

東岳証券

HorizonAuton Algo 拡張機能

トレンド フォロー イフダン マニュアル

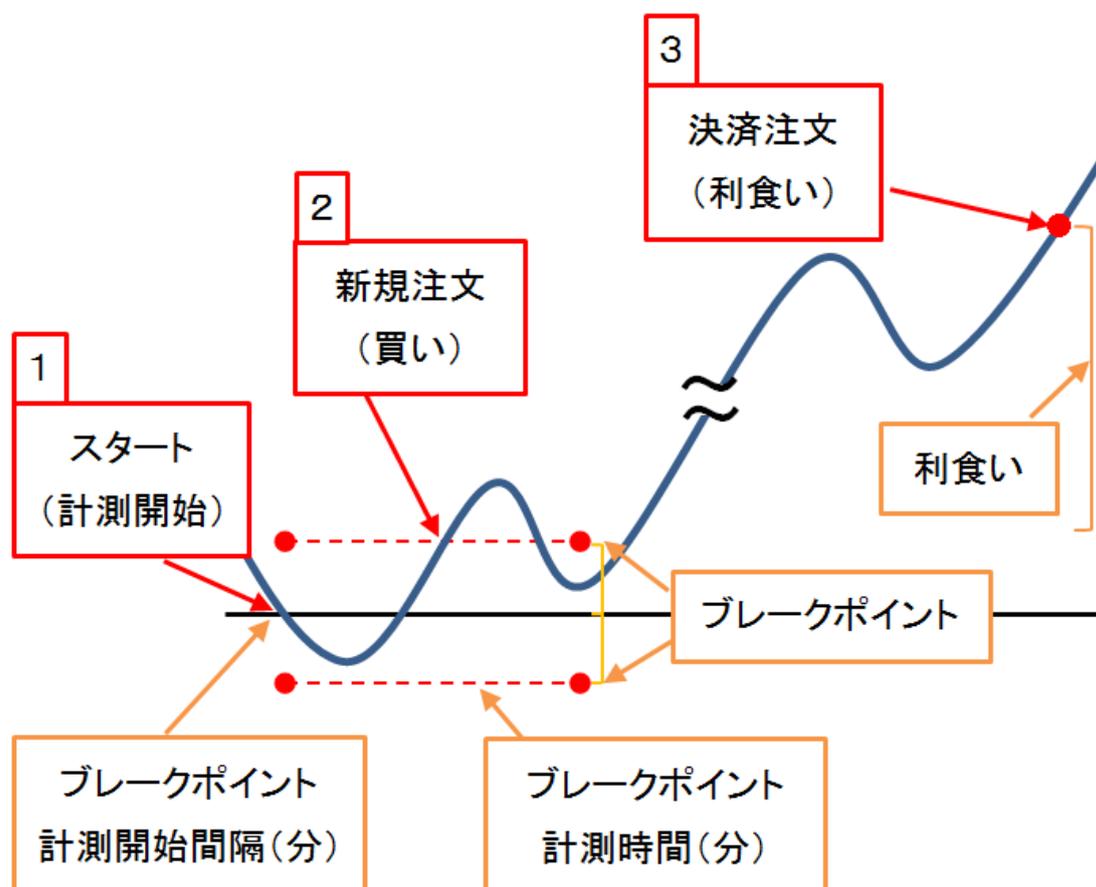
TFi (Trend Follow if Done)

概要

この拡張機能は、新規注文をトレンドフォロー（トレンドに順方向）、決済注文を指値と逆指値で行います。

新規注文は、事前に決めた時刻に、レートが動いた方向に注文します。

・動作の流れ(レート上昇の場合)



1. スタート

毎日 24 時間、設定した時刻(例:60 分間隔)にレートの変動を計測開始。

2. 新規注文

レートが動いた方向に(上昇・下降を判別)自動で新規注文を実行(上昇したら買い、下降したら売り)

3. 決済注文

自動で利食い、損切りを実行。

- ・図は、レートが上昇した場合のイメージです。レートが下降した場合も動作します。その場合は下降方向に売り注文から入ります
- ・新規注文の売買種別を選択できます。「買い」のみ、「売り」のみ、「買い」「売り」両方の3つから選択できます。
- ・決済注文の利食いと損切りは、事前に設定した値になったら自動で実行します。
- ・決済注文の利食いと損切りは、無効にもできます。

新規注文の条件

毎日 24 時間、設定した間隔(例 60 分毎)にレートの変動を計測します。

レートの変動が設定値に到達したら新規注文を実行します。

・買いポジション

計測開始間隔の時刻レートを記録します。このレートが上昇し、計測時間内にブレイクポイントに到達したら新規注文(買い)を実行します。

・売りポジション

計測開始間隔の時刻レートを記録します。このレートが下降し、計測時間内にブレイクポイントに到達したら新規注文(売り)を実行します。

決済注文の条件

・買いポジション

設定した利食い、損切りに到達したら決済注文を実行します。

・売りポジション

買いと同じ。

パラメーター

[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。

[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。未決済保持ポジションがない状態になったら、早くポジションを建てた方がポジションを持ちます。

1回の「ブレイクポイント計測時間(分)」で建つ注文は、「[Lots](1取引の注文枚数)」の設定値です。「最大同時保持ポジション数」が2の場合、次回のブレイクポイントで条件を満たすと、2つ目のポジションが建ちます。

[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。

[SLPoints] (損切り S/L ポイント(決済逆指値))

保有したポジションの損失が増加したとき、その損失を確定(決済注文)する設定です。損切り値をポイントで設定します。

新規注文が約定した直後に、そのポジションに損切りが設定されます。この損切り設定は、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、損切りは、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、損切り設定しません。

[MeasurementTimeIntervals] (ブレイクポイント計測開始間隔(分))

ブレイクポイントの計測を何分おきに実施するかの設定です。

毎日24時間、設定した間隔(分)に、ブレイクポイントの計測を開始します。

[MeasurementMinutes] (ブレイクポイント計測時間(分))

ブレイクポイントの有効時間を分で設定します。

レートが「ブレイクポイント計測時間(分)」以内に、「ブレイクポイント」にタッチすると新規注文が実行されます。

整数で1以上を設定します。

「ブレイクポイント計測時間(分)」は、「ブレイクポイント計測開始間隔(分)」以下を設定してください。

[BreakPoints] (ブレイクポイント)

ブレイクポイントとは、ブレイクポイントの計測を開始したときのレートを基準値として、レートが何ポイント変動したら、新規注文を実行するかの設定です。

例えば、200を設定した場合、ブレイクポイントの計測を開始したときのレートの上側に200ポイント、下側に200ポイントの「ブレイクポイント」が設定されます。

新規買い注文:ブレイクポイント計測開始時の買値レート + 「ブレイクポイント」以上になったら買い成行注文を実行。

新規売り注文:ブレイクポイント計測開始時の売値レート - 「ブレイクポイント」以下になったら売り成行注文を実行。

ポイント(points)とは、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、10以上の整数を設定してください。

[OrderIntervalMinutes] (次の注文迄に必要な時間の経過(分))

新規注文が建った後、次の新規注文を実行するまでに必要な時間経過(分)です。

この機能は、パラメーター[KeepPositionsMaximum] (最大同時保持ポジション数)を2以上に設定した場合、短時間の連続的な新規注文を避ける機能です。

新規注文と新規注文の間に入れる時間(分)を設定します。

[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されたレートの差のことです。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、逆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、他の Algo プログラムや手動売買と同時に利用できます。
- ・FX で、「利食い」または、「損切り」の片方のみを設定する場合は、「150」以上を設定してください。
- ・FX で、「利食い」と「損切り」の両方を設定する場合は、合計値が「400」以上になるよう設定してください。
- ・CFD の「利食い」と「損切り」の最小値は、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 プログラムの実行時に表示される設定画面の「時間軸」は、変更せず進めてください。「時間軸」を「Tick」にするとエラーが発生します。「Tick」以外を選択した場合、どれを選択しても本 Algo プログラムの動作は同じです。
- ・下記の表は、バックテストで当社ホームページ掲載のヒストリカルデータを使わず、バックテストのソース(過去のレート)をシステムで 2000 ポイントとした場合の、取引発生有無(目安)です。

○:取引回数 1 回以上あり。×:取引回数ゼロ。

TFi	1 分足	5 分足	15 分足	30 分足	60 分足	4 時間足
15	○	○	○	×	×	×
30	○	○	○	○	○	×
50	×	×	○	○	○	○

TFi	日足	週足	月足	Tick
15	×	×	×	×
30	×	×	×	×
50	×	×	×	×

※時間軸とポイント(期間)により、取引の発生有無が生じます。

※銘柄や相場の状況により取引の発生は変化します。

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:2017/9/19

対応バージョン:TFi (v1.3)