

目次

オートトレーディング 基礎編

オートトレーディングとは？	2
ストラテジーの構築方法	2
CTL の変更方法	2
ストラテジーを DEALBOOK へ取り込む	2
バックテストの方法	3
ストラテジーレポート	5
実際にオートトレーディングを使っの取引	6

オートトレーディングとは？

オートトレーディングとは、チャートスタジオで構築されたストラテジーに従い、売買注文を自動的に発注するシステムです。ストラテジーはテクニカル分析やデータ分析をもとにチャートスタジオで構築することが出来ます。

ストラテジーの構築方法

ストラテジーを構築するためにはチャートスタジオを使用します。チャートスタジオを開くには、“ Start ” > “ All programs ” > “ Global Forex Trading ” > “ Chart Studio ” の順にクリックします。ユーザーガイド又は CTL programming language (以後、CTL) を開く場合には、“ Help ” > “ About ” の順にクリックします。

CTL の変更方法

ここではストラテジーを構築するに当たり、CTL 内の Number of Lots パラメーターを紹介します。ストラテジー構築には、一取引に建てる枚数を Number of Lots パラメーターを使い設定する必要があります。例えば、Number of Lots パラメーターに 3 を入力すると、ストラテジーの条件を満たした際に 300,000 通貨分の売買注文が自動発注されます。

デフォルトの CTL は次のようにプログラミングされています。

////////////////////////////////

```
strategy sample_ema1;
input period = 10;
vars ma(series);
begin
ma := ema(close, period);
if crossup (close, ma) then buy();
if crossdown(close, ma) then sell();
end.
```

////////////////////////////////

Number of Lots パラメーターを使い、取引枚数を 1 と入力した場合、次のようになります。

////////////////////////////////

```
strategy sample_ema1;
input period = 10, lots = 1;
vars ma(series);
begin
ma := ema(close, period);
if crossup (close, ma) then buy(lots);
if crossdown(close, ma) then sell(lots);
end.
```



上記 CTL の 2、6、7 行目には Number of Lots パラメーターが含まれています。6、7 行目の条件が満たされた場合に、2 行目の lots=1 に従い、売買が執行されます。(100,000 通貨単位が最小取引単位である口座の場合、100,000 通貨の取引となる。)

ストラテジーを DEALBOOK へ取り込む

チャートスタジオで構築したストラテジーを DEALBOOK へ取り込むためには、ストラテジー編集後、チャートスタジオ内で “ Build ” > “ Install Module ” の順でクリックします。もし、エラー表示がされない場合は成功で、すぐに DEALBOOK で利用が可能となります。

バックテストの方法

ここではストラテジーを使ってのバックテストの方法を紹介します。新しいモードでは過去のデータをオンラインでのログイン時に自動収集し、またそのデータを Local Storage という既存データベースに保管することが出来ます。しかし、オフラインモードではオンライン時に存在したデータしか使うことが出来ないのに注意が必要です。例えば、オンラインでのログイン時に USD/JPY の 45 分足チャートのみをレイアウト内に表示させておいた場合、オフラインモードでは USD/JPY の 45 分足チャートのみ使用できます。オフラインモードではサーバはもちろん、いかなるデータも取得することが出来ません。

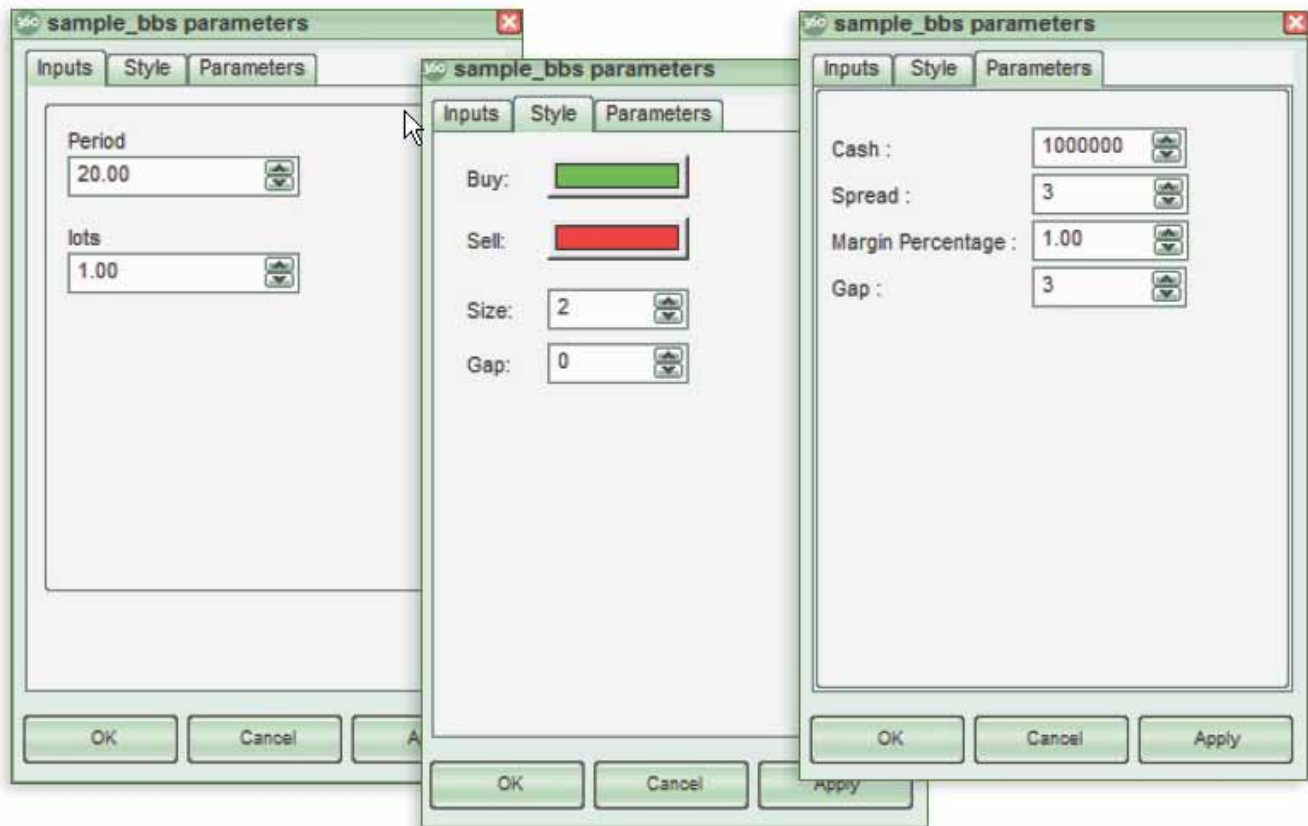
オフラインモードでログインするためには、ログインウィンドウで“ Offline Mode ”のチェックボックスにチェックを入れるだけです。ユーザーネーム及びパスワードを入力する必要はありません。



オフラインモードでログイン後にストラテジーをチャートに取り込みます。表示されているチャート内で右クリックをし、“ Add Strategies ” を選択、またはチャート上部にある “ Setup Strategies ” をクリックしますと新たなウィンドウが立ち上がりますので、その中から希望のストラテジーを選び、“ OK ”をクリックします。

“ OK ” をクリック後、いくつかのセッティングが必要です。(次ページ参照)

はじめに、Input タブでのセッティングです。ここではストラテジーに対して、取引枚数等を設定することが出来ます。(設定できる内容は各ストラテジーによって様々です。)



Style タブでは次のものを設定できます。

- Buy/Sell・・・チャート上に表示される売買シグナルの色の変更。
- Size・・・チャート上に表示される売買シグナルの大きさの変更。
- Gap・・・売買シグナルと足の終値との差の変更。

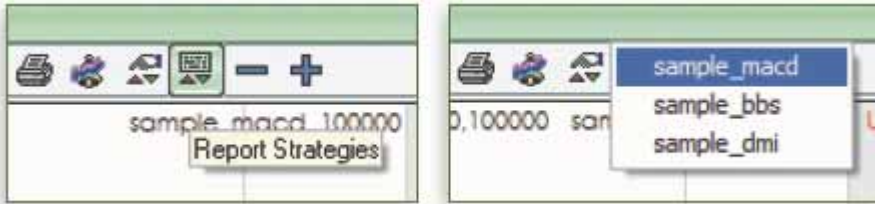
Parameters タブでは次のものを設定できます。

- Cash・・・バックテスト開始時の仮想保証金額の変更。
- Spread・・・バックテスト時の仮想スプレッドの変更。
- Margin Percentage・・・バックテスト時の仮想レバレッジ(マージン)の変更。
 - 2.00 = 2%
 - 1.00 = 1%
 - 0.50 = 0.5%
 - 0.25 = 0.25%

全てのセッティングが終了しましたら、“Apply”をクリックし、ストラテジーをチャートに取り込みます。

ストラテジーレポート

ここではバックテストの成績を見るためのレポートを紹介します。レポートではバックテスト期間内で取引されたポジションの一覧を見ることが出来ます。レポートを表示させるには、チャート上部にある “ Report Strategies ” をクリックし、希望のストラテジーを選びクリックします。



レポートの見方ですが、まず上部には、ストラテジーに対して設定した Input と Parameters が表示され、その下にバックテスト期間内で売買されたポジションの一覧が表示されます。下部には Strategy Statistics が表示され、取引回数、総利益、総損失、一取引における平均損益、最大ドロウダウン等を確認することが出来ます。

Strategy Statistics

Open position:
Flat, Volume : 0 , Price : 0.000000

Trades:		Average Net Profit:	Winning Trades Percent:
Buy:	1	USD -6.000000	0.00
Sell:	1		
Open:	0	Largest P/L:	Avg WinLoss Ratio:
Winners:	0	USD -12.000000	0.00
Losers:	1		
Neutral:	1	Largest Winners P/L:	Gross Profit:
Stop & Limit:	0	USD None	USD 0.000000
Exitlong:	0		
Exitshort:	1	Largest Losers P/L:	Gross Loss:
Total:	2	USD -12.000000	USD -12.000000
Max Consecutive:		Total P/L:	Profit Factor:
Winners	0	USD -12.000000	0.000000
Losers	1		
		Max Drawdown:	

Max Drawdown:
.....

Refresh Open Save As... Print Close Ready

実際にオートトレーディングを使つての取引

ここでは実際の取引口座でオートトレーディングを有効化する方法を紹介します。なお、実際に取引をする前に、バックテストを使つての動作確認をお勧めします。

実際の取引口座にストラテジーを取り込む方法は基本的に前述したバックテストの時と同様です。ただし、Parameters タブのみバックテストとは異なります。

Account・・・ストラテジーを取り込む口座番号を選択します。(取引口座を複数お持ちの場合。)

Max Lots・・・一取引に対する取引枚数を設定します。注：手動で売買注文を出した場合、ここで設定した取引枚数は適用されません。他にもオートトレーディング中に手動で注文を出すと、次の売買シグナル時に自動的に注文が出ないといった不具合が生じます。オートトレーディング中の手動操作にはくれぐれもお気をつけ下さい。

Strategy Modes

Demo・・・自動売買注文は出さずに、売買シグナルのみをチャート上に表示します。

Manual・・・Demo と同様で、売買注文は出ませんが、売買シグナルヒット時に注文を出すか出さないか選択できます。

Automatic・・・売買シグナルヒット時、自動的に売買注文を発注します。Manual と違い、事前確認が出来ませんのでご注意ください。

sample_bbs parameters

Inputs Style Parameters

Account : 273011 (USD) ▼

Max Lots : 1 ▼

Strategy mode

- Automatic
- Manual
- Demo

OK Cancel Apply

オンラインでログイン後のレポートは実際のオートトレーディング期間の取引内容のみとなります。(バックテスト時のような過去のレポートは表示されず、実際にオートトレーディングを開始した後のレポートのみとなります。)

注: オートトレーディング中にチャートの種類やタイムフレームの変更、またはログアウトやレイアウトの保存をした場合、有効だったストラテジーが取り消され、オートトレーディングはストップしてしまいます。ストラテジー自体はチャート上に存在していますが、売買シグナルが表示されなくなり、自動売買も出来ません。ストラテジーが無効になっている場合、チャート下部のスクロールバーやズームコントローラーの左側に警告が表示されますので、ご確認下さい。

ストラテジーを再度有効化するためには、チャート上部の“ Setup Strategies ”をクリックして下さい。Chart Strategies という新たなウィンドウが開きますので、前述の方法で再度セッティングを済まし、有効化させて下さい。

