

EA仕様書 (Expert Advisor)

基本設計書 ver0.2 (Taro)

Gold vs US Dollar - 15 . 2,911.855 高値2,913.220 安値2,910.938 終値2,913.019 +1.142 (+0.04%)

EMA 5 close 0

EMA 21 close 0

MA 21 close 0

MA 9 close 0

BB 20 1 2,908.868 2,913.558 2,904.177

BB 20 2 2,908.868 2,918.249 2,899.486

EMA 120 close 0

Pivots Traditional Daily 3

Pivots Traditional Weekly 3



06:00 09:30 12:00 15:00 18:00 21:00 15 03:00 17 12:00 15

2,942.000
2,940.000
2,937.500
2,935.000
2,932.500
2,930.272
2,927.500
2,925.000
2,922.500
2,920.000
2,917.500
2,915.000
2,913.179
2,913.019
2,912.000
2,910.000
2,907.500
2,906.611
2,905.000
2,902.918
2,899.495
2,899.224
2,899.224
2,895.531
2,895.182
2,892.979
2,891.837
2,889.358



概要

- 基本的には、ゴールドとUSDをペアとして作成する
- 順張りでトレードを行う
- EMAとSMAを数本活用する
- BBを活用する
- M15で稼働する
- トレーディングストップを活用する
- 連勝・連敗の概念を取れる
- 資産管理の概念を入れる
- 週・月のトレンドが変化したらメンテナンスを入れる

目次

1. ゴールド (CDF)
2. 順張りトレード
3. EMAとSMA
4. BB (ボリンジャーバンド)
5. M15の足
6. トレーディングストップ
7. 連勝・連敗の概念
8. ロット数の考え方
9. レバレッジの考え方
10. 資産管理
11. トレンド分析
12. EA起動条件
13. 運用例 (チャートより)
14. Exness でのシュミレーション
15. EA終了条件
16. 単利運用と複利運用
17. トレードメッセージ (TMSG)
18. 補足
19. 更新情報

ゴールド (CDF)

- ボラリティの高いゴールドにする
- 市場的にはポンド円よりも大きなボラリティ
- クロス円にも似ている動きをしている
- BTCは似た（逆）動きをするがBTCの方がボラリティが大きい
- ゴールドが値上がりするとドルは円安に傾向になる

順張りトレード

- 基本パーフェクトオーダーの時にフラグを立てせる
- M15が三連続同じ方向に伸びた時にトレードを開始する
- 利確(TP)は\$ 2だが、\$ 1伸びた場合は、損切りも\$ 1あげる
(トレーディングストップ)
- 損切り (LC) は\$ 2
- 指標には参加しない (指標用EAを作成する毎週金曜NYのみ)
カレンダー機能を使いoffにする

EMAとSMA

- 移動平均線 5 EMA (紫)、9 EMA (青)、21 EMA (赤)
- 移動平均線 21 SMA (橙)
- パーフェクトオーダー (上記の4本の線が同じ方向に向き、ワニの口の様に広がる時にフラグを立てる)
- 120 EMA (長期のトレンドを知る為に表示のみ)

EMA と SMA(補足)

- EMS (Exponential Moving Average)
→ 指数平滑移動平均線 (直近に荷重を置く)
- SMA (Simple Moving Average)
→ 単純移動平均線 (均等に荷重を置く)

BB（ボリンジャーバンド）

- BBの 1σ と 2σ の間にいると時と定義する（96%）
 - ± 1σ （標準偏差）範囲内に約68.26%基データが集まる
（薄いグレー）
 - ± 2σ （標準偏差）範囲内に約95.44%基データが集まる
（濃いグレー）
 - ± 3σ （標準偏差）範囲内に約99.74%基データが集まる
- バンドウォークの時に外れるケースがある

※短期20を活用予定

（長期50と掛け合わせればトレンドが読める）

M15の足

- M15の足でEAのプログラムを走らせる
- 15分間の高値と安値に耐えられる資金管理が必要となる
(最大ダウンロード)

トレーディングストップ1

トレーリングストップの例



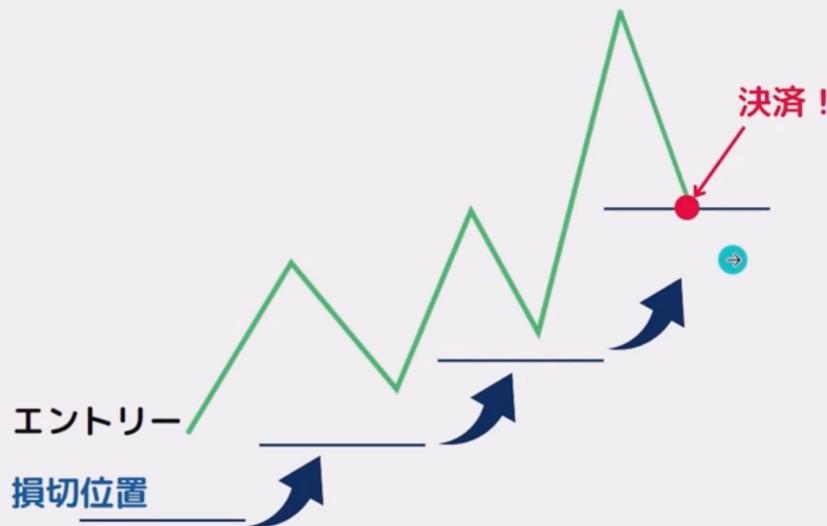
相場が有利な方向に
動いたため、損切位置
をさらに更新
利益を伸ばすことが
できる

トレーディングストップ2

トレーリングストップのメリット

例) トレーリングストップの場合

利確位置

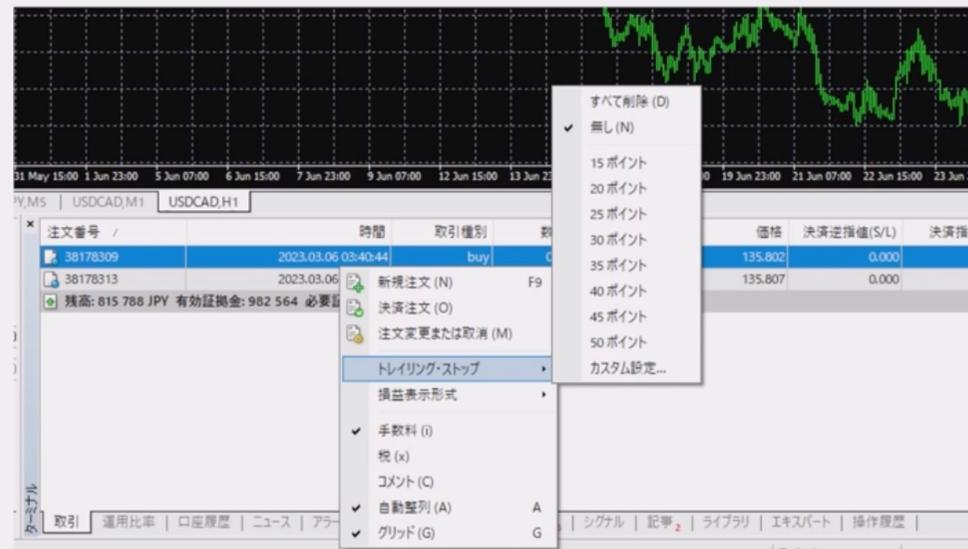


損切位置がどんどん切り上げられるため、利益を伸ばすことができる

トレーディングストップ3

MT4のトレーリングストップ

ターミナル→取引→ポジション右クリック→トレイリングストップ
から設定可能

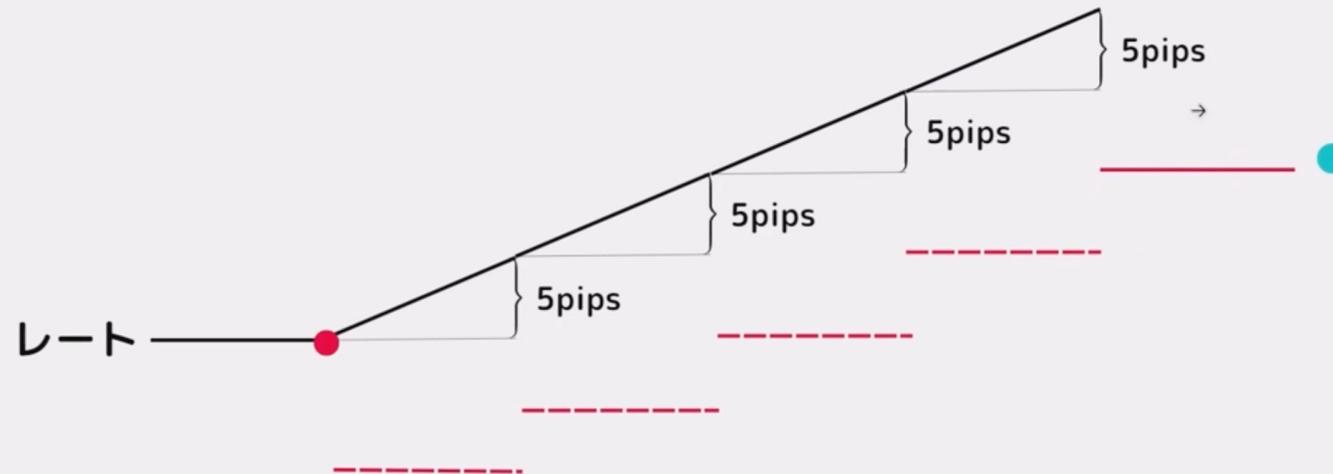


トレーディングストップ4

トレーリングストップのパラメータ

【パラメータ1】 初期損切pips : 10pips

【パラメータ2】 トレール幅 : 5pips

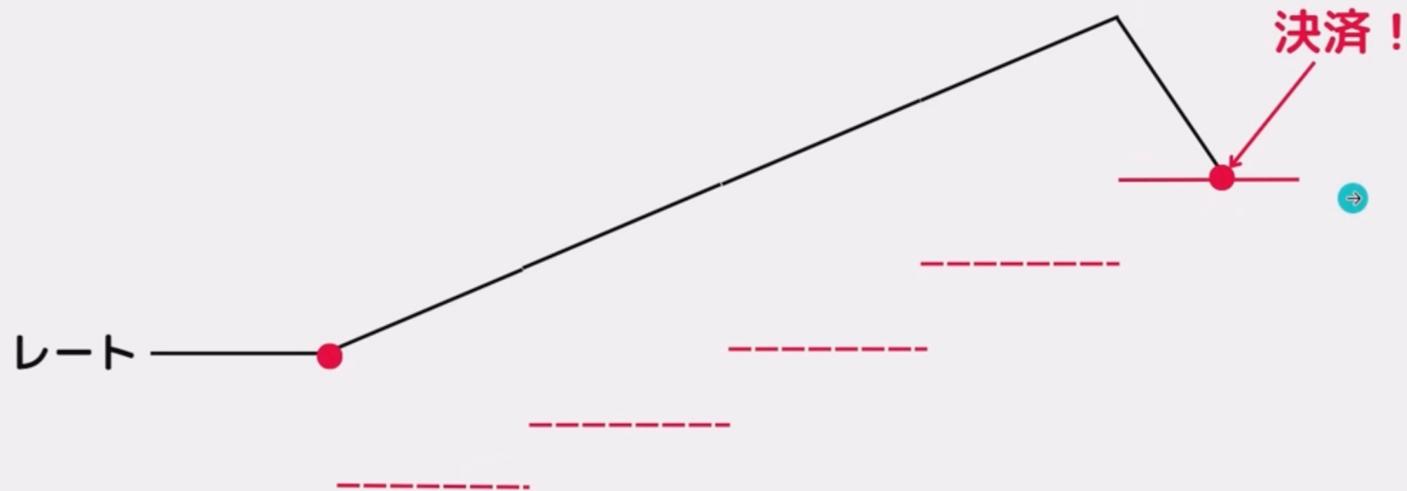


トレーディングストップ5

トレーリングストップのパラメータ

【パラメータ1】 初期損切pips : 10pips

【パラメータ2】 トレール幅 : 5pips



連勝・連敗の概念

- トレードの結果を変数においておき、勝ち（負け）の連続数を管理する
- 連勝・連敗した時の総資産を計算する
- 三連敗した場合、その日のトレードは終了する（初期設定）
- 連勝した場合は、その日は五連勝までです（初期設定）
- ナンピンやマーチング理論は現在取り入れない

ロット数の考え方

- ロット数は総資産の1%とする

Ex.

100,000JPYならば $0.1 = 1,000$ JPY (最小資金設定値)

50,000JPYならば $0.05 = 500$ JPY

1,000,000JPYならば $1.0 = 10,000$ JPY

レバレッジの考え方

- EAの設計上レバレッジは200とする
- 該当証券会社はExness デフォルト200
- 国内証券会社では25までしか設定できない為、
仮に国内証券会社を活用する場合は、
最低資金設定値の8倍が必要となる (800,000JPY)

資産管理

- EAの日次JOBに総資産の計算をする
- 資産の1%をロット数とする
(100,000JPYの場合は1,000JPY=0.1ロット)
- リバレッジはExnessに合わせる
- 基本複利運用とする
- 資産が半分になったら、自動停止する（連勝・連敗に紐付け）
- 現金化は基本週1とする（出金可能日よ可能額）
- 元金+利益（この利益分半分まで出金可能とする）
- 上記の情報をLineで通知（毎日特定の時間に）する

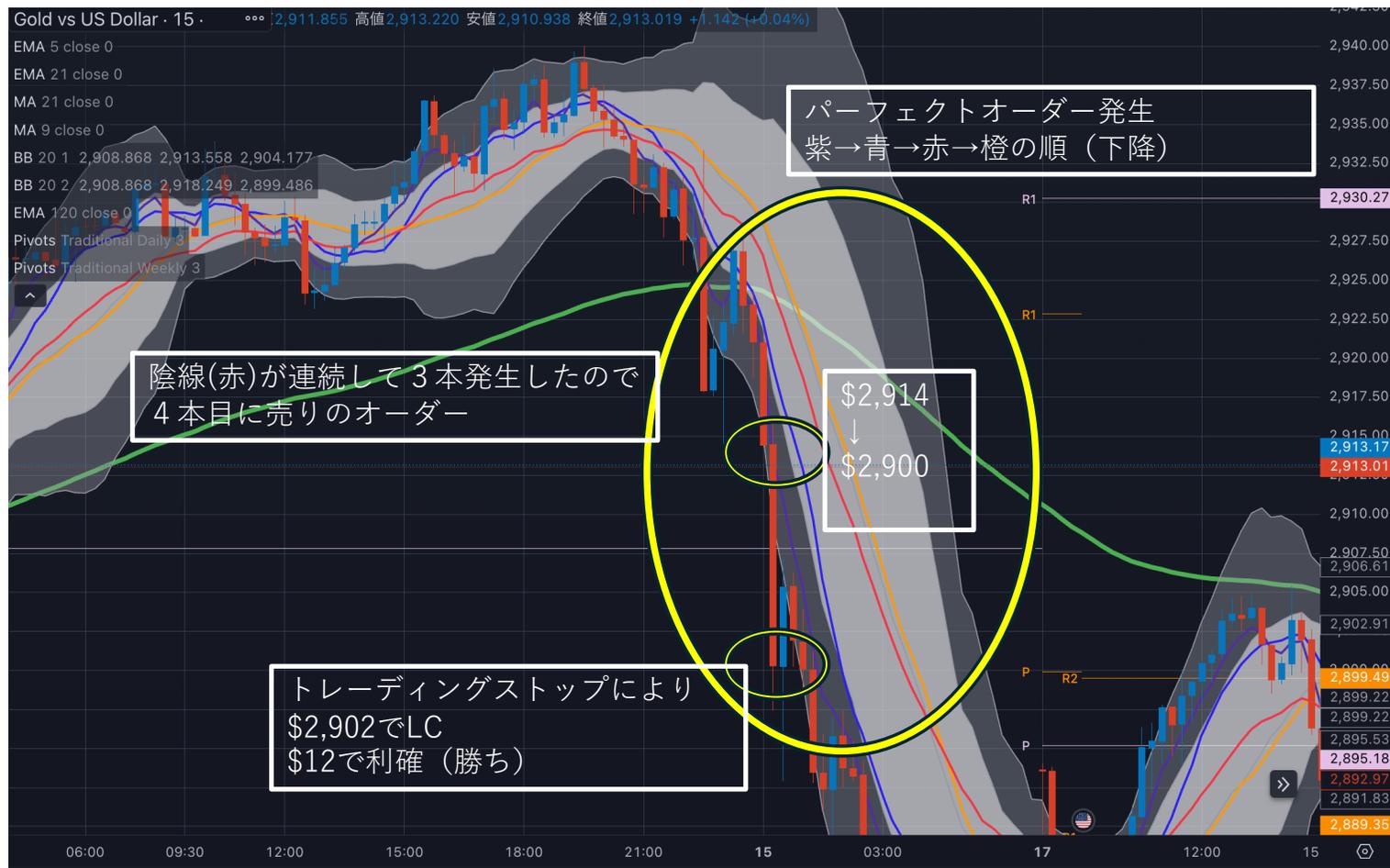
トレンド分析

- 勝率を計算し、勝ち傾向・負け傾向を判断する
(Daily Pivots・Weekly Pivotsを活用する表示のみ)
- 資産を減らさない51%を最低ラインと考える
- PFは2.0を目指す (バックテスト)
- どの何が悪いかを分析する
- 修正した場合は、バックテストを行う (過去20年分)
- 勝っているEAを参考にする (自分の環境でテストする)
- ある一定利益が出たら、他のペア、逆張りのEAも稼働させる

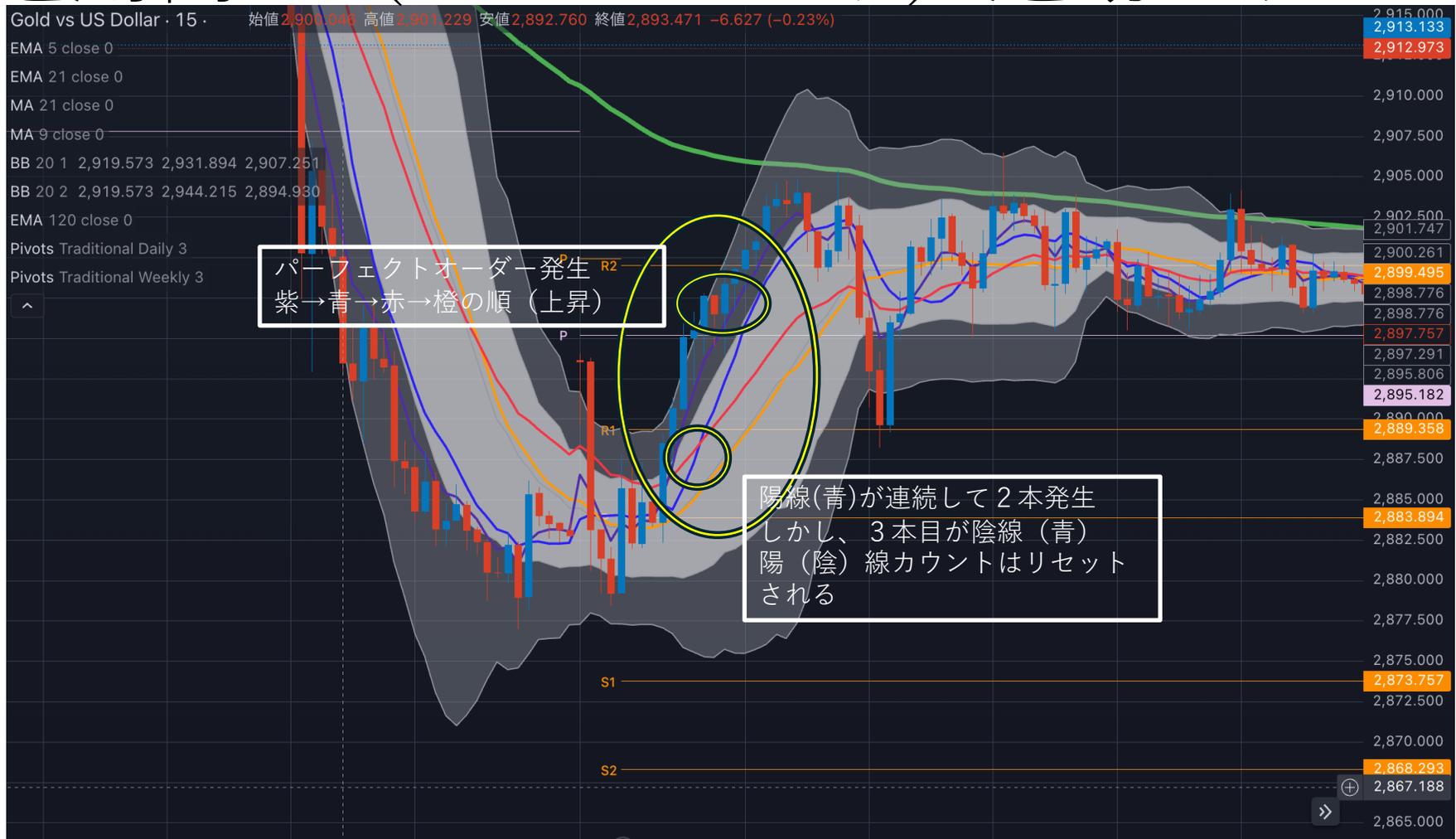
EA起動条件

- M15の陽陰線が3本連続同じ方向に動く時、
終値がBBの2σ内にいた時、
4本目のM15初値で買い／売りをオーダーする
- パーフェクトオーダーの場合
(下記の順番に並ぶ時、上昇トレンドの時)
5EMA(紫)→9EMA(青)→21EMA(赤)→21SMA(橙)
- TP(Take Profit)は\$2とする(初期設定)
- LC(Lost Cut)は\$2とする(初期設定)
- M15が伸びそうな場合は、
トレーディングストップ機能を用いて利益を伸ばす
+\$2(\$1.99)に近づいたら更にTPとLCを+\$1に値を修正する
(買いの場合)

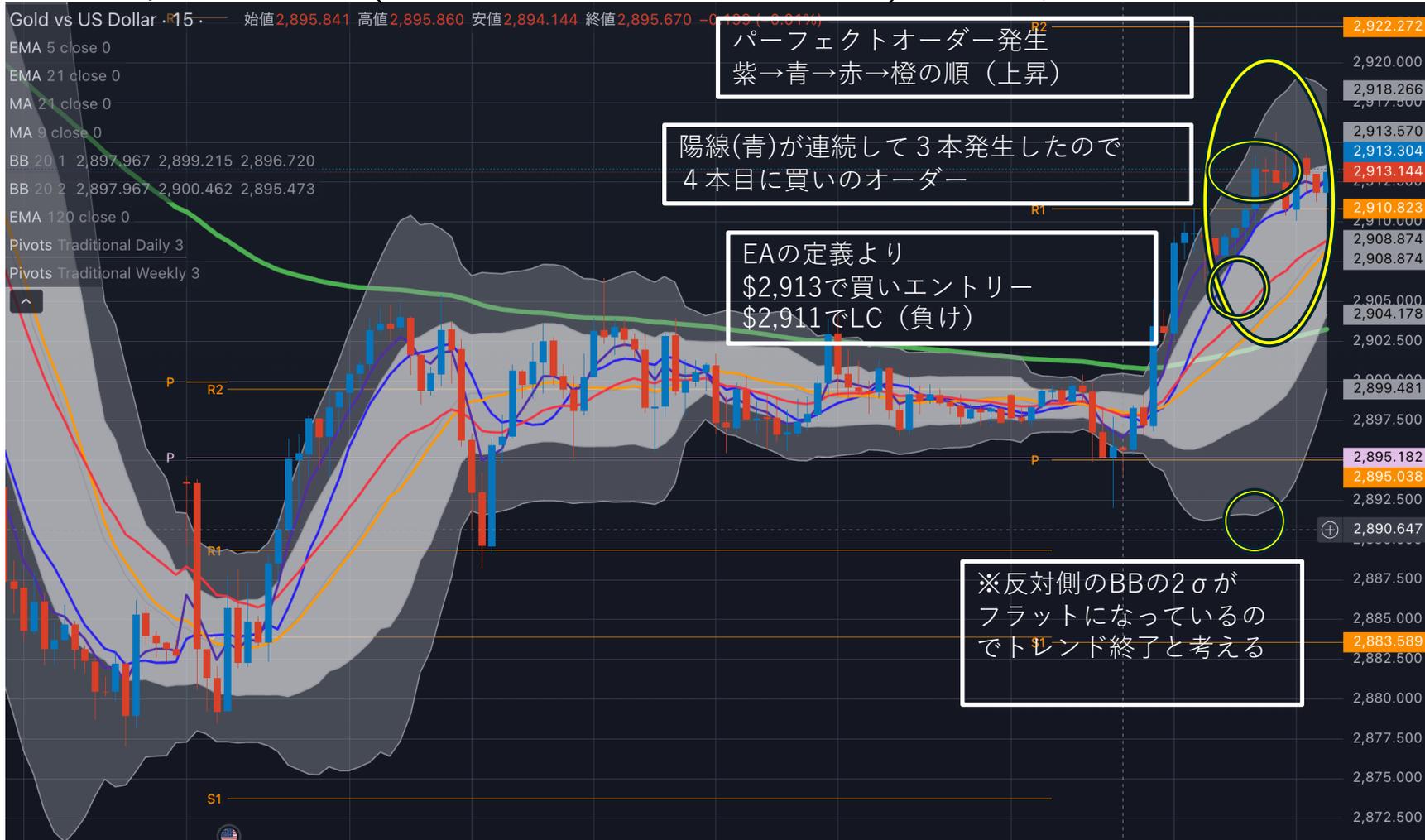
運用例 1 (チャートより) 勝ち



運用例 2 (チャートより) 起動せず



運用例3 (チャートより) 負け



Exness でのシュミレーション

- EAが通常起動した場合、一回の勝利では以下の通りになる
- 100,000JPYでリバレッジ200で0.1ロットでエントリーした場合
→\$2(150JPYの時)勝ちした場合

$$200 \times 0.1 \times 2 \times 150 = 6,000\text{JPY}$$

- 運用例 1 の場合
 $200 \times 0.1 \times 12 \times 150 = 36,000\text{JPY}$

- 運用例 3 の場合
 $200 \times 0.1 \times (-2) \times 150 = -6,000\text{JPY}$

EA終了条件

- LCが\$2になった時（1取引終了）
- 三連敗した時にEAは止まる
（負け続けた場合は都度、総資産の計算をする）
- 総資産が半分になった時
（起動時の総資産を保持しておく）

単利運用と複利運用

- EAの設計上複利運用とする
- 起動時の総資産から倍になった場合、利確を案内（MGSなし）
100,000JPYが200,000JPYになった場合
100,000JPYの1/2の50,000JPYを現金化もしくはBTCへ変える
- 海外証券会社を運用する場合、常に現金化や他の資産に変更できるか確認しておく
- もしくは、1週間に一回、利益の1/2を他の資産に変える様にする（1日1回トレードメッセージの設定）

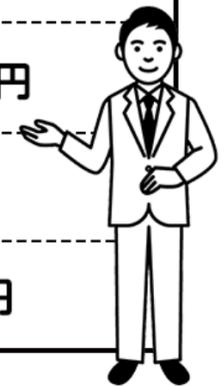
トレードメッセージ (TMSG)

- 1日1回トレードの結果のメッセージを受け取る
- Lineを活用する (受取り側個別設定)
- 1日の単位はNYとする
- 4:00~3:59 (翌日)
- TMSGの内容は以下の通り
日付、総資金、取引回数 (勝ち/負け) 、勝ち金額、負け金額
トータル金額(勝ち/負け額)

補足

1 pipsいくら？計算方法を解説

PIPS	銭	円
0.1 pips	0.1 銭	0.001 円
1 pips	1 銭	0.01 円
10 pips	10 銭	0.1 円
100 pips	-	1 円
1000 pips	-	10 円



更新情報

- 基本設計書 ver0.1 (Taro) 2025/02/07
- 基本設計書 ver0.2 (Taro) 2025/02/20