- ・建玉値(約定価格)は、相場の変動状況によりパラメーター[OpenOrderRatePoints1~10] (新規注文レート)で設定した値と、差が生じます。
- ・売り注文の建玉値(約定価格)は、パラメーター[OpenOrderRatePoints1~10] (新規注文レート)で設定した値から、ス

プレッドが引かれた価格が、基準値となります。

・FX で、「利食い」を設定する場合は、「150」以上を設定してください。

・CFD で、「利食い」を設定する場合は、最小値が銘柄により異なります。取引システムの指値注文で確認できる最小値の 1.5 倍以上を設定してください。

・Algo 始動画面で選択する時間軸のポイントは、原則 2000 ポイントを選択してください。Algo 始動画面で選択する時間軸のポイントは、Algo プログラムで使用するテクニカル指標の採用期間に、パラメーター[MAPastBarNumber] (MA 高低値の取得期間(過去バー数))を加えた数より大きい必要があります。

・テクニカル指標を使用する Algo プログラムは、Algo 始動画面で選択する時間軸が、テクニカル指標の時間軸となります。(Algo プログラムをチャートから実行した場合を除く)

・Algo 始動画面で選択する時間軸は、Tick 以外を選択してください。

・新規注文や決済注文は、Tick レートで判断されます。

・本 Algo プログラムは、現在バックテストには未対応です。パラメーター[OptionNumber] (1=Price, 2=SMA, 3=EMA, 4=Ichimoku)の「1」は、動作し、「2~4」は、動作しません。現在バックテストは、サポート外です。

Algo プログラムの実行方法

以下の手順で実行します。

- (1) HorizonAuton を起動します。
- (2) HorizonAuton 右上「Algo 実行」アイコンをクリックします。または、HorizonAuton 上部メニュー > ビュー > Algo 実行をクリックします。
- (3) 「選択 Algo」をクリックし、ダウンロードした拡張機能ファイルを開きます。
- (4) 「銘柄等を指定し実行」をクリックし青色にします。
- (5) 「実行」をクリックします。
銘柄や時間軸、パラメーターを設定します。
設定画面で「はい」をクリックすると、プログラムが開始します。
- (6) 実行画面に Algo プログラムの実行履歴が表示されます。
- (7) 終了方法は、「Algo 実行」画面の「停止」をクリックします。

以上

更新日

2017/10/16 手仕舞い機能を追加