



FX Market Spider
動作内容解説書

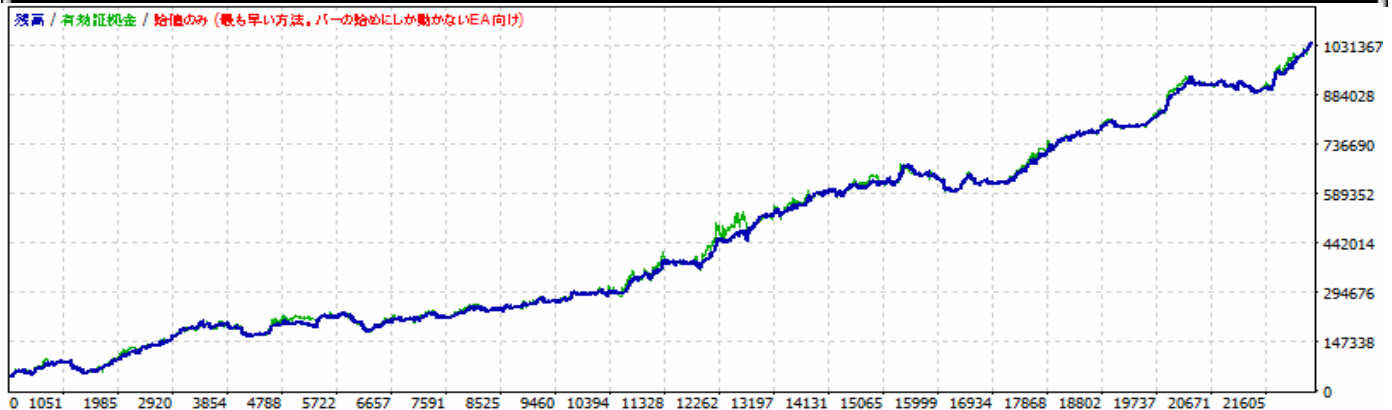
安全なEAとは

近年特殊な相場という事をよく耳にします。
 いったいどこが特殊で、どこが今まで通りなのでしょう？
 介入が入るからでしょうか？
 値動き幅が大きいからでしょうか？

一概に特殊とは言えません。
 月足だけ見れば、普通に動いているようにも見えます。
 ただし、1時間足や1分足をみれば過去に起きたことが無いような動きは多々あります。
 ですが、それが初めてであっても、いずれはそれも普通になりますし、過去の相場も多くの初めてを経験して今に至ります。

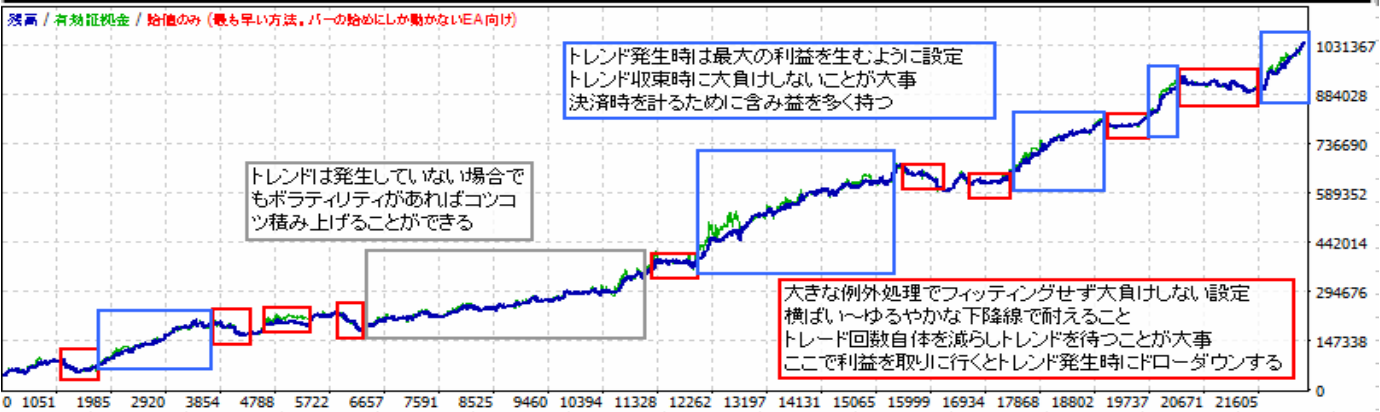
では、自動売買とはどうあるべきなのでしょう？

長年使っている自作の優秀なEA
 トレンドフォロー型でトレンド発生時を狙ったものです。
 日足・4時間足・1時間足でオーダーが出ます。



テストバー数	97481	モデルティック数	193909	モデリング品質	n/a
不整合チャートエラー	0				
初期証拠金	50000.00	スプレッド	1		
純益	991295.22	総利益	4281912.11	総損失	-3290616.89
プロフィットファクタ	1.30	期待利得	44.38		
絶対ドローダウン	5671.45	最大ドローダウン	87895.85 (12.83%)	相対ドローダウン	48.58% (48845.73)
総取引数	22335	売りポジション(勝率%)	10938 (60.86%)	買いポジション(勝率%)	11397 (62.99%)
		勝率(%)	13836 (61.95%)	負率(%)	8499 (38.05%)
	最大	勝トレード	17257.94	敗トレード	-8466.93
	平均	勝トレード	309.48	敗トレード	-387.18
	最大	連勝(金額)	90 (16081.36)	連敗(金額)	49 (-9834.16)
	最大	連勝(トレード数)	3791384 (69)	連敗(トレード数)	-25176.54 (19)
	平均	連勝	7	連敗	4

PFは1.3前後を維持し、ドローダウンも15%以下になっています。
 勝率も6割を超えて安定してトレードできるものです。

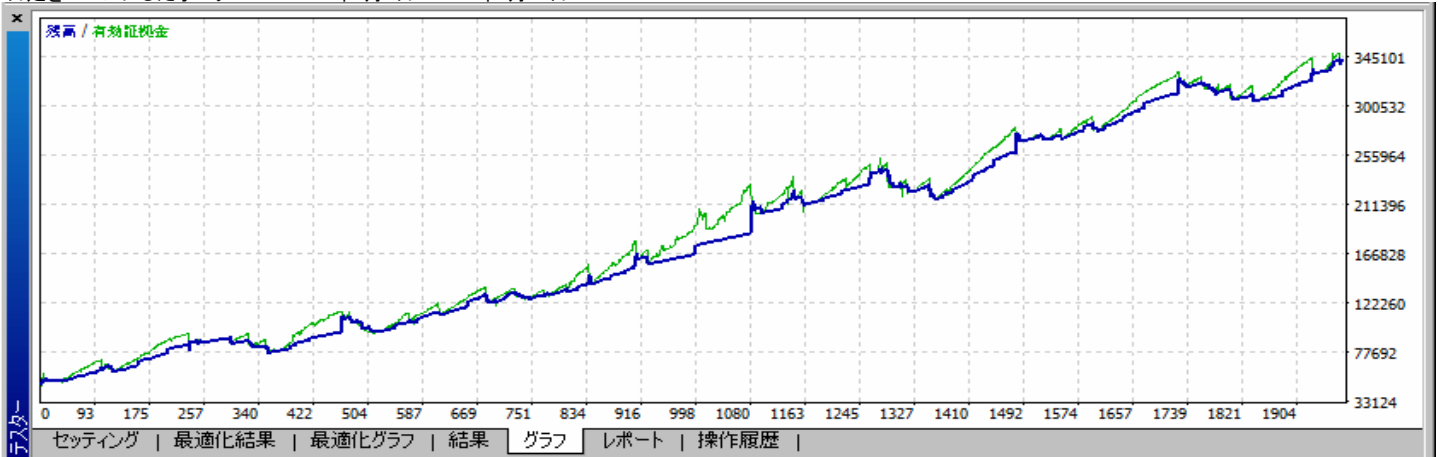


もちろんEAには得意相場と苦手相場が存在します。
 青い枠の部分が得意な相場で、トレンド発生時が非常に強いです。
 逆に赤い部分はトレンドがなかったり、反転直前の相場なので苦手ではありません。

それでも負け方と引き分け方が上手なEAは必ず利益を生みます。
 苦手な相場は必ずあるので、そこでの振る舞いが一番重要になります。
 全ての相場を得意にすることは不可能なのでトレンド発生時に最大の利益を生むようにしていくことが重要と考えています。
 ティンドがない切り替えしポイントで耐え、発生時に一気に利益を積み上げるのが理想的なトレードと言えるでしょう。
 ティンド収束時に大きなドローダウンを受けないことも重要なポイントになります。
 一方でトレンド発生時の出だしは多少のドローダウンがあってもリバウンド狙いなのでよしとしたほうが結果は良好です。
 これらを理解し、長期的に使えば必ず勝てます。
 ティンドのない切り替えし時期はティンドのある時期の約3分の1程度です。
 そこを耐えられるEAであること、トレンド時に確実に勝てるEAであことこの2点の条件を満たせば100%利益を積み上げていくことが可能です。
 派手な結果や無敗である必要はありません。
 それらは過剰な例外処理(オーバーフィッティング)や大きなリスクを伴う手法(ナンピン・マーチンゲール)がほとんどです。
 当たり前のシンプルな手法で資金管理が優れていれば確実に勝っていくことは可能だと断言できます。
 EAは結果だけにとらわれず、結果を生んだ相場の原因を見極めリスクを最小にすることが最重要項目といえます。

日足のオーダー

日足のオーダーをピックアップしてみました。
 日足をベースにしたオーダー 2001年1月1日～2016年7月28日



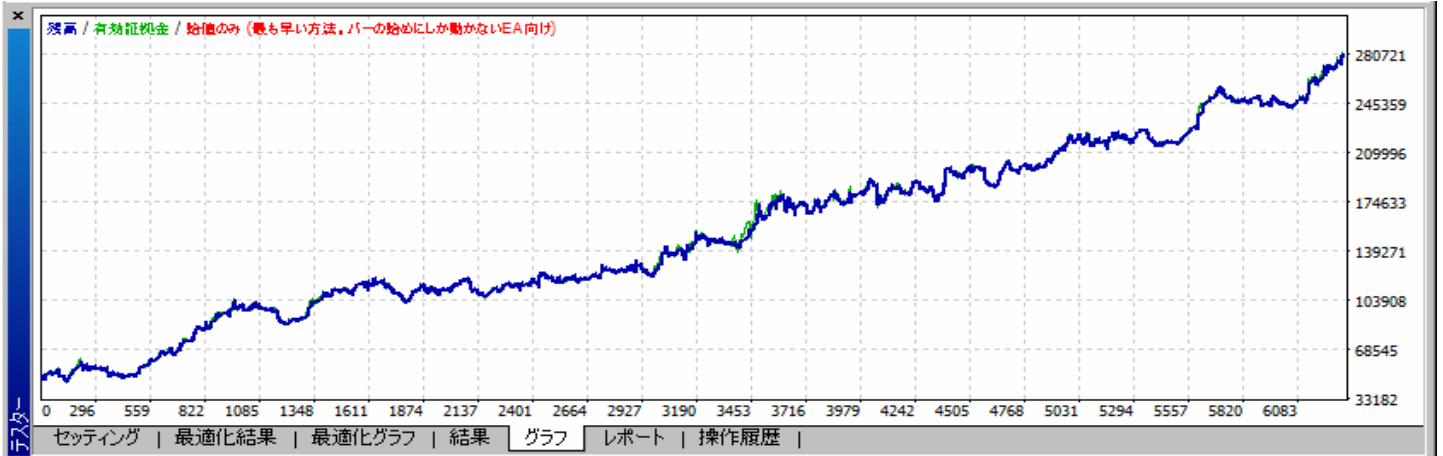
テストオーダー	テストバー数	97481	モデルティック数	193909	モデリング品質	n/a
	不整合チャートエラー	0				
	初期証拠金	50000.00			スプレッド	1
	純益	291405.63	総利益	566297.40	総損失	-274891.78
	プロフィットファクタ	2.06	期待利得	148.07		
	絶対ドローダウン	2206.60	最大ドローダウン	35591.10 (15.45%)	相対ドローダウン	21.29% (15168.21)
	総取引数	1968	売りポジション(勝率%)	959 (90.82%)	買いポジション(勝率%)	1009 (87.12%)
			勝率(%)	1750 (88.92%)	負率(%)	218 (11.08%)
	最大	勝トレード	14324.09	敗トレード	-7027.55	
	平均	勝トレード	323.60	敗トレード	-1260.97	
	最大	連勝(金額)	157 (56591.56)	連敗(金額)	7 (-4753.25)	
	最大	連勝(トレード数)	56591.56 (157)	連敗(トレード数)	-9277.88 (3)	
	平均	連勝	18	連敗	2	

日足で4つの手法ノーマル・セーフ・トレイリング・スマートの4種を混ぜた結果です。
 それらの説明は後述します。
 一番綺麗な右肩上がりです。PF2.0以上と最大ドローダウンを15%前後を維持しています。
 問題は187ヶ月で1968回のトレードと回数が少ないことです。
 月平均10回程度のオーダーしかありません。
 最小で月2回最大でも30回程度です。
 スマートモードの比率も高く157連勝があり、平均連勝も18回と安定度はあります。
 硬い所しかオーダーしない強みはありますが、何も無い月が多いのも特徴です。

- 得意
- 波の大きさ 大きめ
 - 波の速さ 遅め
 - パターン 緩やか
- 苦手
- 波の大きさ 小さめ
 - 波の速さ 早め
 - パターン 一気に伸びる

4時間足のオーダー

4時間足のオーダーをピックアップしてみました。
 4時間足をベースにしたオーダー 2001年1月1日～2016年7月28日



テストバー数	97481	モデルティック数	193909	モデリング品質	n/a
不整合チャートエラー	0				
初期証拠金	50000.00	スプレッド	1		
純益	230770.00	総利益	1155540.34	総損失	-924770.34
プロフィットファクタ	1.25	期待利得	36.69		
絶対ドローダウン	4901.81	最大ドローダウン	22743.08 (11.81%)	相対ドローダウン	24.65% (15289.05)
総取引回数	6289	売りポジション(勝率%)	3162 (62.68%)	買いポジション(勝率%)	3127 (63.38%)
		勝率(%)	3964 (63.03%)	負率(%)	2325 (36.97%)
	最大	勝トレード	6440.67	敗トレード	-5391.85
	平均	勝トレード	291.51	敗トレード	-397.75
	最大	連勝(金額)	52 (13795.32)	連敗(金額)	24 (-10563.58)
	最大	連勝(トレード数)	21450.80 (44)	連敗(トレード数)	-14304.47 (7)
	平均	連勝	5	連敗	3

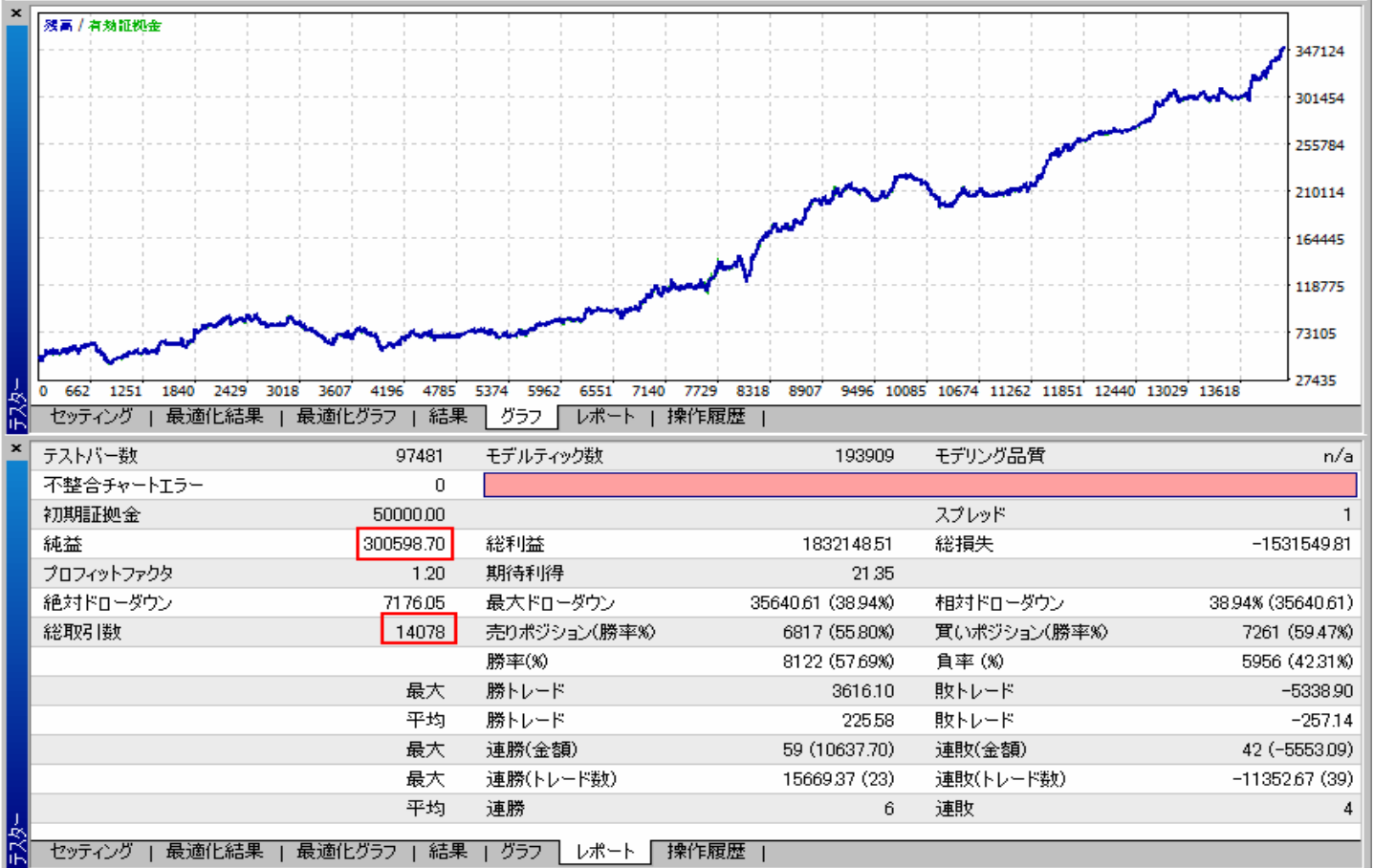
4時間足の最大の強みは最大ドローダウンが一番小さいということです。
 平均的に良く取れていますし、月や年での誤差が小さいという特徴があります。
 オーダー回数が増え、PFは日足よりは落ちます。
 月平均33回のトレードということで、ほぼ毎日オーダーがあるペースになります。
 勝ちトレードが負けトレードより20%大きく取りながら、勝率も10%高く、典型的な右肩上がりの結果になります。
 弱点も少ないですが、特徴的な強みも少ない足だといえます。

- 得意
- 波の大きさ大きめ
- 波の速さ 普通
- パターン 普通
- 苦手
- 波の大きさ小さめ
- 波の速さ 普通
- パターン 普通

1時間足のオーダー

1時間足のオーダーをピックアップしてみました。

1時間足をベースにしたオーダー 2001年1月1日～2016年7月28日



1時間足では14000回を超えるトレード回数で月75回程度のトレード回数になります。1日あたり2回程度です。

最終の純益は日足を上回ります。

取引回数が多いことからそれだけリスクも高くなり、最大ドローダウンも40%近くなり、PFも1.2程度です。

勝率も5割に近づき、大きな相場で大きく取って、上手に負ける手法になります。

リスクもリターンも大きくなる足だと言えます。

得意相場にめっぽう強く、苦手相場では少し負けがこむ傾向があります。

ただし、1万回を超えるトレードで安定して上昇しているの一番信頼できる結果だとも言えます。

得意

波の大きさ普通

波の速さ 早め

パターン 一気に伸びる

苦手

波の大きさ小さめ

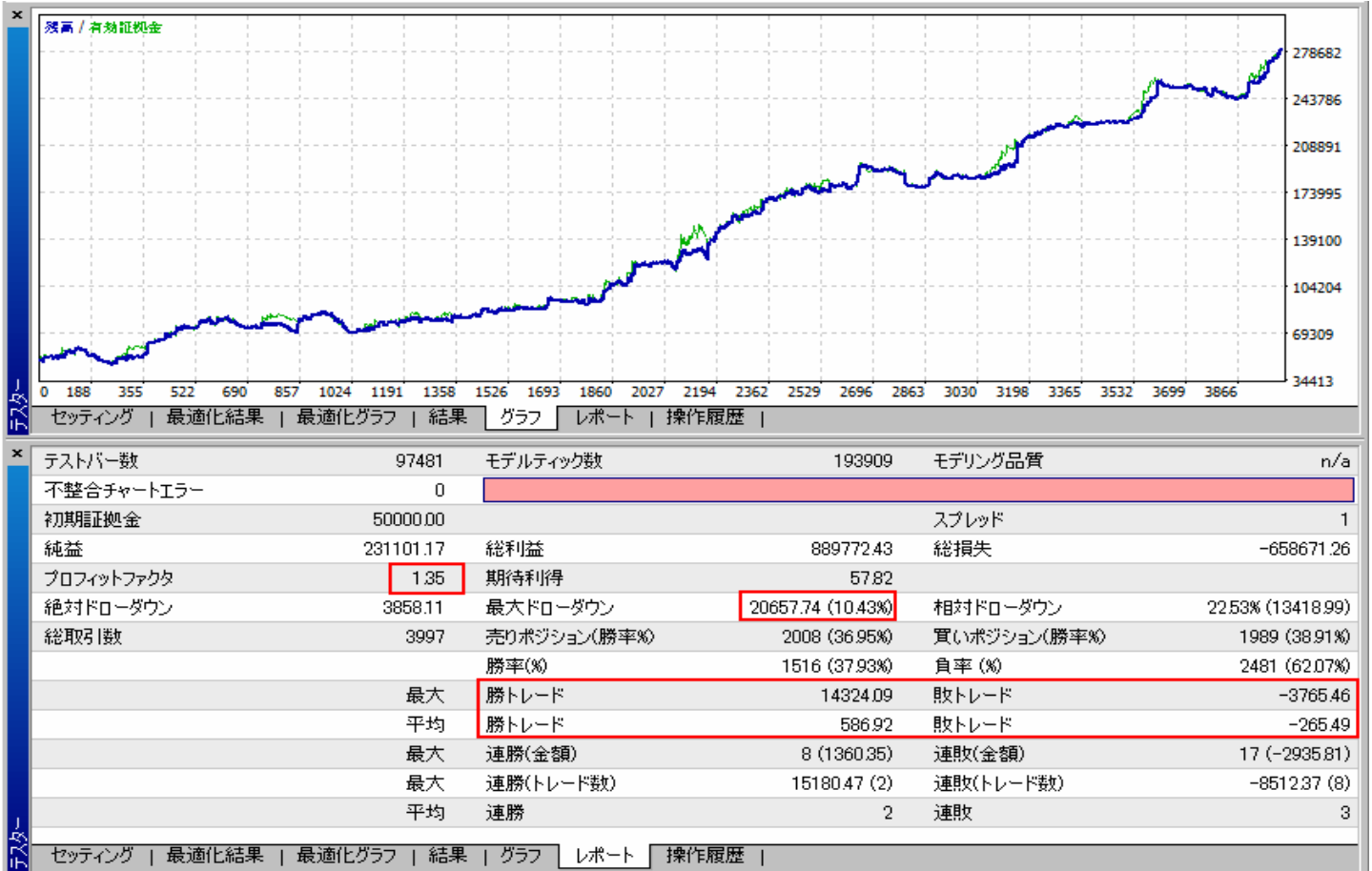
波の速さ 遅め

パターン 上下にゆれる

モード解説 ノーマルモード

各モードをご説明します。

ノーマルモードでの日足4時間足1時間足 2001年1月1日～2016年7月28日

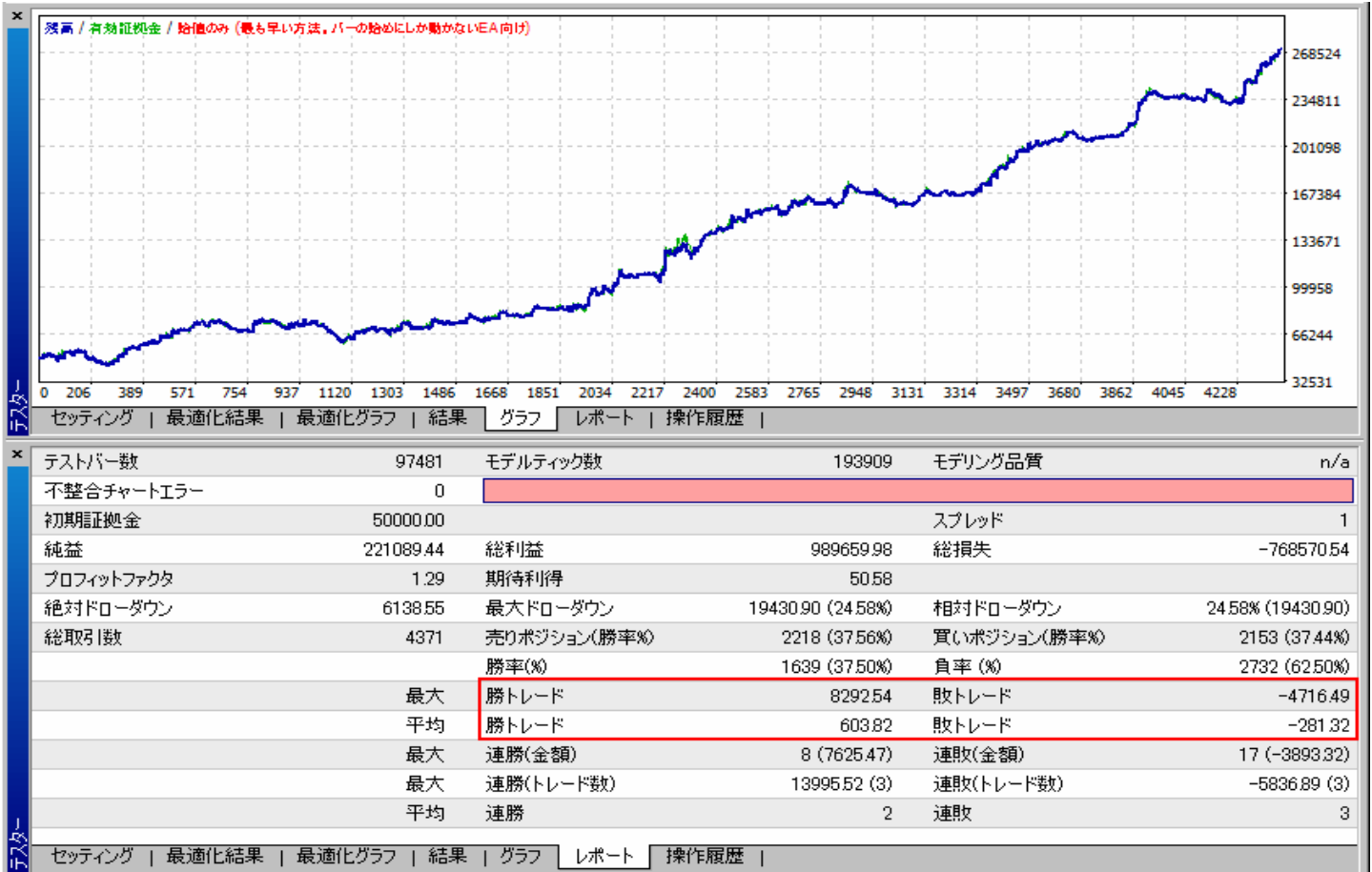


ノーマルモードの日足・4時間足・1時間足を混ぜた結果です。
 ノーマルモードではオープンサインでオーダーして、クローズサインでクローズするシンプルなオーダーです。
 PFも1.35を維持し、ドローダウンも10%程度と非常に優秀です。
 平均的に1回で大きく勝ち、小さく負けるを繰り返します。
 勝ちトレードは負けトレードの2倍以上の勝ち幅を維持しますが、勝率は4割弱程度です。
 計算上は綺麗な右肩上がりになりますが、苦手相場も顕著な手法です。

- 得意
- 波の大きさ大きめ
- 波の速さ 普通
- パターン 普通
- 苦手
- 波の大きさ小さめ
- 波の速さ 早め
- パターン 上下に揺れる

モード解説 セーフモード

セーフモードでの日足4時間足1時間足 2001年1月1日～2016年7月28日

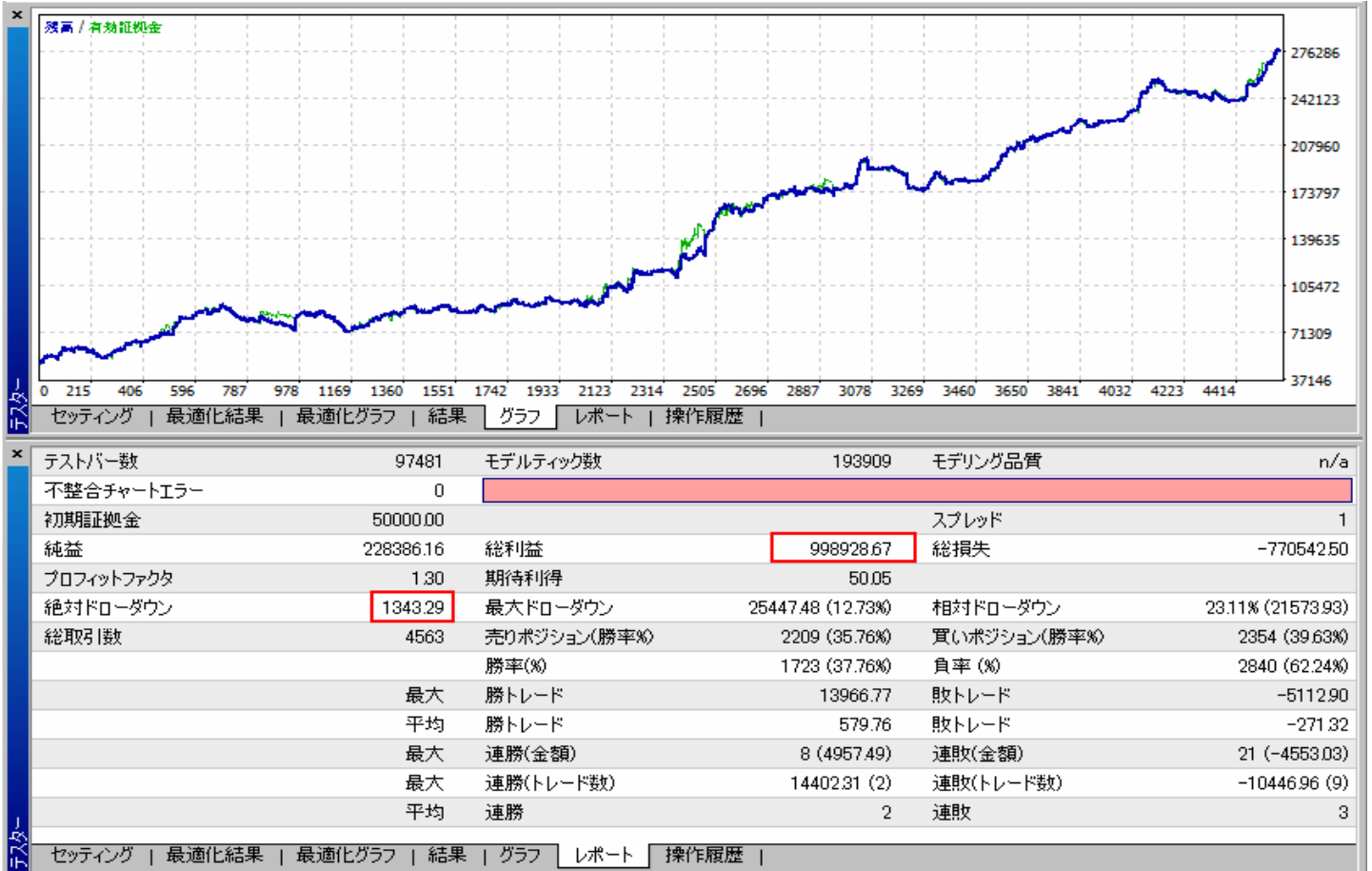


セーフモードの日足・4時間足・1時間足を混ぜた結果です。
 セーフモードではオープンサインでオーダーして、クローズサインでクローズするシンプルなオーダーにS/LとT/Pを必ず設定するオーダーです。
 S/Lを入れても大きく動いたときに大きな最大ドローが入る時があるので、急相場でのリスクを軽減とまではいきません。
 セーフモードの最大の売りは最大の勝ち幅は減るものの、安定して勝ちトレードの勝ち幅を維持できる事と、負け幅を維持できることです。
 なので、計算されたほしい利幅を確実に確保しつつ、負けてよい幅で負ける事が最大のメリットです。
 ノーマルモードよりもアップダウンが減り、均一化された結果になります。

- 得意
- 波の大きさ普通
- 波の速さ 遅め
- パターン 緩やか
- 苦手
- 波の大きさ小さめ
- 波の速さ 早め
- パターン 一気に伸びる

モード解説 トレイリングモード

トレイリングモードでの日足4時間足1時間足を混ざった結果です

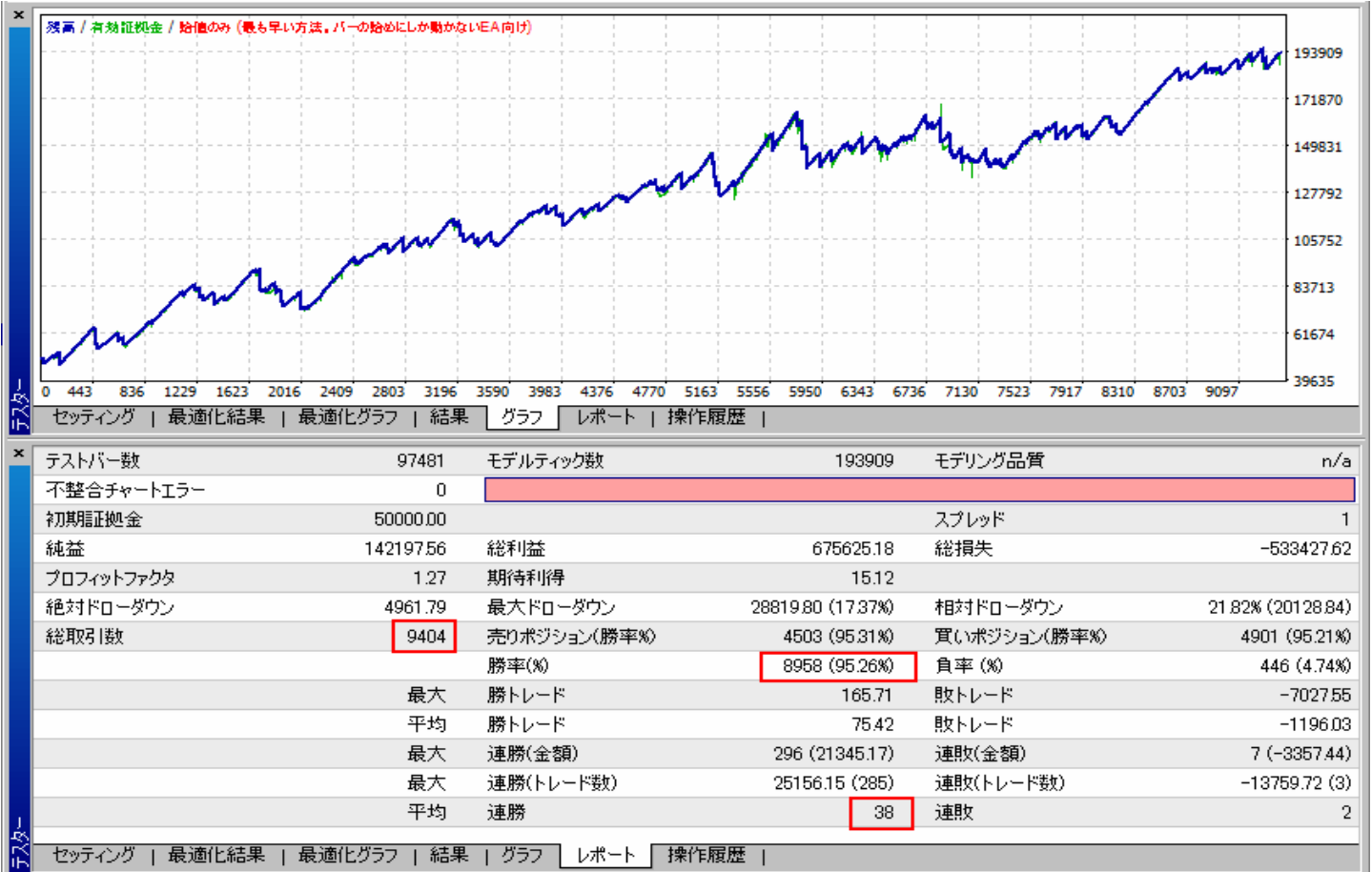


トレイリングモードの日足・4時間足・1時間足を混ぜた結果です。
 トレイリングモードではオープンサインでオーダーして、クローズサインでクローズする中でトレイリングストップを入れるオーダーです。
 大きく動いた時に、最低限の利幅を確保しつつ攻める手法になります。
 総利益はノーマルモードやセーフモードよりも多くなります。
 その分損失も大きいのですが、かなり攻撃的な手法で、勝てる相場では一番利益を出すオーダーになります。
 また、絶対ドローダウンが一番小さいのも特徴的で、急相場の急逆転を食わないというメリットもあります。
 ただし、平均的な負け幅も一番大きくなるので大きな上下のある極端な結果になるのが特徴です。

得意
 波の大きさ大きめ
 波の速さ 早め
 パターン 一気に伸びる
 苦手
 波の大きさ小さめ
 波の速さ 遅め
 パターン 緩やか

モード解説 スマートモード

スマートモードでの日足4時間足1時間足 2001年1月1日~2016年7月28日

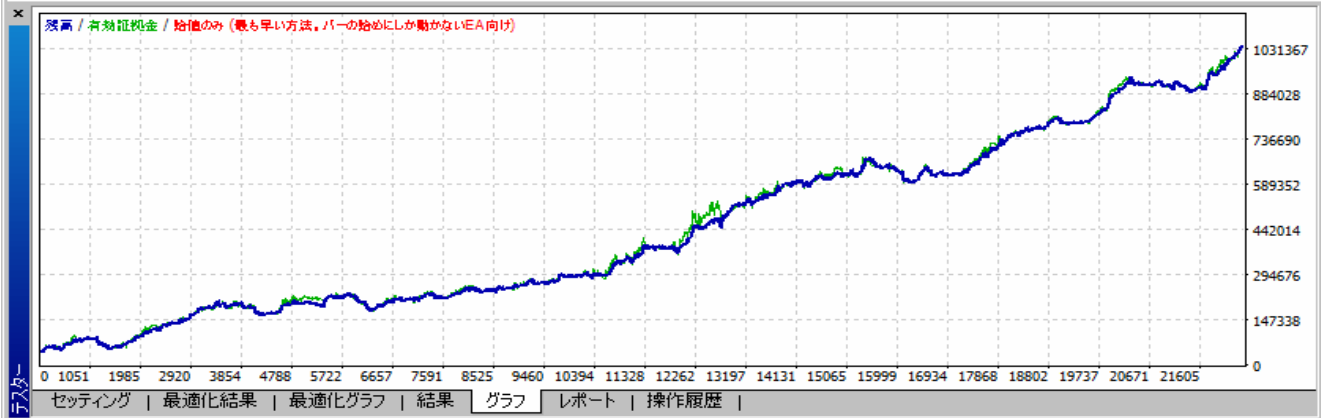


スマートモードの日足・4時間足・1時間足を混ぜた結果です。
 スマートモードではオープンサインでオーダーして、クローズサインでクローズする中で固定のPips分を繰り返し取るオーダーです。
 大きく動いたときは繰り返し、固定Pips取り続けます。
 保有中に逆転しても粘りながら、逆サインが出たらクローズします。
 トレンドが発生すれば連勝を繰り返し、利益を積み上げます。
 逆にレンジに入ると勝ったり負けたりになる弱みはあり、横ばいの期間も出てきます。
 最大のメリットは連勝と勝率です。
 30連勝以上も時々あり、勝率は95%を超えます。
 利小損大の手法ですが、圧倒的勝率で押し切れる手法を採用しています。
 取引回数も多く、他のモードでは取れない相場でも利益を出すメリットもあります。

- 得意
 波の大きさ大きめ
 波の速さ 普通
 パターン 上下に揺れる
 苦手
 波の大きさ小さめ
 波の速さ 遅め
 パターン 一気に伸びる

資金管理

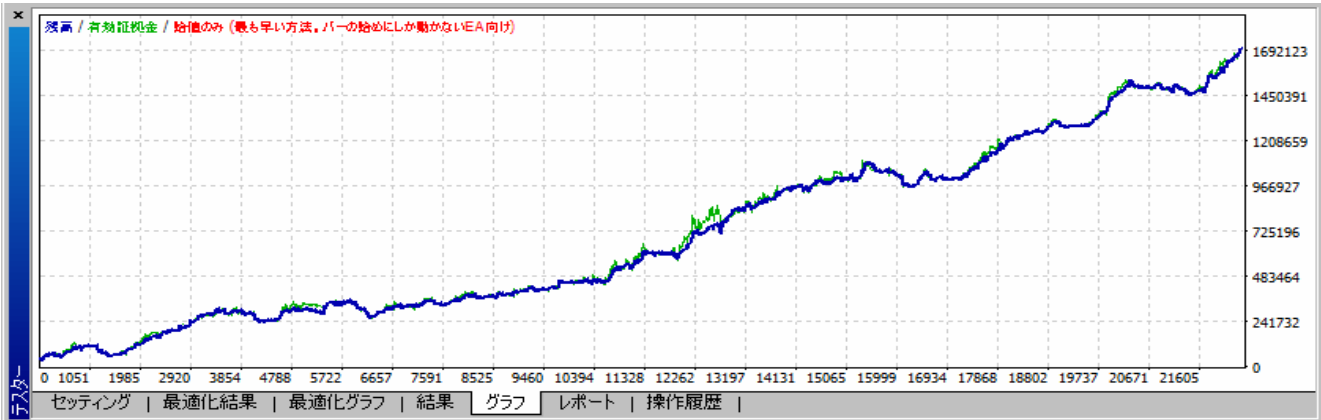
オーダーサイズの最適化
月利10%程度のオーダー



テストバー数	97481	モデルティック数	193909	モデリング品質	n/a
不整合チャートエラー	0				
初期証拠金	50000.00			スプレッド	1
純益	991295.22	総利益	4281912.11	総損失	-3290616.89
プロフィットファクタ	1.30	期待利得	44.38		
絶対ドローダウン	5671.45	最大ドローダウン	87895.85 (12.83%)	相対ドローダウン	48.58% (48845.73)
総取引数	22335	売りポジション(勝率%)	10938 (60.86%)	買いポジション(勝率%)	11397 (62.99%)
		勝率(%)	13836 (61.95%)	負率(%)	8499 (38.05%)
	最大	勝トレード	17257.94	敗トレード	-8466.93
	平均	勝トレード	309.48	敗トレード	-387.18
	最大	連勝(金額)	90 (16081.36)	連敗(金額)	49 (-9834.16)
	最大	連勝(トレード数)	37913.84 (69)	連敗(トレード数)	-25176.54 (19)
	平均	連勝	7	連敗	4

187ヶ月で2000%弱の約月10%前後の利益を単利で生む設定を推奨しています。特に大きなリスクもなく、安定的に月10%前後の利益を出していきます。ただし、マイナスの月も20%以上の月もあるので、絶対にというわけではありません。一般的な推奨モードと言えます。

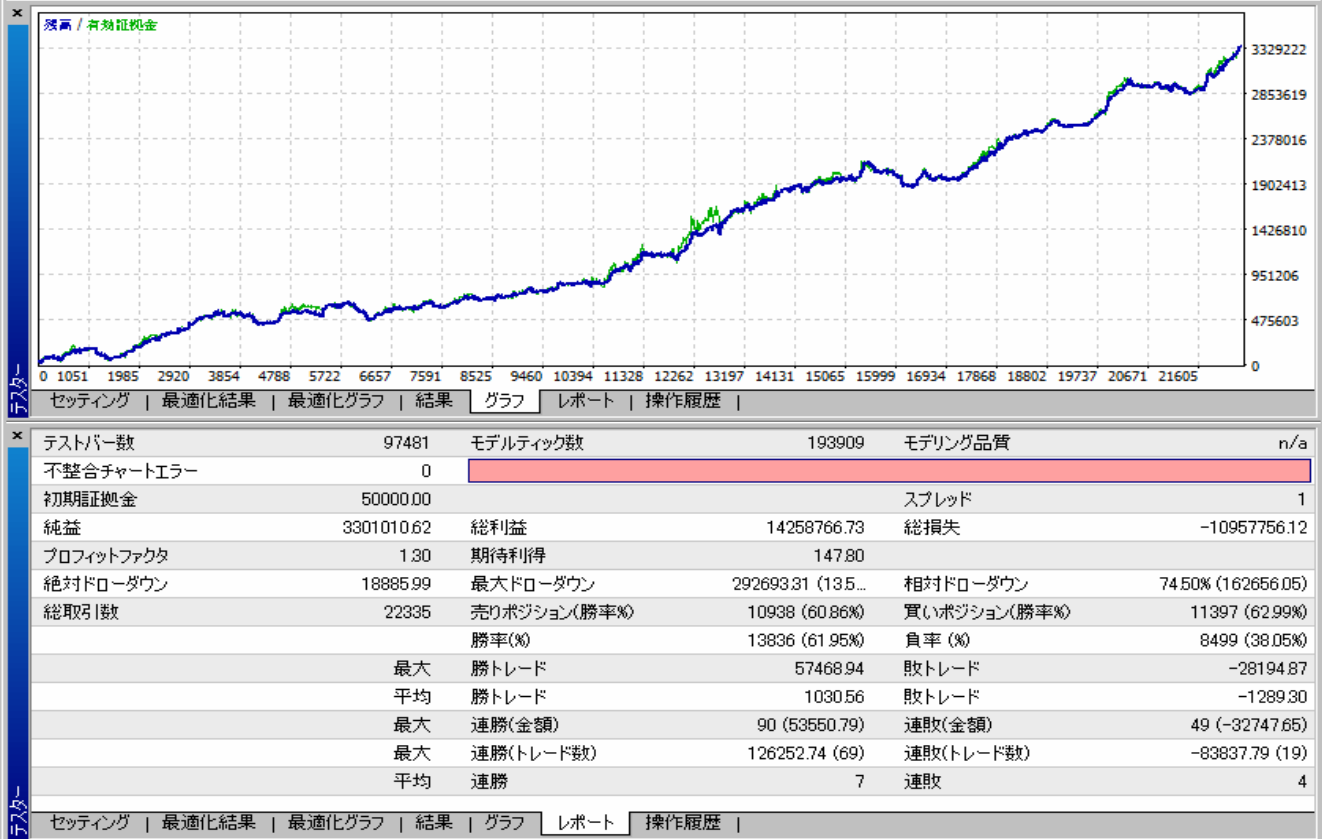
月利15%程度のオーダー



テストバー数	97481	モデルティック数	193909	モデリング品質	n/a
不整合チャートエラー	0				
初期証拠金	50000.00			スプレッド	1
純益	1655461.80	総利益	7150793.17	総損失	-5495331.37
プロフィットファクタ	1.30	期待利得	74.12		
絶対ドローダウン	9471.30	最大ドローダウン	146786.06 (13.2...)	相対ドローダウン	60.68% (81572.39)
総取引数	22335	売りポジション(勝率%)	10938 (60.86%)	買いポジション(勝率%)	11397 (62.99%)
		勝率(%)	13836 (61.95%)	負率(%)	8499 (38.05%)
	最大	勝トレード	28820.76	敗トレード	-14139.77
	平均	勝トレード	516.83	敗トレード	-646.59
	最大	連勝(金額)	90 (26855.81)	連敗(金額)	49 (-16422.99)
	最大	連勝(トレード数)	63316.02 (69)	連敗(トレード数)	-42044.77 (19)
	平均	連勝	7	連敗	4

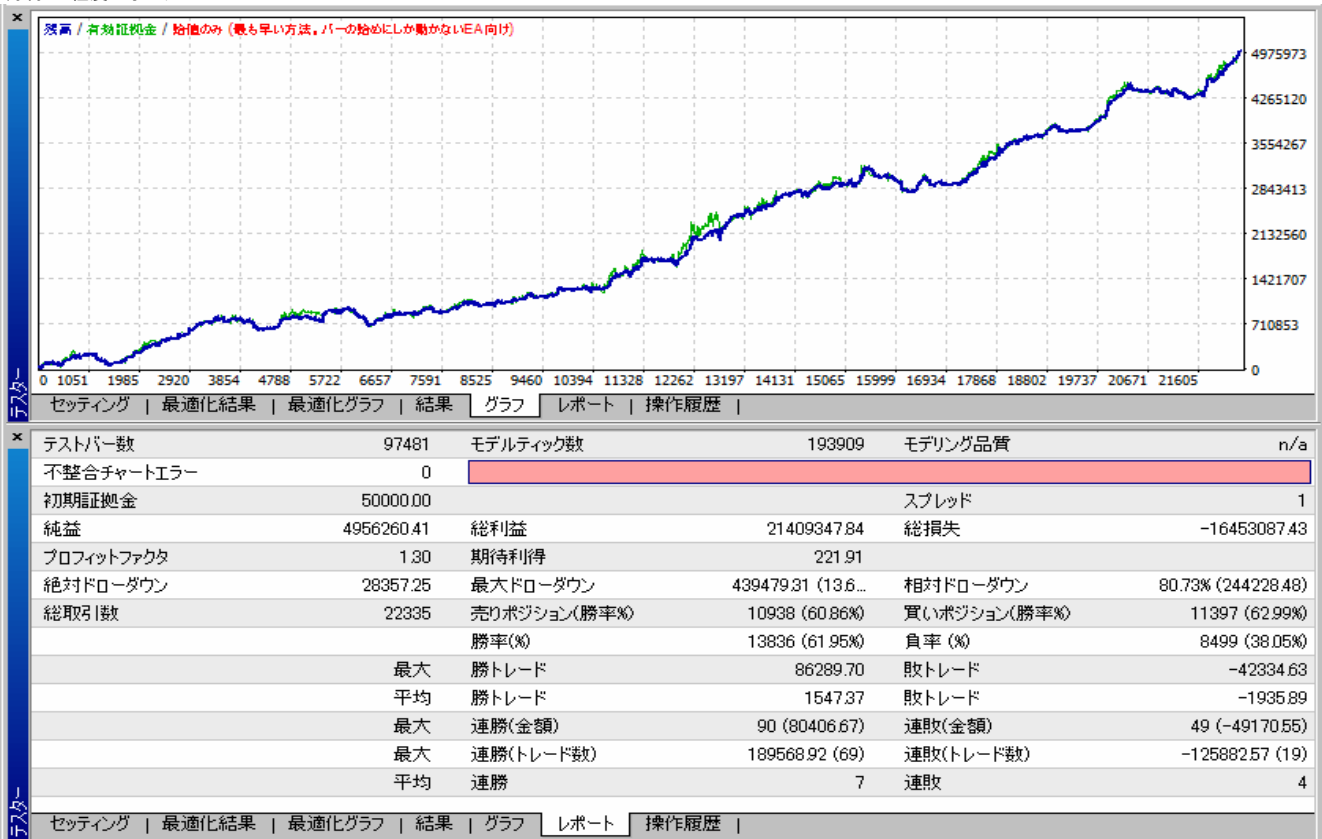
月に15%の利益を狙ってもそこまでハイリスクにはなりません。一般的な投資レベルと言えます。

月利30%程度のオーダー



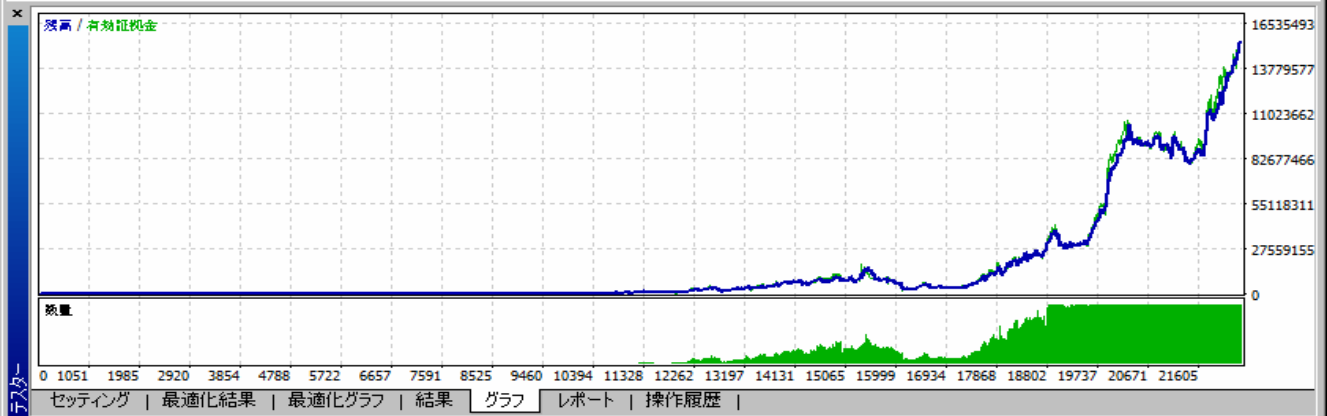
月利30%狙いでもまあハイリスクハイリターン程度ですみます
少々ヒヤッとするタイミングもここからは出てきます。

月利50%程度のオーダー



月利50%狙いのハイリスクモードです。
何とかはなりますが、出だしに伸ばせるかどうかにかかっています。
15年で10000%というのは上々です。

無制限のハイリスクオーダー



テストバー数	97481	モデルティック数	193909	モデリング品質	n/a
不整合チャートエラー	0				
初期証拠金	50000.00			スプレッド	1
純益	154662324.00	総利益	565014192.56	総損失	-410351868.57
プロフィットファクタ	1.38	期待利得	6924.66		
絶対ドローダウン	7522.74	最大ドローダウン	27770653.93 (25...)	相対ドローダウン	83.02% (15007324...)
総取引数	22335	売りポジション(勝率%)	10938 (60.86%)	買いポジション(勝率%)	11397 (62.99%)
		勝率(%)	13836 (61.95%)	負率(%)	8499 (38.05%)
	最大	勝トレード	6739290.03	敗トレード	-2332609.96
	平均	勝トレード	40836.53	敗トレード	-48282.37
	最大	連勝(金額)	90 (81776.69)	連敗(金額)	49 (-93558.61)
	最大	連勝(トレード数)	11851243.84 (35)	連敗(トレード数)	-5234735.62 (28)
	平均	連勝	7	連敗	4

非現実的ハイリスク設定(複利)でまわしてみました。
 最初の方もそこそこ伸ばしているのですが、グラフは後半が大きいので見えにくいです。
 しかも2013年から玉の最大500に達してしまいそこから最大の単利です。
 天文学的な数字になってしまったので何か浮世離れしてしまいました。
 これらは夢はありますが、あまりお勧めは出来ません。
 これだけ伸ばしても後半の相場次第ではあつという間に資金を失う可能性があります。

なぜあまりリスクも上がらずに設定次第で利幅が変わるかといえば資金管理が優れているからです。
 そしてリスク分散をしていることも大きな理由の一つです。
 オーダーを日足と4時間足と1時間足にしている事で、急相場は1時間足、トレンドは日足が追いかけます。
 さらに、決済手法を4つに分散することで利益効果を最大化するのではなく、均一化しています。
 動きによって、ノーマルのように逆サインを待った方がよい場合や、トレイルを入れて攻めた方が取れる場合もあります。
 また、値動きがあいまいな時はセーフモードが取れますし、動きがない時はスマートモードが取れます。
 相場を見ながら決済手法を変えることは未来予測なので出来ませんが、複数用意し均一化する事は可能です。
 また、それぞれが得意相場で効果を発揮しつつ、苦手相手を補い合います。
 なので、急な大きな下落を防ぎます。
 足を3種類と手法を4種類用意することで、12本のトレードが効果的に得意相場で利益を出しつつ、苦手相手を補う事で安定化しているのです。

相場	急	普通	緩やか
ノーマル	△	△	△
セーフ	x	△	○
トレイリング	○	△	x
スマート	△	○	x

相場	急	普通	緩やか
日足	x	△	○
4時間足	△	○	△
1時間足	○	△	x

さらに
 日足 月足・週足・日足でオーダー 週足・日足・4時間足で決済
 4時間足 週足・日足・4時間足でオーダー 日足・4時間足・1時間足で決済
 1時間足 日足・4時間足・1時間足でオーダー 4時間足・1時間足・30分足で決済
 とストキャスティクスの見ている足もクロスしつつあるので効果的に補完しあいます。

資金管理といってもロットを調整しているわけではありませんが、オーダーを分散し、効果的に投資していく手法です。
 安定度と長期運用を見たときにこれ以上ない方法論だと長年見てきて感じています。

派手なEAが多いですがPFは1.2くらいを狙っており、勝率も4割で十分です。
 その分、損よりも利益が大きく取れば何の問題もありません。
 PFが1.3と勝率が6割あれば、それは間違いなく上に伸びる結果になります。
 無理にPFを高めるフィッティングや勝率100%のEAを作る必要はありません。
 シンプルなルールで長期的に勝てること、フィッティングなしで再現性の高い手法でPFを1.2以上と勝率5割程度を継続できることが重要です。
 そして苦手相手を理解し、苦手相場の振る舞い次第で長く使えるEAかどうかが決まります。
 このEAは苦手相場もありますが、必ず耐え切ります。
 そして得意相場で確実に利益を積み上げます。
 今まで売るためにフィッティングされたEAをつかまされてきた方には確実に勝てる良いEAだと思います。

みなさんだまされる前に少し学んでください。
 相場は上がるか下がるか分かりません。
 どんなに手の込んだ手法でも必ず勝率は5割に近づきますし、利幅も1.0に落ち着きます。
 それを変えるには少ない利益で勝ち逃げて勝率を上げ、相場に後出しでトレンドだけに乗るしかありません。
 そうすれば勝率は5割を超え、勝ち目の相場に乗ることは可能です。
 それでも勝率6割、利幅も1.2程度が無難です。
 勝率9割や利幅2.0などは長い足の日足やスマートモードで可能ですが、それはあくまでも補助的な手法です。
 利幅の高いだけのものや、勝率が高いだけのものだけでは長期もつとは言えません。
 初めの負けや大きな損幅は前半に来れば立ち直れません。
 それらはいくまでも補助的手法で、複数の手法で安定的に勝つことが重要です。
 もちろん日足だけで完成させたり、スマートモードだけで完成すれば見栄えは良いかも知れませんが、
 ですが、それは初めに勝てればということになるので、リスクは分散し、補助的に導入するのがBESTなのです。
 ノーマルモードや1時間足などで苦手を補助しながらトータルで完成品でなくてはなりません。
 長期的安定的に利益を積み上げるにはこれらを複合的に導入したEAでしか実践できないと経験上考えています。

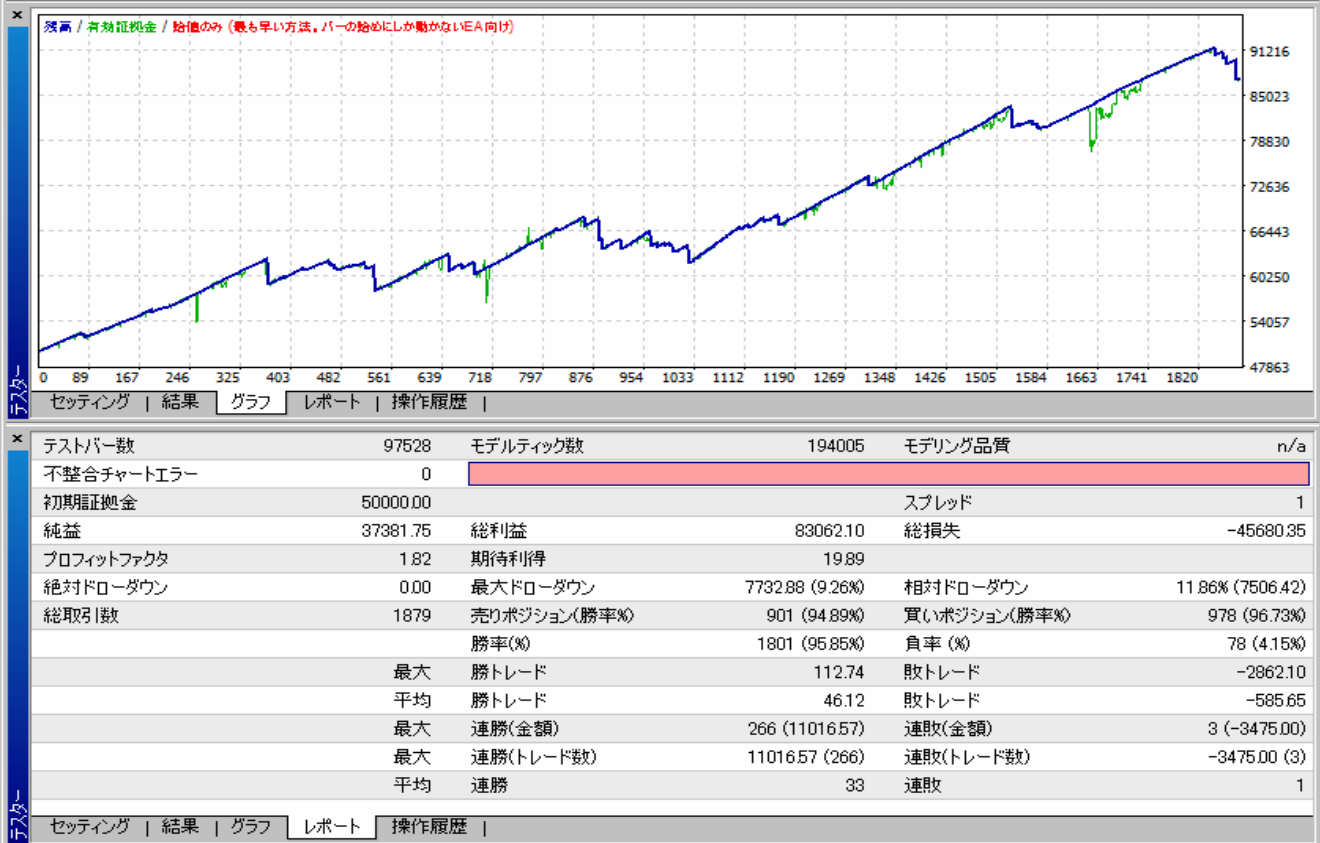
苦手相場の克服(トレンド反転)

これだけ綿密に3つの足と4種の決済手法を駆使しても取れない相場があります。
 実際の月足と比較してみます。



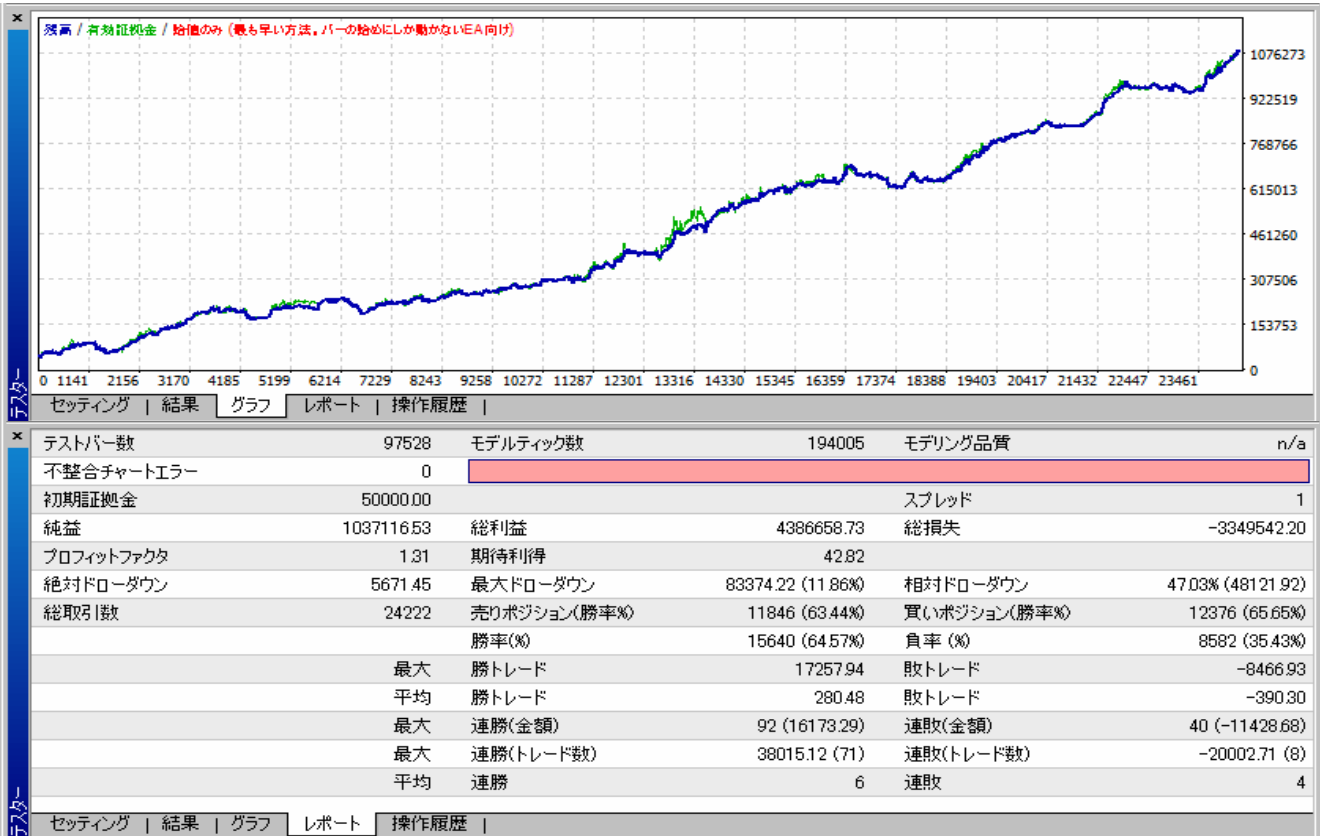
動きがない、もしくは、反転前
 これらはトレンドフォロ型では非常に苦手な相場となることが良くわかります。

そこで月足のRSIが一定以上と一定以下のみ発動するオーダーを入れます
 通常はストキャスでトレンドフォローなんですけど、ここではRSIのオシレーター系を用います。
 普段は勝ってないですが、トレンドのない相場に強いのが特徴です。
 多少出入り口付近でもたついてしまいますが、レンジが長ければ長いほど利益が出ます。
 そして、このオーダーは日足と4時間足で10Pipsと1時間足で7Pips程度を積み上げ、リミットはありますが、
 ストップはなく、レンジ抜け(RSI値が中間層)で初めてクローズします。

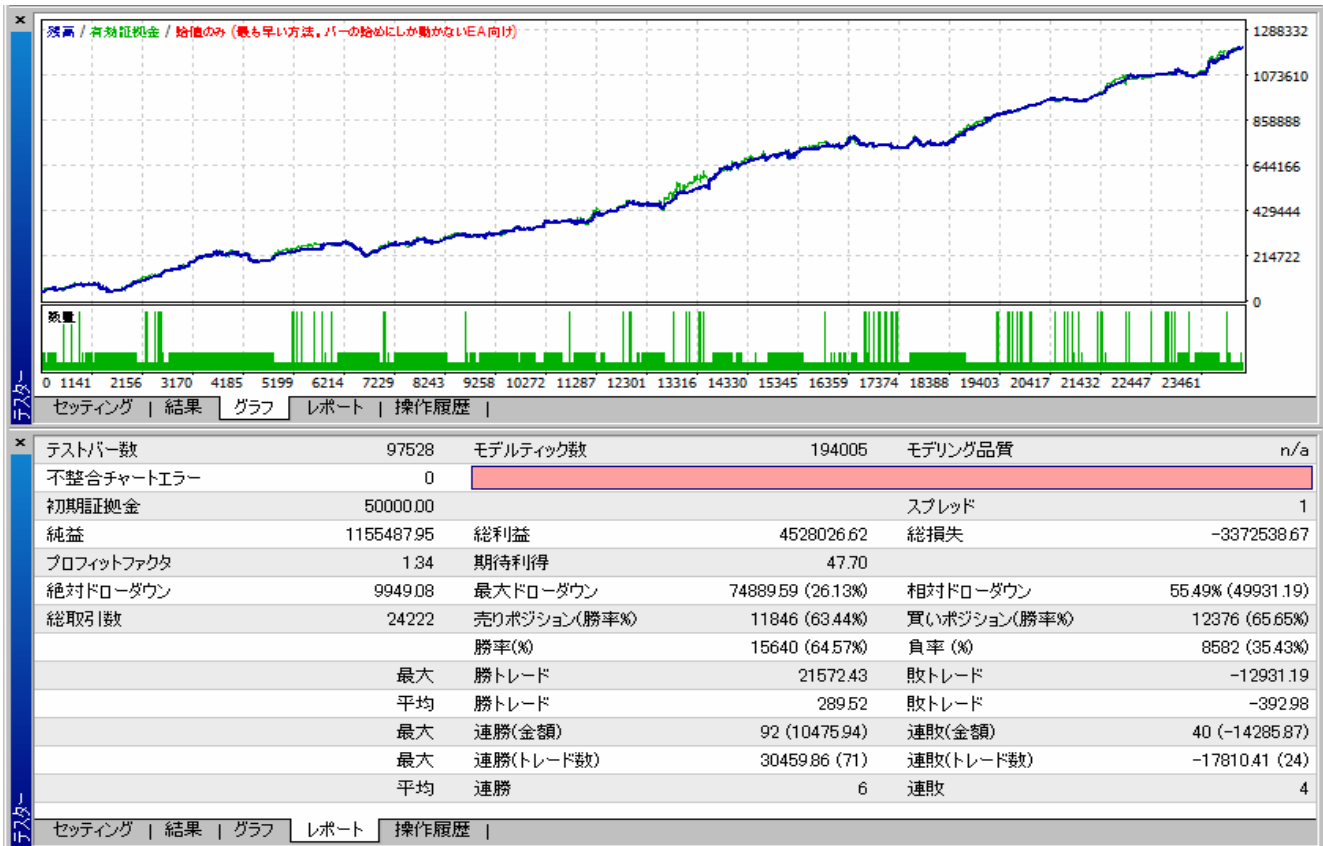


まあ、無難な数字が並びます。
 スマートモードに似ていますが、結構仕掛けは間違えます。
 テンブ発生時に取り損なって損になる部分はありますが、そこは全体の補完なのでやむをえません。
 大きな連勝の後に必ず、負けて終わります。そこまでにどれだけ取れるかが勝負になります。
 これをリバースモードと呼びます。

リバースモードと通常オーダーの併用



一緒にまわすとこんな感じです。
 PFは0.01上がってますがほぼ同じです。
 一緒に回す程度では全体の10分の1程度オーダーですし、取る幅が小さいのでこれだけを増やしても下降する波は防ぎきれません。
 そこでロットと資金管理でなだらかにします。



RSIが一定以上もしくは一定以下の極端な相場では通常のオーダーのロットを半分になっています。要するにリスクを半分にしたということです。全体の半分くらいがその相場になります。そこだけオシレーター発動ということになります。さらにリバースモードのオーダーは3倍の大きさで投げます。リミットも小さいですし、相場が動いていないのでリスクはさほど上がりません。計算すると全体の12/15を半分にして、3/15を3倍にすることになります。6/15+9/15で調度1という計算です。なので、オーダーのリスクは一定です。ですが、PFも1.34に上がり、最大ドローダウンも小さくなりました。トレンド発生時の1発目のオーダーの玉が小さいので、爆発力は落ちますが、なにより安定度が上がります。明らかな下降線相場もなだらかに勝ったり横ばいになるのでストレスも小さくなりますし、2015年のような相場もある程度対応できます。

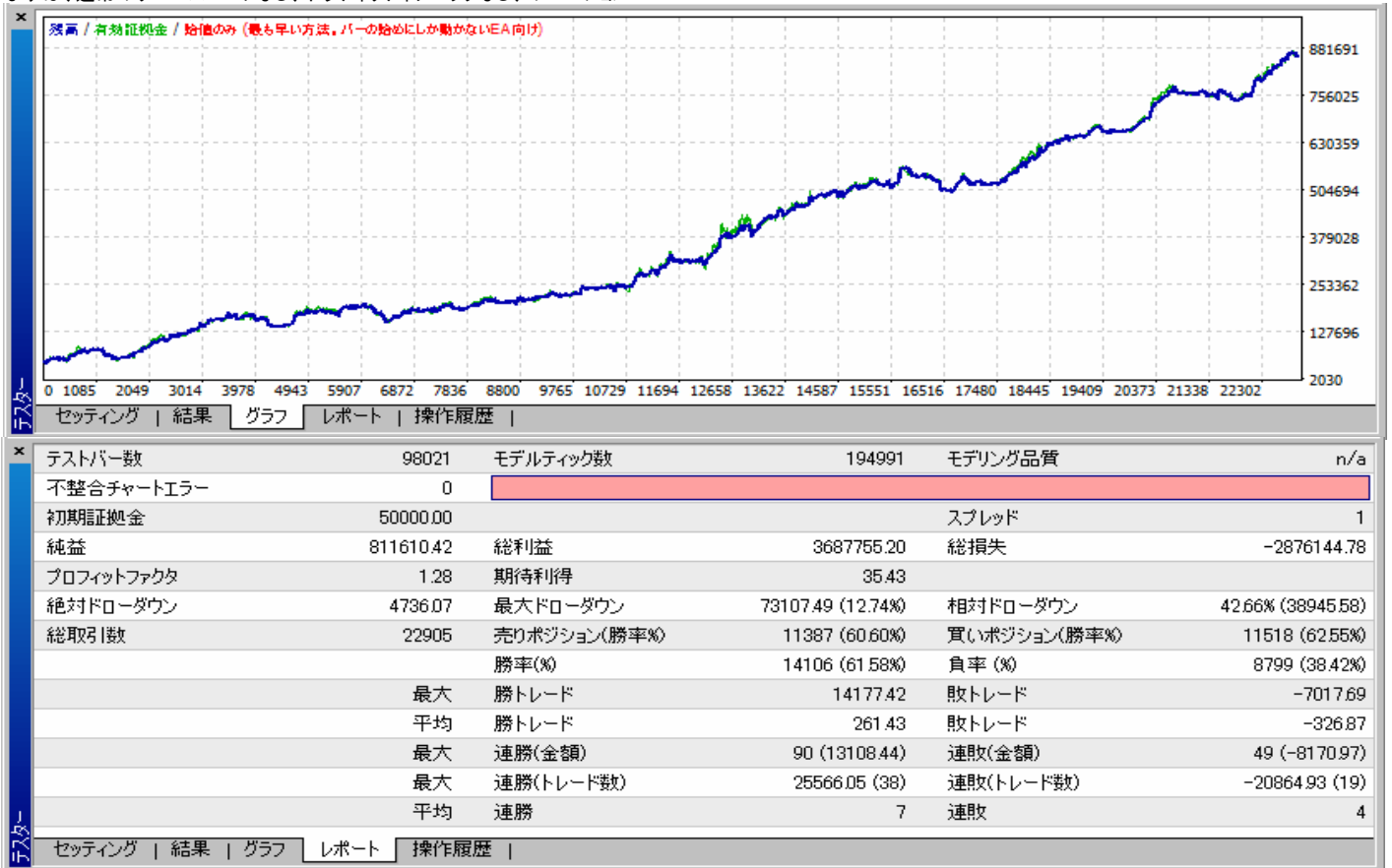
通常モード(3つの足にそれぞれ4種の決済手法)だけでは苦手な相場あります。それを短期的に補い、スイッチするリバースモードが入ることで格段に安定度が増しました。個人的には勝っても負けてもそれが相場だという考えではあるのですが、多くの人が使う上では安定度も重要なポイントになります。合計15本分のEAが同時に動き、適切な相場で適切なロットでオーダーが出ます。そこまでせねば相場に対応するというのは難しいですし、勝てるとは言えないのだと思います。オーダーの条件自体はシンプルで再現性が非常に高く、ロットや相場での切り替えが最大のポイントになります。

苦手相場の克服(ボラティリティ低下)

極稀に24時間でほとんど動かない相場などがあります。
 その後に大きな変動が来てしまうと、一気に損が膨らんでしまうケースが極稀にあります。
 大きな反転前という事も多く、利益も多少減るのですが、損を大きくしないための対策になります。
 最後にその変動相場対策を入れておこうと思います。

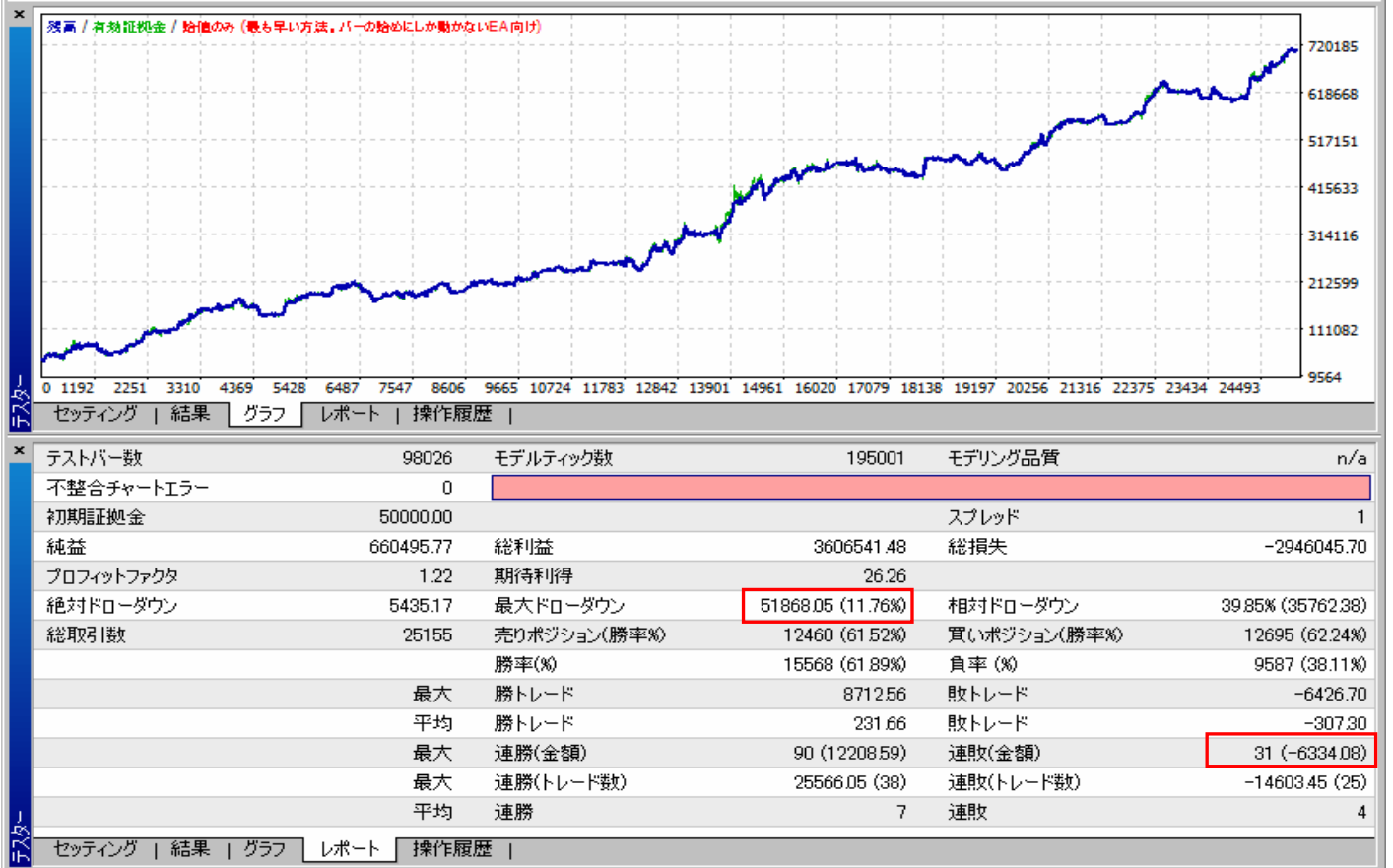
ロジックはいたって簡単です。
 24時間で動きの幅が一定以下になった場合に決済を行ってしまう事、その間は新しいオーダーを控える事の2点です。
 一応これをボラティリティチェックと呼びます。

まずは、通常のリバースモードなし、ボラティリティチェックなし、のバージョン



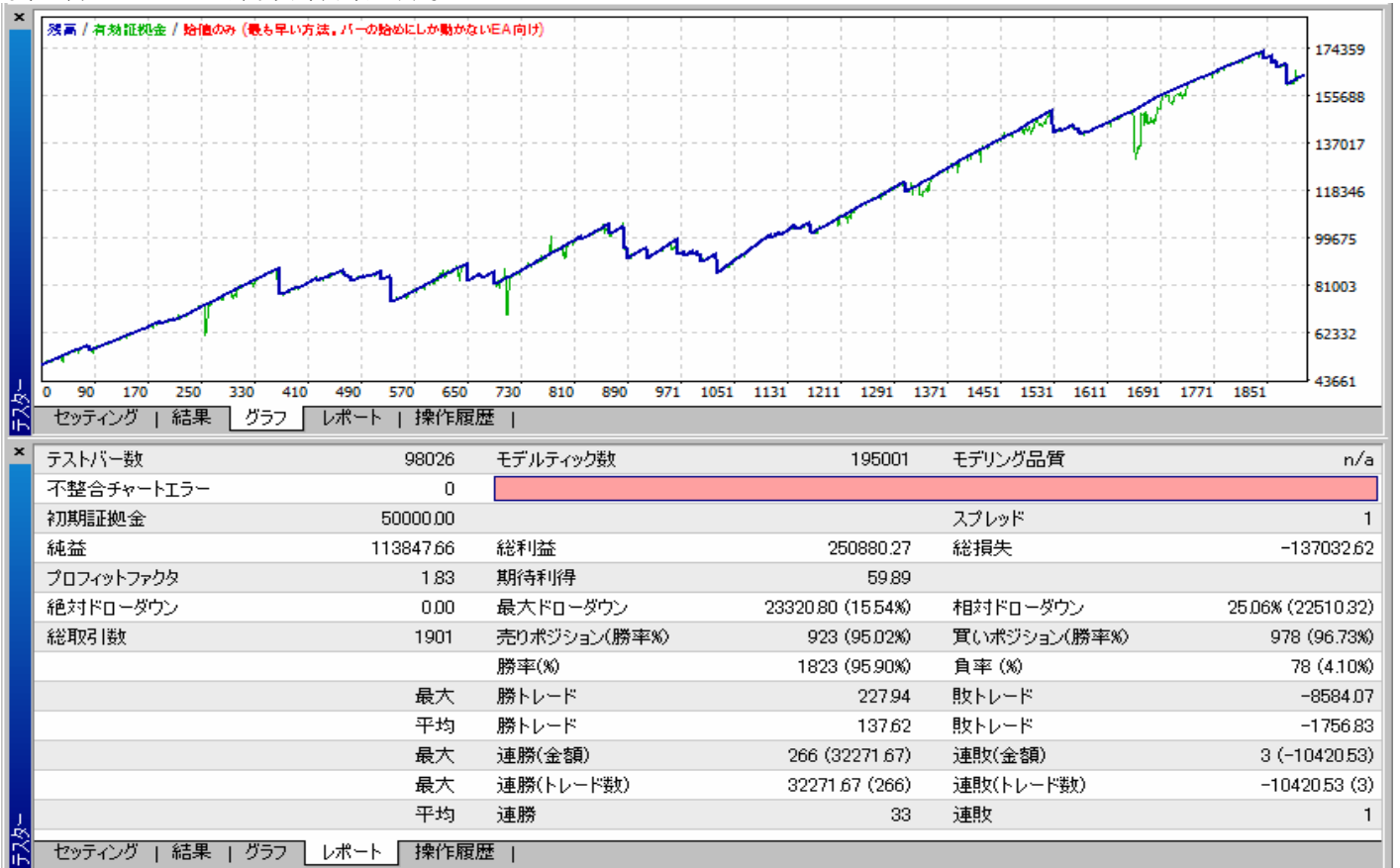
お馴染みですが、多少苦手な相場が顕著にはあります。月単位での負け越しもちょくちょくあります。

これにボラティリティ対策を入れて、通常のリバースモードなし、ボラティリティチェックあり、のバージョン



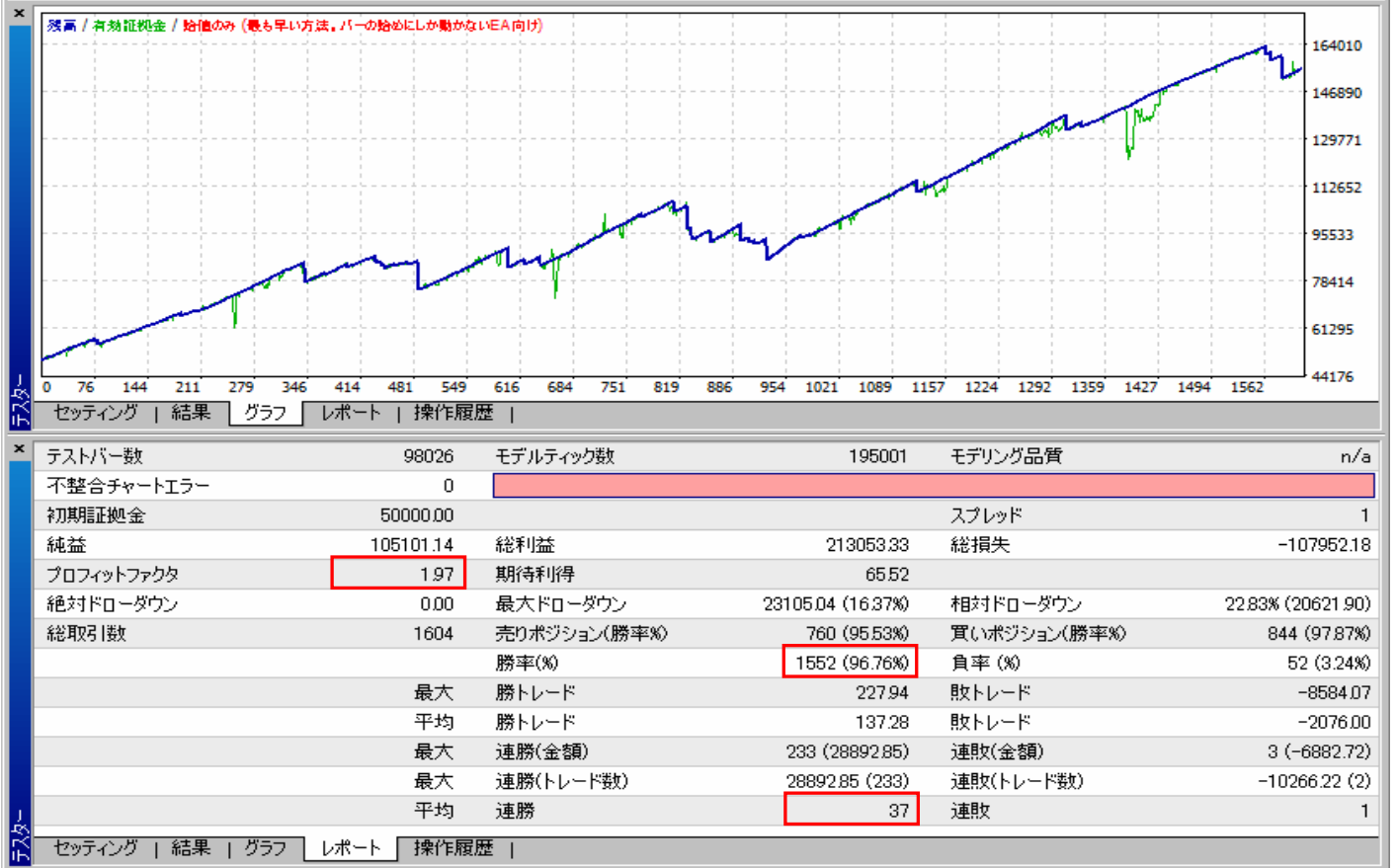
少々、大きな勝ちが小さめにはなるのですが、大きな負けはかなり小さくなります。特筆すべきは最大ドローダウンがかなり減ること、そして、連敗も大きく減ることです。PF8%を犠牲にはするのですが、長期的に見ると、ドローダウンが小さい方が勝率を維持する限り有効だと考えます。勝率を維持しつつ、天井を狙って、ドローダウンの幅が大きくなるよりも、そこそこで勝って、程よく負けるほうが安定度が高いと見ています。大勝も減るのですが、勝ち逃げするトレードや、負け幅を小さく納めるトレードが軒並み増えました。

次にリバースモードだけを比較します。リバースモードではボラティリティが下がった時に決済はせずに通常通り保有し、新規のオーダーのみ控える形にしています。まずは、リバースモードのみ、ボラティリティチェックなしのバージョン



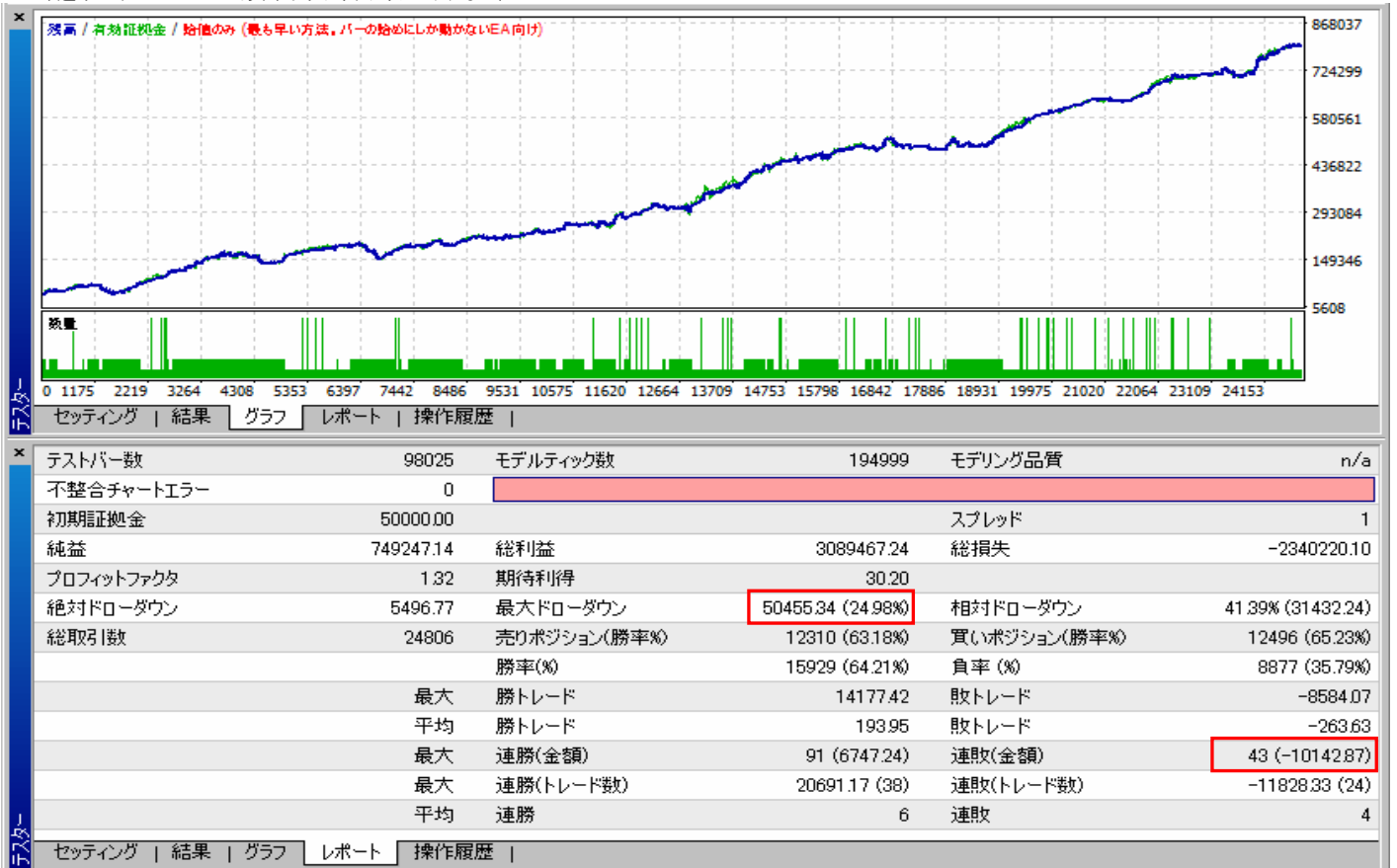
高い勝率と安定したPFを維持しています。

リバースモードのみ、ボラティリティチェックなしのバージョン



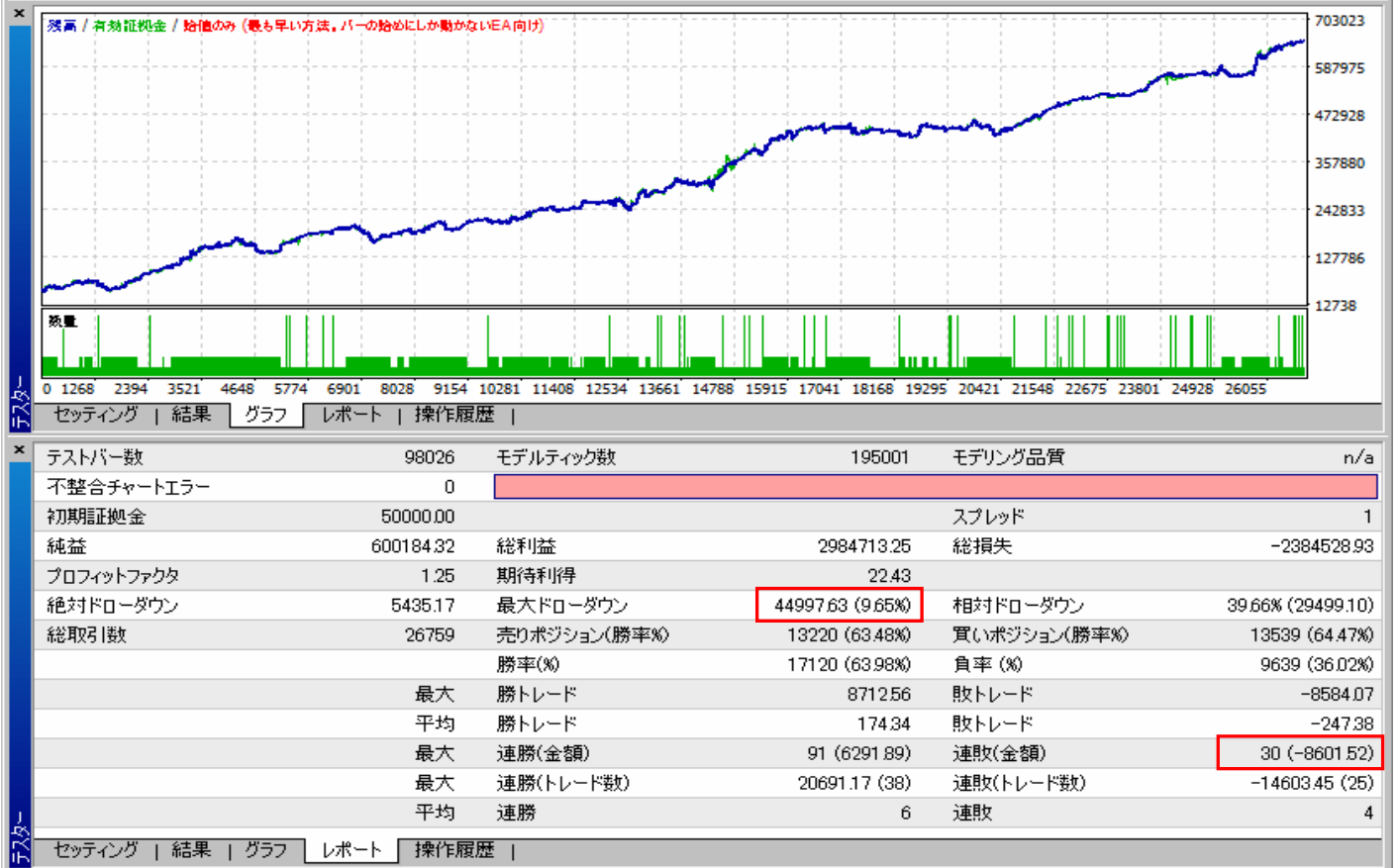
PFも向上し、勝率も上がります。
 その分取引回数が減るので、総利益は減ります。
 取引回数が20%以上減るのに対し、利幅は5%減ですんでいるので効率もよくなり、リスクも軽減できました。

では、通常のリバースモードあり、ボラティリティチェックなし、のバージョン



文句のない結果ですが、唯一気になるのが最大ドローダウンが大きいこと。
 最大の理由である固まる相場で仕掛けてしまうと何度か急反発をくらっています。
 反面大きな反発利益も取れなくなり、トレンド発生後の追いかけになります。
 これさえ小さく抑えることが出来れば、リスクレベルを上げた運用にも耐えられるようになります。
 逆にこのままで使うと大きなロットで仕掛けて、いきなり苦手相場や固まる相場だと厳しいと言う事になります。
 あとは連敗も大きいのでそこも減らす必要があります。原因はレンジ相場で15種のオーダーがそれぞれ3連敗するような相場です。
 まれなケースで数年に一度ですが、行って帰って行って帰ってときつい連敗があるのが固まったレンジ相場です。

最後にリバースモードあり、ボラティリティチェックあり、のバージョン



一回の利益が減る為に、PFは少し落ちますが、総利益と総損失は数%の誤差程度です。

それよりも、最大ドロダウンを大きく減らし、連敗も大きく減らしました。

とにかく、大きな損失を減らし、安全なトレードを優先し、これならばと思い、自信を持って設定しました。

一番利益が高いのはリバースモードもボラティリティチェックも入れないものです。

ただし、あれですとリスクの高い運用設定は出来ず、ロットも小さくしていかなざるを得ません。

様々なスタイルに合わせ、少々大き目のロットでもチャレンジできるようにするには、これらのリバースモードとボラティリティチェックは不可避だと思っています。もちろんどちらも設定で外せるようにはしてありますが、基本的には初期設定どおり、利用するパターンをお勧めします。

まとめ

FXMSは確実な仕掛けどころを判断する為に

・マルチタイムライン

のオーダー手法を用いています。

これはひとつのオーダーを出す為に4つの足を参考にしたマルチタイムライン手法です。

例えば4時間足では1時間足・4時間足・日足・週足を参照しています。

ストキャスティクスは非常に優秀なテクニカルデータです。

それでは勝てないという方と思われる方もいらっしゃるでしょう。

実際には複数の足を参照すれば非常に正確なオーダーを出すことが可能です。

FXMSはリスクを分散し、あらゆる相場に対応する為に

・マルチオーダーシステム

のオーダー手法を用いています。

これは、相場によって速度が異なる為に、日足・4時間足・1時間足がそれぞれずれながらオーダーしていく手法です。

これを用いることで、早い相場は1時間足がすばやく、普通の相場には4時間足がしっかりと、遅めの相場には日足がじっくりと効果を出していきます。

それぞれが、結果論ではない適切なラインを見極めてオーダーしていきます。

FXMSは出た利益を逃さない為に

・マルチクローズシステム

の決済手法を用いています。

これは、相場の流れで決済のしどころを間違わないためです。

通常のノーマルモードとS/L T/Pを用いたセーフモードとトレイリングストップを用いたトレイリングモードと小刻みに決済するスマートモードです。

これらが、それぞれ相場によって、どれかが最大利益を取っていくよう設定されています。

どれかがまいちの決済になっても、どれかが大きな利益を出す手法で安定化を図っています。

FXMSは反転間際の相場でも結果を残す為に

・リバースシステム

のオーダー手法を用いています。

これは、大きな月足の反転際に発動し、トレンドフォローでは厳しい相場を補助します。

これによって、大きな反転時にも大きなドロダウンを受けることなく、トレードを継続します。

小さな値動き時やつねに反発する相場で逆張りのオシレーター系のオーダーを出すように自動で切り替えをします。

これによって、大きな期待が出来ない相場でも安定度を確保し、利益を生むトレンドに備えます。

最後にFXMSは大きなドロダウンを回避する為に

・ボラティリティチェックシステム

のシステムを導入しています。

値動きが止まったときは反転するケースが多く、大きな損失を出す直前であるケースが多いです。

値動きが止まったときこそ大きな利益のねらい目でもあるのですが、大きな危険もあるギャンブルになります。

長期値動きが止まったときは速やかに決済し、新規オーダーを控え、トレンド発生時にすばやく対応できるように備えます。

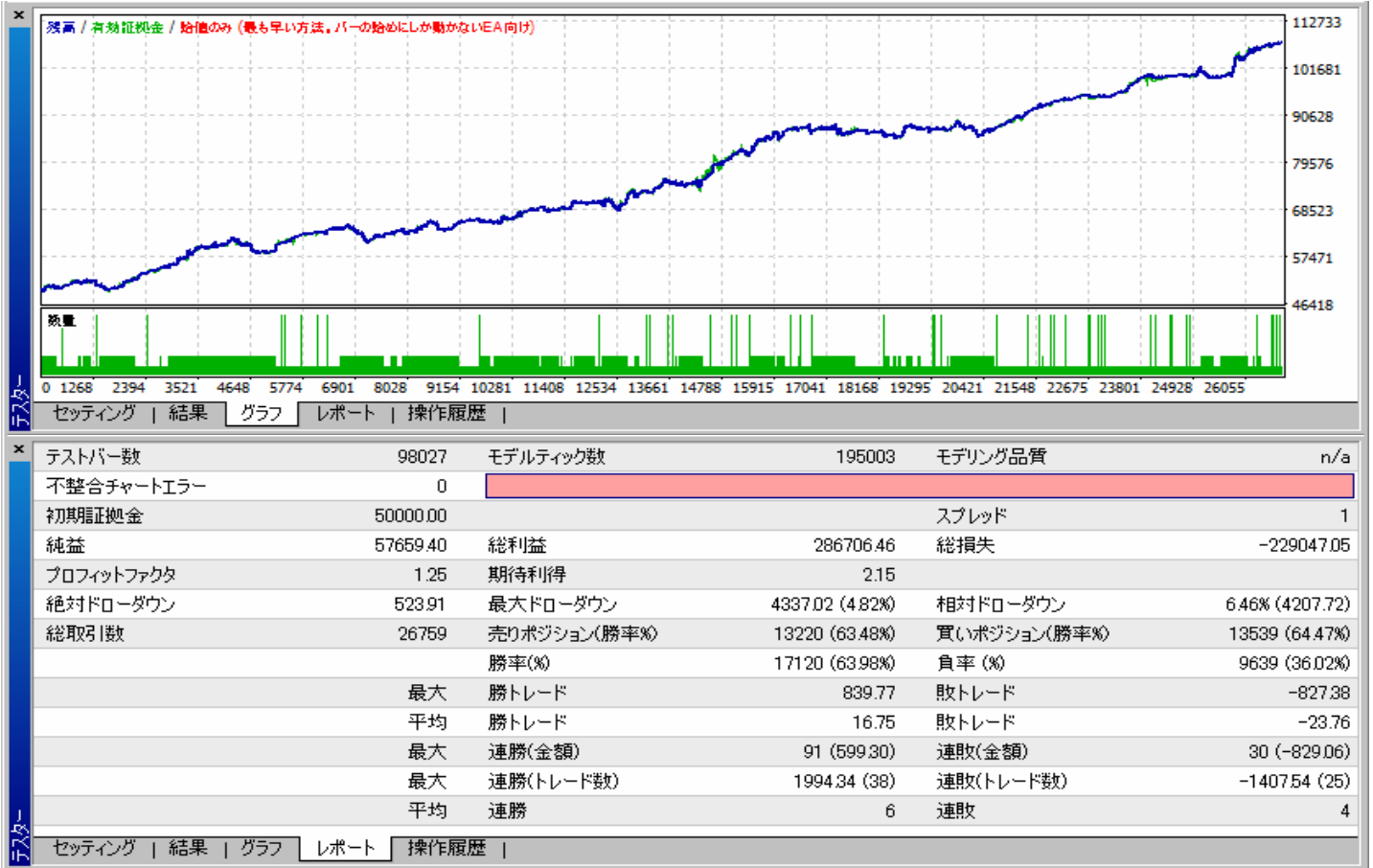
これを入れることで少々大きなロットでのオーダーも可能になります。

まずは損失を小さくすることを優先し、その中で利益を積み上げていく手法です。

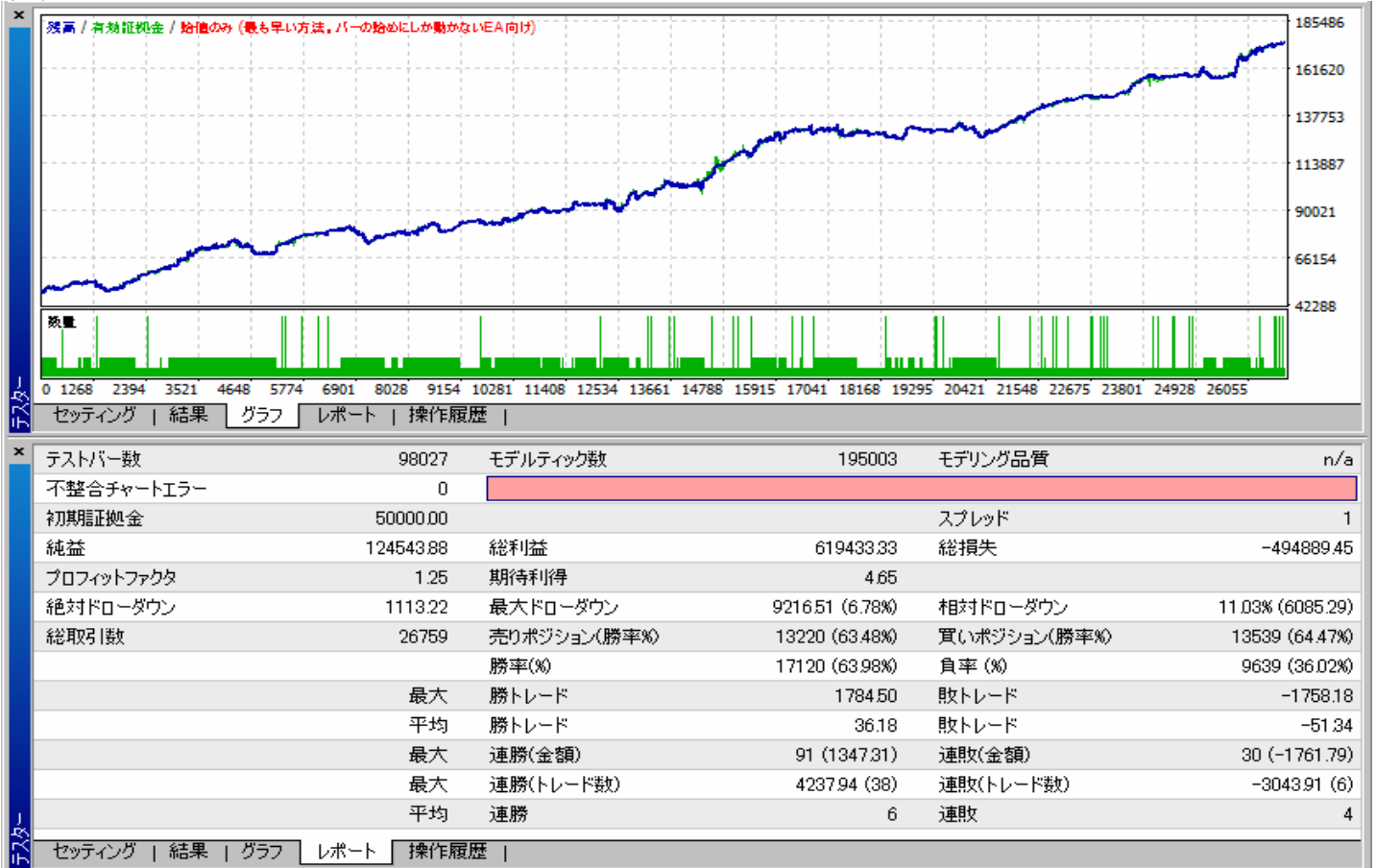
というのが最終的なまとめです。

最終 全オーダータイプでのバックテスト

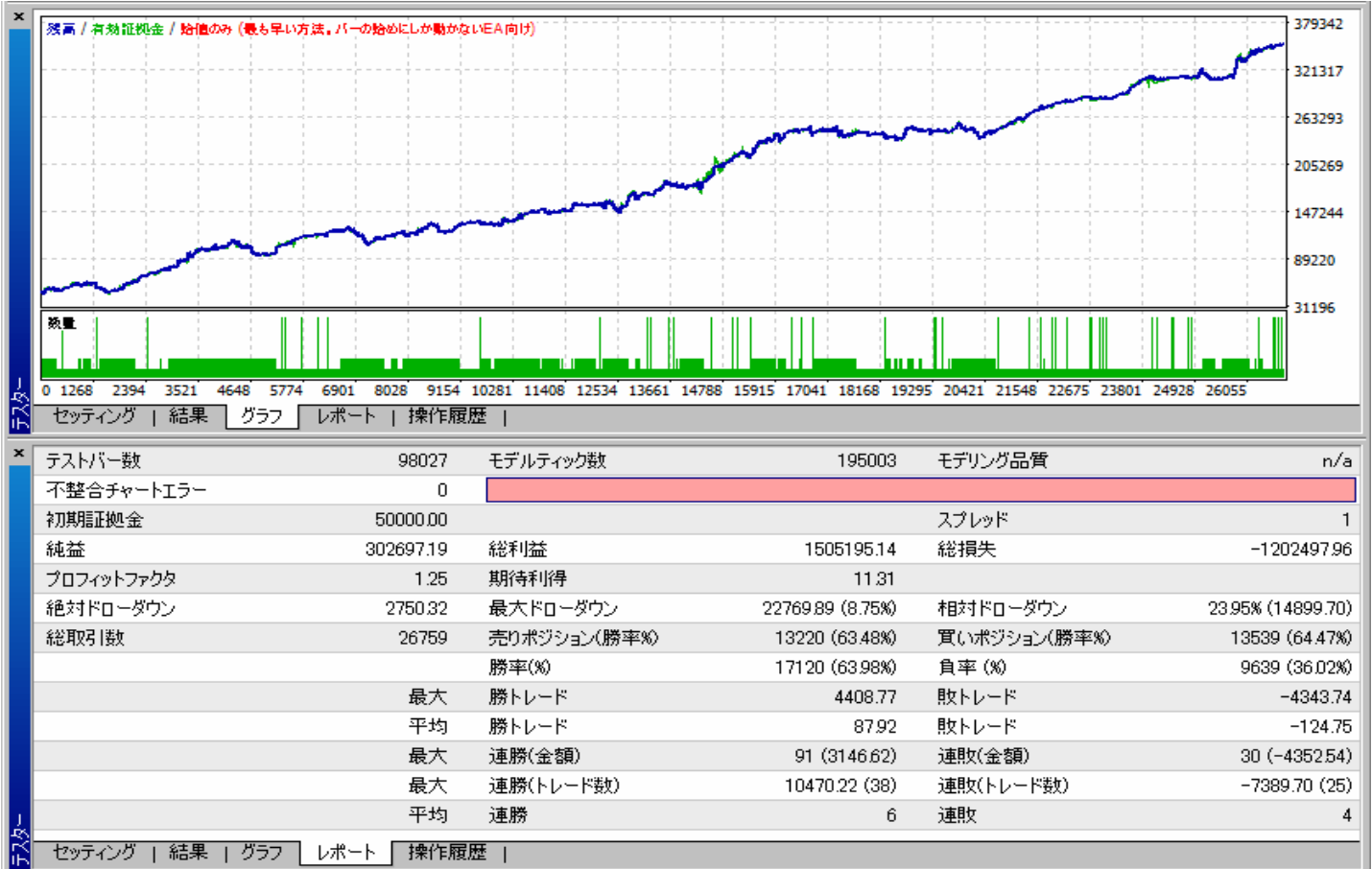
リスクレベル1



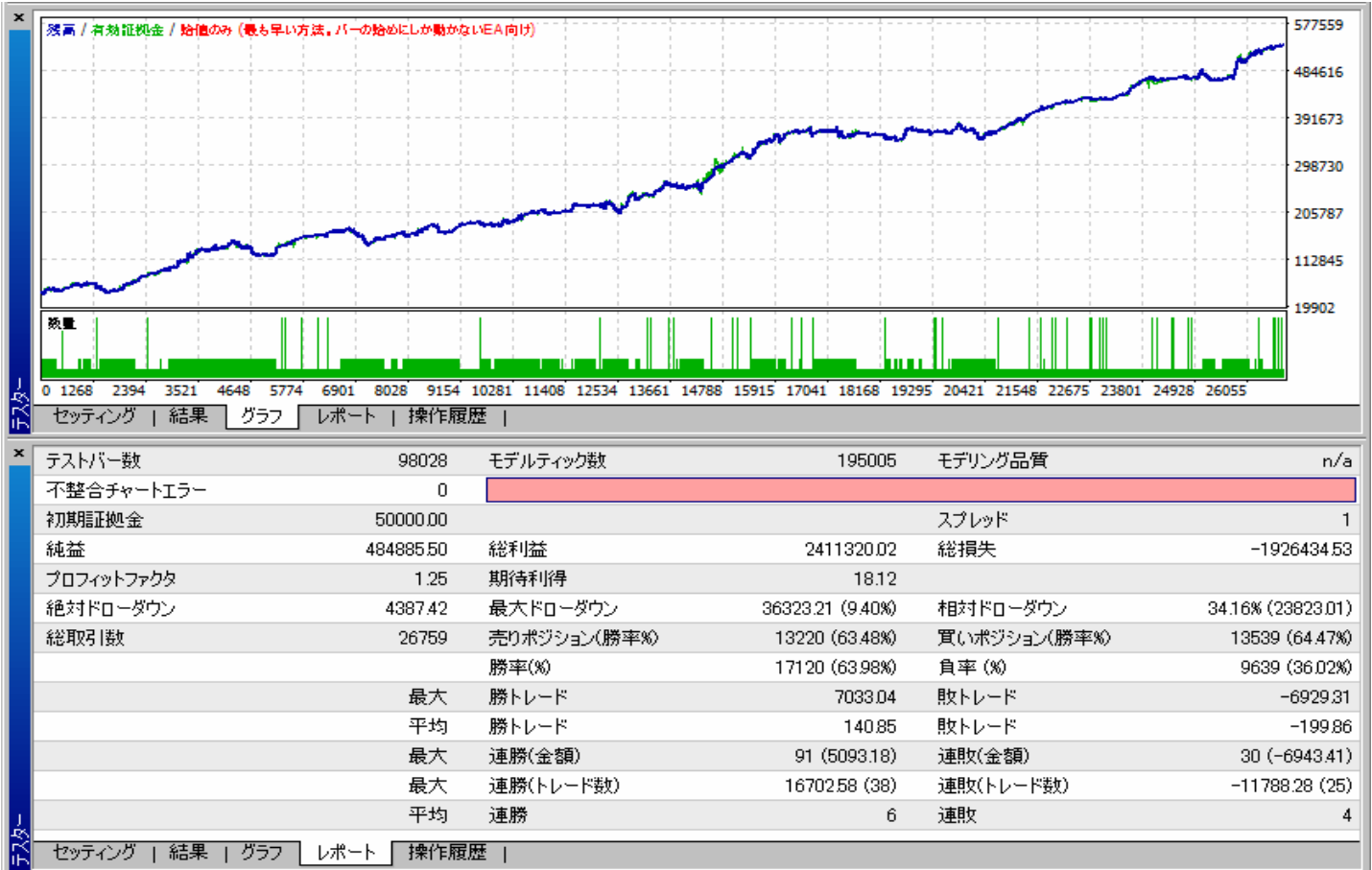
リスクレベル2



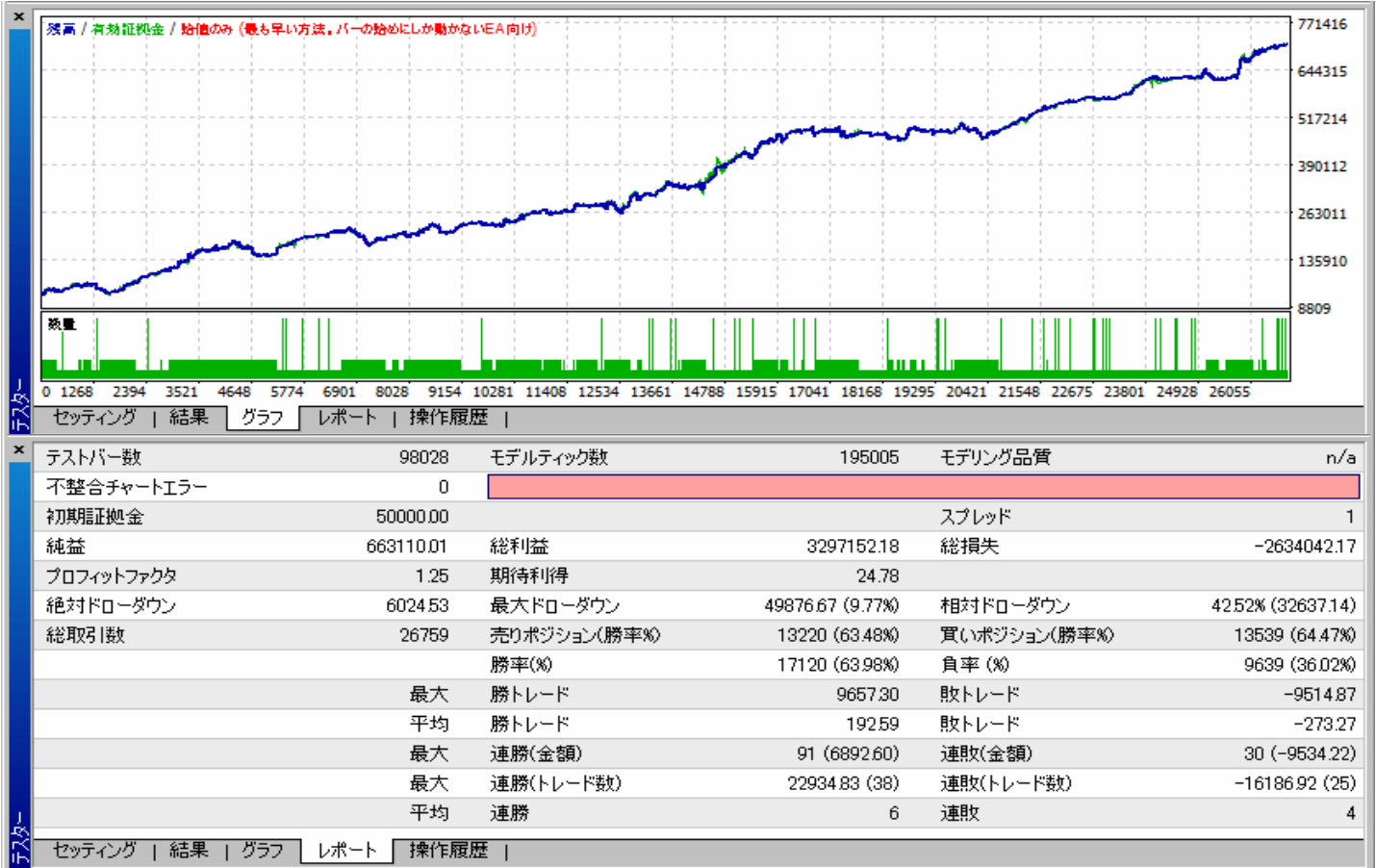
リスクレベル3



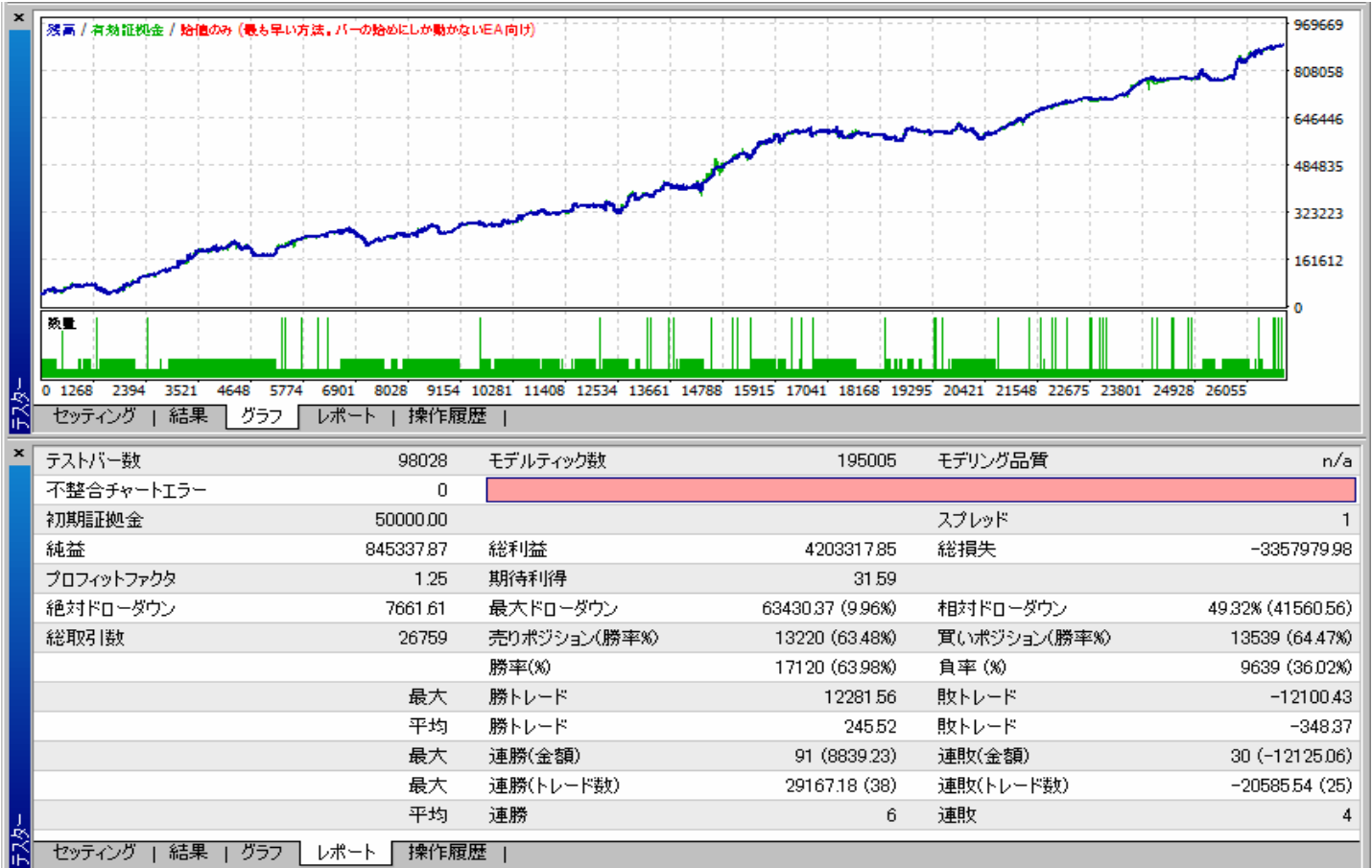
リスクレベル4



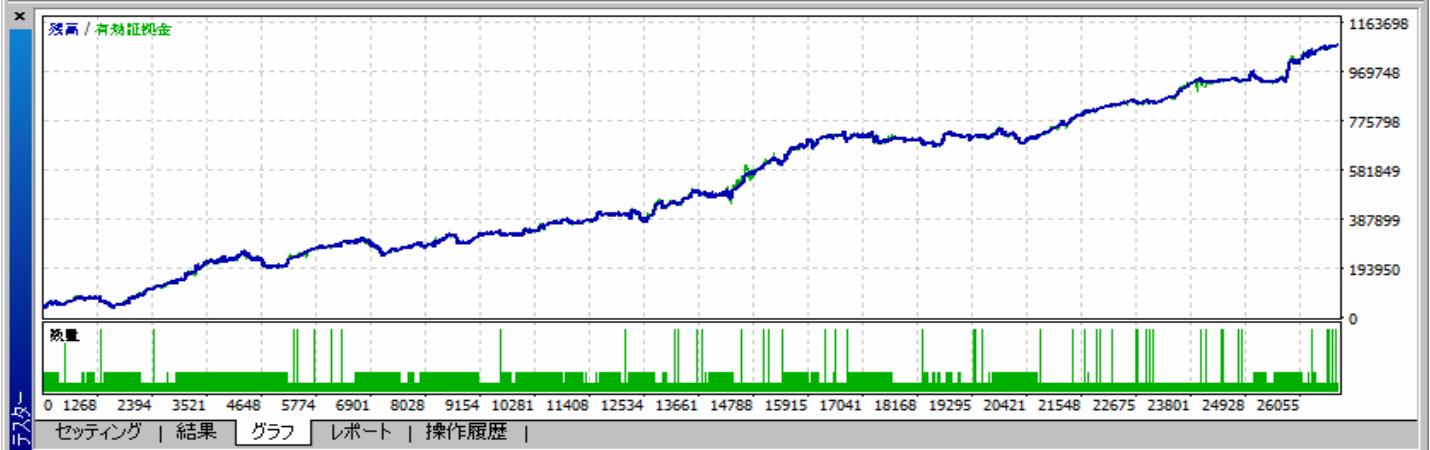
リスクレベル5



リスクレベル6

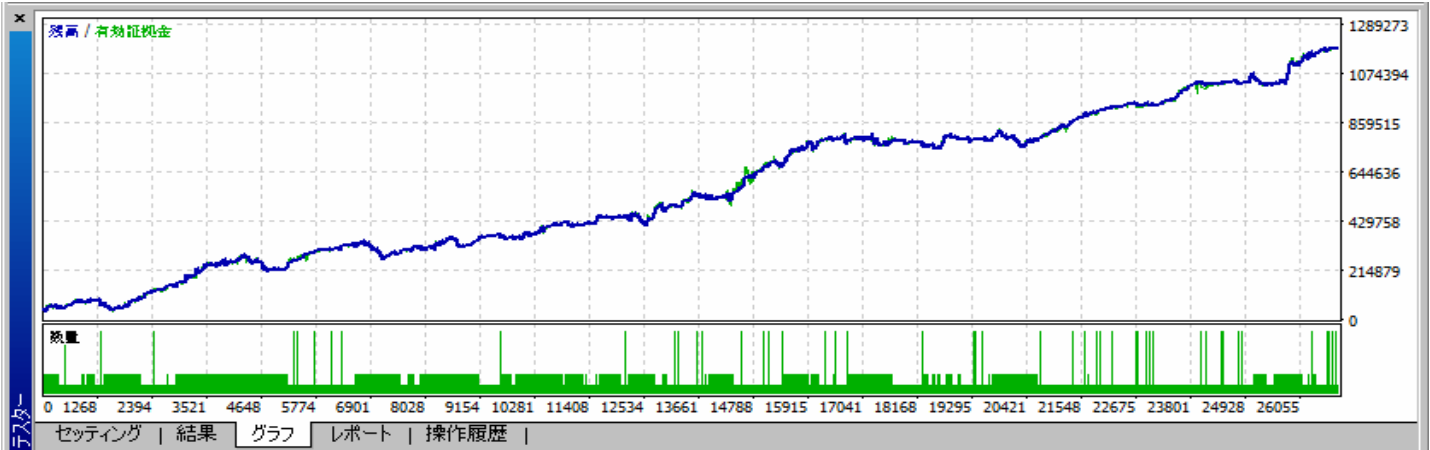


リスクレベル7



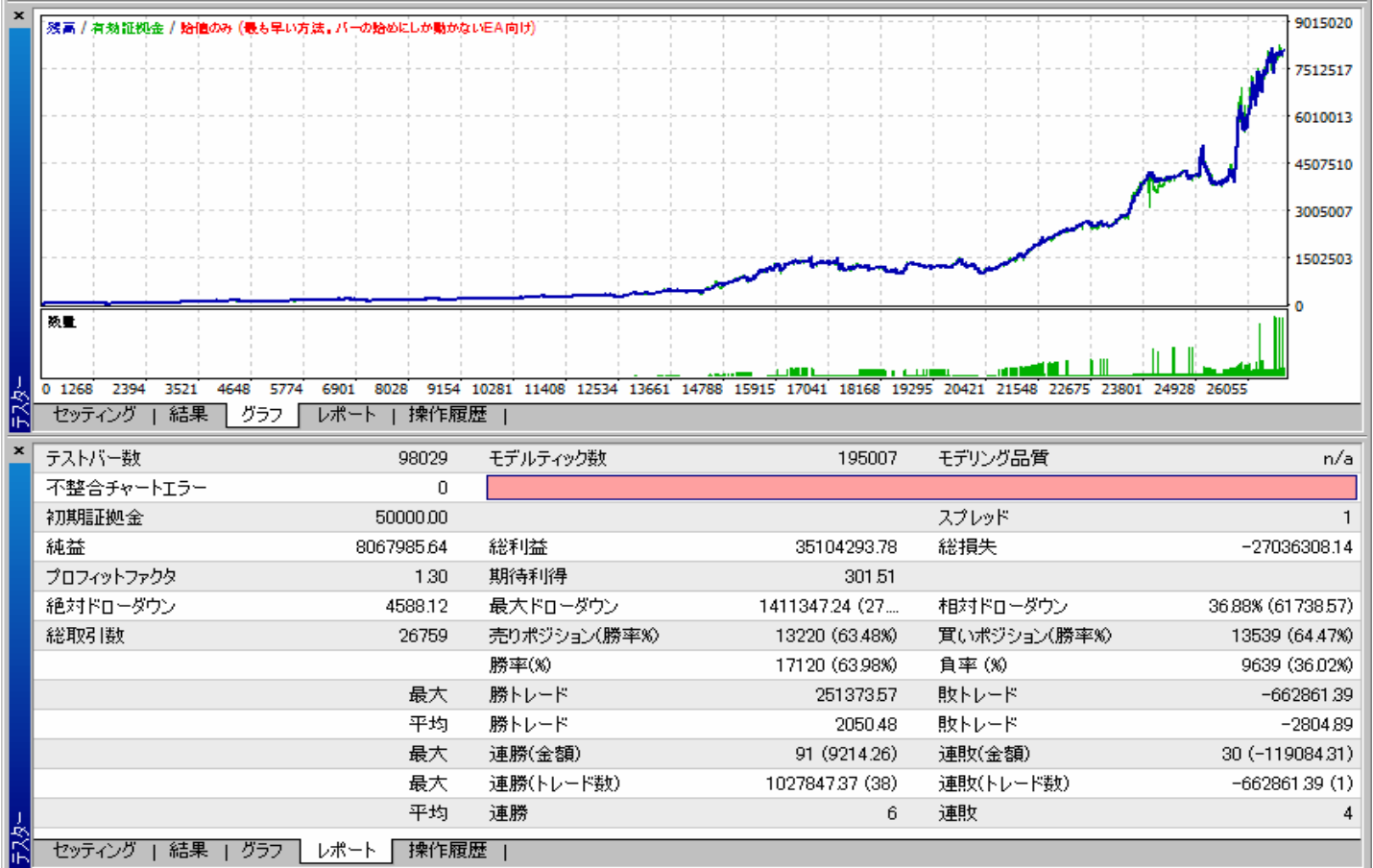
テストバー数	98028	モデルティック数	195005	モデリング品質	n/a
不整合チャートエラー	0				
初期正現金	50000.00			スプレッド	1
純益	1023533.37	総利益	5089121.74	総損失	-4065588.37
プロフィットファクタ	1.25	期待利得	38.25		
絶対ドローダウン	9298.68	最大ドローダウン	76983.99 (10.12%)	相対ドローダウン	55.17% (50374.71)
総取引数	26759	売りポジション(勝率%)	13220 (63.48%)	買いポジション(勝率%)	13539 (64.47%)
		勝率(%)	17120 (63.98%)	負率(%)	9639 (36.02%)
	最大	勝トレード	14905.83	敗トレード	-14685.99
	平均	勝トレード	297.26	敗トレード	-421.79
	最大	連勝(金額)	91 (10638.67)	連敗(金額)	30 (-14715.88)
	最大	連勝(トレード数)	35399.50 (38)	連敗(トレード数)	-24984.16 (25)
	平均	連勝	6	連敗	4

リスクレベル8



テストバー数	98029	モデルティック数	195007	モデリング品質	n/a
不整合チャートエラー	0				
初期正現金	50000.00			スプレッド	1
純益	1138685.24	総利益	5662367.27	総損失	-4523682.02
プロフィットファクタ	1.25	期待利得	42.55		
絶対ドローダウン	10346.42	最大ドローダウン	85658.02 (10.19%)	相対ドローダウン	58.41% (56050.96)
総取引数	26759	売りポジション(勝率%)	13220 (63.48%)	買いポジション(勝率%)	13539 (64.47%)
		勝率(%)	17120 (63.98%)	負率(%)	9639 (36.02%)
	最大	勝トレード	16585.36	敗トレード	-16340.76
	平均	勝トレード	330.75	敗トレード	-469.31
	最大	連勝(金額)	91 (11837.43)	連敗(金額)	30 (-16374.01)
	最大	連勝(トレード数)	39388.07 (38)	連敗(トレード数)	-27799.29 (25)
	平均	連勝	6	連敗	4

リスクレベル9



リスクレベル10

