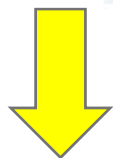




第2回 自動売買2つの利益改善策

システムトレードと自動売買の違い①

自動売買の定義とは
一定のルールを設定し
機械的な売買を行うツールを用いることで、
感情に左右されず粛々と取引を行うトレード方法
FX自動売買とはFXシステムトレードともいい、
FX取引を専用ソフトを使い
自動的に決められたルールに沿って運用する方法



簡単には、システムトレードを
プログラムに落とし込み、
自動的に売買が実行される状態を自動売買
と世間では指していることが多い



<https://fx-toha.ameblo.jp/posts/113>
<http://ings.schoolbus.jp/ix2club/ai/>
から5/7

システムトレードのロジックを持っている



そのまま、システムトレードのロジックを
プログラム言語で
自動売買に落とし込める！

システムトレードと自動売買の違い②

これは大きな勘違いです！

プロとしてトレード生活をしている方

“感覚的な部分”を残してる

経験！

感覚！

(システムトレードの例)

過去20日間の日足ローソク足の最高値を上抜けたら、買いエントリー実施

過去20日間の日足ローソク足の最高値から50Pips上で利益確定ライン

過去20日間の日足ローソク足の最高値から50Pips下で損失確定ライン

過去20日間の日足ローソク足の最安値を下抜けたら、売りエントリー実施

過去20日間の日足ローソク足の最安値から50Pips下で利益確定ライン

過去20日間の日足ローソク足の最安値から50Pips上で損失確定ライン

厳密化

条件下

上記のシステムトレードの例で言うと

“最高値を上抜けたら、”

と

“最安値を下抜けたら、”

という部分がプログラムに落とし込む時にはさらに厳密化・条件化が必要です。

数値化



システムトレードと自動売買の違い具体例

つまり、

- “上抜けた”というのは0.1Pipsでも上抜けた瞬間なのか？
 - “上抜けた”というのは5Pips以上、上抜けた瞬間なのか？
 - “上抜けた”というのは0.1Pipsでも確定したローソク足の何分足？の高値が？
上抜けしていると判明した後でなのか？
 - “上抜けた”というのは確定したローソク足の何分足？の高値が？
5Pips以上上抜けしていると判明した後でなのか？
 - “上抜けた”というのは確定したローソク足の何分足？の終値が？
5Pips以上上抜けしていると判明した後でなのか？
- というように数値で条件式に落とし込める必要があります。



【見落としがちなポイント】

自動売買では、
チャートを常に見ながら取引するシステムトレードとは違い、
厳密に数字に落とし込むことが必要

自動売買の落とし穴①

自動売買は**厳密に数字**に落とし込み取引ルールとしなければならない！

では、その数字はどのようにして決めるのか？

過去の相場の時系列データを使って、**勝率や利益率が高い数字**を割り出す。(これを最適化作業という)

条件化、プログラムにする為に必要なすべての数字を求める。人間がチャートを見ながら判断するというような、**曖昧な部分は一切残すことは出来ない！！！！**

相場は波である！ので常々その形を変える！



⇒

過去に通用していた数字は定期的に変更する必要がある！！

相場は波である！
常にその形を変える



自動売買の落とし穴②

【見落としがちなポイント】

自動売買は厳密な数字が必要！



その数字は過去の時系列データにもとづいて算出
しかし、相場は波であるので変形し続ける！



自動売買においては、(すべての)数字を
定期的に算出し直す必要がある！



だから、**定期的な最適化作業が必要**



落とし穴から脱却する4つのプラン

<自動売買を自分で作れない人はどうしたらいいのでしょうか？>

●1つ目は、
インヴァスト証券(シストレ24、トライオートFX)やひまわり証券(エコトレFX)などを使用する。

●2つ目は、
自動売買ロボットを販売されているサイトで購入する。

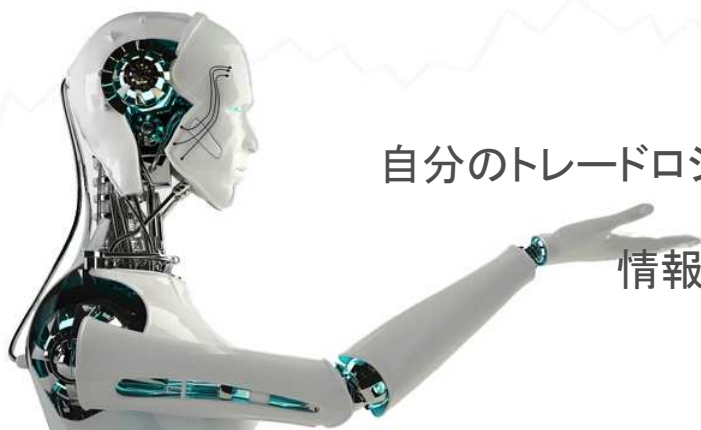
・システムトレードのテラス
<http://www.openterrace.jp/>

・FX-ON
<http://fx-on.com/>

・ゲムトレード
<http://www.gem-trade.jp/>

●3つ目は、
自分のトレードロジックがある人は、プログラマーに頼んで作製してもらう。

●4つ目は、
情報商材サイトで自動売買ロボットを購入する。



落とし穴から脱却するプランの一例

販売されている実際の自動売買をチェックしてみよう

fx-on.com

fx-on 投資家の承認をすべて済ませています。 決済手数料最安値!ご出品

投資サロン システムトレード (1) システムトレード株式 NEW! 電子書籍・ツール・インジ

投資ナビ+ NEW! 動画コンテンツ 投資クラウドソーシング リニューアル

TOP > システムトレード (2)

システムトレード検索 詳しく検索する

商品名・説明から検索 (スペースでAND検索) 検索

人気 NEW 高勝率 損小利大 コツコツ ドカンと 利益更新 右肩上昇 キャンペーン

計測期間 1ヶ月 3ヶ月 6ヶ月 12ヶ月 24ヶ月 全期間 (3)

かんたん検索 人気 NEW 高勝率 損小利大 コツコツ ドカンと 利益更新 右肩上昇 キャンペーン

検索結果: 2695件 ※表示された数値は選択期間における結果であり、商品ページの全期間表記とはズレが生じます。

1 2 3 4 5 6 次へ> 最終ページへ>

システム名	収益率	最大DD	リカバウンド率	勝率	期待損益	実績損益	PF	取引回数	計測期間
RijingLiteAUD	140.15%	11.40%	5.39	100.00%	49.31ドル	24,834.20ドル	-	566回	61ヶ月
BinaScal V10 EURUSD	97.41%	22.96%	2.38	71.65%	1.52ドル	4,141.11ドル	2.21	2,631回	61ヶ月

計測期間 1ヶ月 3ヶ月 6ヶ月 12ヶ月 24ヶ月 全期間

かんたん検索 人気 NEW 高勝率 損小利大 コツコツ ドカンと 利益更新 右肩上昇 キャンペーン

検索結果: 2707件 ※表示された数値は選択期間における結果であり、商品ページの全期間表記とはズレが生じます。

1 2 3 4 5 6 次へ> 最終ページへ>

システム名	収益率	最大DD	リカバウンド率	勝率	期待損益	実績損益	PF	取引回数	計測期間
RijingLiteAUD	140.15%	11.40%	5.39	100.00%	49.31ドル	24,834.20ドル	-	566回	62ヶ月
BinaScal V10 EURUSD	97.31%	22.94%	2.38	71.64%	1.52ドル	4,142.21ドル	2.21	2,634回	62ヶ月
taqosaku adx	93.56%	23.00%	2.68	35.77%	4.01ドル	3,032.13ドル	1.18	724回	62ヶ月
Skyfx_EA05_Ma2kairi_USDJPY	73.44%	28.53%	1.66	52.11%	2.90ドル	2,898.65ドル	1.14	923回	62ヶ月
Skyfx_EA22_24Trader_GBPJPY	68.58%	18.32%	1.96	37.54%	3.90ドル	2,593.58ドル	1.12	634回	62ヶ月
Skyfx_EA07_MACD_USDJPY	61.12%	21.42%	1.72	34.10%	1.74ドル	2,851.24ドル	1.12	1,557回	62ヶ月
DualZone5	52.29%	22.73%	1.32	32.13%	2.18ドル	1,967.11ドル	1.14	859回	62ヶ月
SmoothMAD1Long	61.18%	35.30%	1.68	39.56%	321円	184,979円	1.22	450回	62ヶ月
Skyfx_EA21_MaMaster_USDJPY	49.85%	26.35%	1.23	62.74%	2.86ドル	2,432.94ドル	1.14	789回	62ヶ月
taqosaku	46.10%	25.75%	1.04	32.32%	1.98ドル	1,975.52ドル	1.09	925回	62ヶ月

自動売買ユーザーの偏見①

＜実際に長期間稼働している自動売買を見てわかること＞

- ・ネットには、自動売買ロボットは**ドローダウンが10%以下が良い**と書いてあるが、**そのようなものは限りなく少ない**と思われること
- ・1ポジションで長期間良い成績で稼働する自動売買ロボットは無いと思われること
- ※「かななぎ」は定期的なパラメーターの変更を行っている！？
- ・長期間の間、少なくとも右肩上がりに見える自動売買は**複数ポジションエントリーロボット**である。



自動売買ユーザーの偏見②

＜実際に長期間稼働している自動売買を見てわかること＞

- ・自動売買ロボットはチャンスを見極めてエントリーするように設計されているので、**必ず1日1回取引するわけではない。**
- ・システムトレードと同じように、自動売買ロボットも、相場の波の頂点や底のピンポイントでエントリー出来るわけではない。
⇒システムトレードは人間の微調整がいつでも入れる。
- ・**パラメーターが全て公開されているわけではない**



自動売買ユーザーの偏見③

<実際に長期間稼働している自動売買を見てわかること>

- ・ロジックの全てが解説がされているわけではない
- ・バージョンアップを定期的にしてきているわけではない
⇒つまり、パラメーターは自分で変えないといけない。
⇒つまり、自分で最適化作業をする必要がある。
- ・EAの単価が下がってきているので、EAクリエイターの寿命は短い。



<最適化時>

自動売買の利益率を改善する極意①

相場の波は常々変化



最適なタイミングは常々変化



リスクを減らす為には、
相場に合わせたパラメーターの設定が必要

<フォロ



自動売買の利益率を改善する極意②

リアルで動かした時のスプレッドが広がらないのも大事！

<http://fx-on.com/spread/> から抜粋

■ スプレッド比較

High Avg Low USD/JPY

【見落としがちなポイント】

1週間でスプレッドはこのように激しく上下している。

MT4の最適化時は、スプレッドを固定して最適化を実施します。

⇒

固定したスプレッドとリアルのスプレッドの差が
無いFX会社で動かすことが大切！



※呑み行為を行っている業者もあるので、もちろん、そのようなFX業者では、当然勝ち続けることは出来ない！

利益率を改善する極意の具体例①

ヘッジファンドのストラテジーの成績を見てみましょう

インヴァスト証券のミラートレーダー から抜粋

MIRRORTRADER

Live

証拠金預託額 (¥) 0
評価損益 (¥) 0
有効証拠金 0
必要証拠金 0 (100%)
発注可能金 0 (0%)

USDJPY
Sell 112.49⁴ Buy 112.54¹

EURJPY
Sell 121.42⁶ Buy 121.48⁰

GBPJPY
Sell 142.55⁰ Buy 142.63⁷

AUDJPY
Sell 86.01⁸ Buy 86.08⁸

EURUSD
Sell 1.0791⁹ Buy 1.0796⁵

GBPUSD
Sell 1.2669¹ Buy 1.2677⁰

AUDUSD
Sell 0.7645⁰ Buy 0.7651³

建玉 見
ストラテジー検索
決済履歴
ウォッチリスト

マーケットベース
イマコレ
週間top100
カスタムフィルター

過去24ヶ月間

通貨ペア

取引回数

損益 (\$)

HF-Algoways_15

最大ドローダウン

リスクリターン率

損益(Pips)

T-Score

最大ポジション

勝率

フィルターを保存
リセット
検索


ストラテジー	T-Score	取引回数	損益(Pips)	最大ドローダウン	グラフ	★	追加
HF-Algoways_15 GBPJPY	5.91	54	157.70	-2,131.00		☆	+
HF-Algoways_15 EURUSD	0.00	44	124.00	-1,409.20		☆	+
HF-Algoways_15 USDCAD	0.00	42	2.90	-919.40		☆	+

利益率を改善する極意の具体例②

ストラテジー		T-Score	取引回数	利益(Pips)	最大ドローダウン	グラフ	★	追加
HF-Alpha_2	USDCAD	2.96	66	-451.90	-603.50		☆	+
HF-Alpha_2	GBPUSD	0.00	12	9.40	-95.40		☆	+
HF-Alpha_2	NZDUSD	0.00	38	-139.20	-374.80		☆	+
HF-Alpha_2	USDJPY	0.00	26	-270.60	-472.40		☆	+
HF-Alpha_3	EURCAD	6.64	74	167.10	-405.80		☆	+
HF-Alpha_3	NZDUSD	0.00	2	60.30	0.00		☆	+
HF-Alpha_3	USDJPY	0.00	2	56.20	0.00		☆	+
HF-Alpha_3	GBPCHF	0.00	46	-755.20	-755.20		☆	+
HF-Alpha_3	GBPUSD	0.00	8	-847.60	-847.60		☆	+
HF-Alpha_3	GBPNZD	0.00	46	-1,109.20	-1,111.00		☆	+
HF-Alpha_3	GBPJPY	0.00	40	-1,559.30	-1,559.30		☆	+
HF-AudaCity_6	USDJPY	7.73	80	108.30	-201.70		☆	+
HF-AudaCity_6	EURUSD	7.48	140	97.90	-318.90		☆	+
HF-AudaCity_6	AUDUSD	3.82	53	-321.80	-503.80		☆	+
HF-AudaCity_6	USDCAD	0.00	5	-275.80	-293.30		☆	+
HF-AudaCity_6	GBPUSD	0.00	47	-546.90	-575.50		☆	+

利益率を改善する極意の具体例③

HF-Barsap_3	NZDUSD	4.09	340	-2,490.20	-2,506.30		☆	+
HF-Barsap_3	EURUSD	3.99	313	-974.00	-1,178.50		☆	+
HF-Barsap_3	USDJPY	3.92	322	-622.60	-785.70		☆	+
HF-Barsap_3	GBPUSD	3.89	299	-2,345.30	-2,416.40		☆	+
HF-Barsap_4	USDJPY	4.11	273	-834.80	-869.60		☆	+
HF-Barsap_4	USDCHF	4.09	909	-6,877.80	-6,877.80		☆	+
HF-Barsap_4	GBPUSD	3.91	290	-2,483.80	-2,573.00		☆	+
HF-Barsap_4	EURUSD	3.63	311	-1,197.90	-1,200.00		☆	+
HF-IntelAgent_...	GBPUSD	4.65	269	-371.30	-746.90		☆	+
HF-Tribelet_13	EURUSD	8.44	128	1,471.60	-827.70		☆	+
HF-Tribelet_13	CADJPY	6.09	132	268.20	-1,155.70		☆	+
HF-Tribelet_13	AUDUSD	5.32	63	-454.90	-833.00		☆	+
HF-Tribelet_13	EURNZD	4.84	62	-1,577.40	-2,058.90		☆	+
HF-Tribelet_13	EURGBP	4.72	70	-512.80	-1,183.40		☆	+
HF-Tribelet_13	AUDCAD	4.56	72	-614.10	-1,129.30		☆	+
HF-Tribelet_13	EURAUD	4.29	142	-1,978.50	-2,555.00		☆	+
HF-Tribelet_13	AUDNZD	4.09	145	-1,850.30	-2,609.80		☆	+
HF-Tribelet_13	GBPJPY	0.00	9	-386.70	-647.20		☆	+



The screenshot shows a trading platform interface with the following data:

HF-Tribelet_13	T-Score	取引継続月	取引回数	Pips合計
EURUSD	8.44	21	128	1471.6

【見落としがちなポイント】

スプレッドが広いFX業者では、良いストラテジ！？でも苦戦する。
中途半端な！？ヘッジファンドでも取引回数と成績の両立は難しい。
良いストラテジーでも放ったらかしでは相場に通用しない。

日本のEAクリエイターは、
中途半端な！？ヘッジファンドよりも優秀である。

-4nn