

投資戦略フェアEXPO2020

「FX自動売買ソフトの選択とデザイン」

2020.09.26

AMSER(アムサール)株式会社 代表取締役

株式会社トリロジー 取締役

林 貴晴 / TACA

プロフィール

- 2010年 FX開始
 - 2016年 EA販売開始
 - 販売期間5カ月でEA売上約1000万円
 - 約2000本のEAを開発
 - 2017年 助言会社部長職
 - 2018年 EA開発専門会社 AMSER株式会社創業
 - 2020年 株式会社TRILOGY 取締役就任
- 他4社取締役 2社在籍

FX自動売買ソフトの選択とデザイン

選択（EAの選
び方）

はじめに

バックテスト

運用

デザイン（EA
の作り方）

仲値EA

情報収集と試験

無料EAについて

FX自動売買ソフトの選択

はじめに

- E A の選び方
 - データを公開している
 - ポジションが一つの E A
 - 安全性が高い物を選ぶ

FX自動売買ソフトの選択

- 試験の種類
 - バックテスト 過去データで行う試験
 - フォワードテスト デモ口座や運用口座で実際に動かす試験
- 重要なのはバックテスト
 - フォワードテストは試験期間・回数が少ない
 - フォワードテストは業者や運用環境の差がでる

バックテストとフォワードテスト

	バックテスト	フォワードテスト	
期間	長期	短期	試験期間が短いと取引数が少なくなりデータにむらが出る
スリッページ	無し	ある	スリッページは業者や環境で変わる
スプレッド	固定	変動	スプレッドは業者や環境で変わる
スパイク	無し	ある	スパイクの発生は業者や環境で変わる

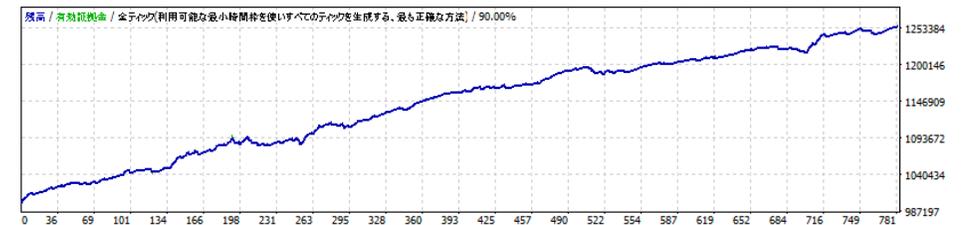
FX自動売買ソフトの選択

バックテスト

- ロットと最大ドローダウン
- 0.1ロットで50,000以下

Strategy Tester Report TurtleDove_UJ_M15 SaxoBank-Live (Build 1280)

通貨ペア	USDJPY.fx (US Dollar vs Japanese Yen)				
期間	15分足(M15) 2015.01.02 03:00 - 2020.09.10 12:00 (2015.01.01 - 2020.09.30)				
モデル	全ティック (利用可能な最小時間枠による最も正確な方法)				
パラメーター	MAGIC=11501; <u>LOT=0.1</u> ; SPREAD=20;				
テストバー数	139239	モデルティック数	131988112	モデリング品質	90.00%
不整合チャートエラー	1				
初期証拠金	1000000.00	スプレッド	現在値 (3)		
純益	256060.00	総利益	523880.00	総損失	-267820.00
プロフィットファクタ	1.96	期待利得	328.28		
絶対ドローダウン	480.00	最大ドローダウン	16450.00 (1.50%)	相対ドローダウン	1.50% (16450.00)
総取引数	780	売りポジション(勝率%)	418 (75.60%)	買いポジション(勝率%)	362 (76.24%)
		勝率(%)	592 (75.90%)	負率(%)	188 (24.10%)
		最大 勝トレード	3000.00	敗トレード	-4030.00
		平均 勝トレード	884.93	敗トレード	-1424.57
		最大 連勝(金額)	23 (12830.00)	連敗(金額)	4 (-7740.00)
		最大 連勝(トレード数)	17340.00 (10)	連敗(トレード数)	-9130.00 (3)
		平均 連勝	4	連敗	1



FX自動売買ソフトの選択

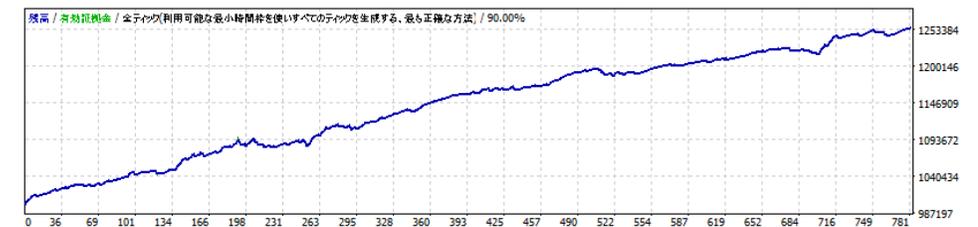
- バックテスト
 - 勝率
 - 平均勝／敗トレード

Strategy Tester Report

TurtleDove_UJ_M15

SaxoBank-Live (Build 1280)

通貨ペア	USDJPY.fx (US Dollar vs Japanese Yen)				
期間	15分足(M15) 2015.01.02 03:00 - 2020.09.10 12:00 (2015.01.01 - 2020.09.30)				
モデル	全ティック (利用可能な最小時間枠による最も正確な方法)				
パラメーター	MAGIC=11501; LOT=0.1; SPREAD=20;				
テストバー数	139239	モデルティック数	131988112	モデリング品質	90.00%
不整合チャートエラー	1				
初期証拠金	1000000.00	スプレッド	現在値 (3)		
純益	256060.00	総利益	523880.00	総損失	-267820.00
プロフィットファクタ	1.96	期待利得	328.28		
絶対ドローダウン	480.00	最大ドローダウン	16450.00 (1.50%)	相対ドローダウン	1.50% (16450.00)
総取引数	780	売りポジション(勝率%)	418 (75.60%)	買いポジション(勝率%)	362 (76.24%)
		勝率(%)	592 (75.90%)	負率(%)	188 (24.10%)
		最大 勝トレード	3000.00	最大 敗トレード	-4030.00
		平均 勝トレード	884.93	平均 敗トレード	-1424.57
		最大 連勝(金額)	23 (12830.00)	最大 連敗(金額)	4 (-7740.00)
		最大 連勝(トレード数)	17340.00 (10)	最大 連敗(トレード数)	-9130.00 (3)
		平均 連勝	4	平均 連敗	1



FX自動売買ソフトの選択

運用

- エンドポイントを決める
 - いつまで使用するか
 - どうなったら中止するか
- エンドポイント時の利益・DDを想定する
- 途中経過をあまり気にしない

重要

FX自動売買ソフトのデザイン

- 仲値の E A

- 仲値とは

- 金融機関がその日一日の基準レート決める

- 9時55分の価格を参考にする

FX自動売買ソフトのデザイン

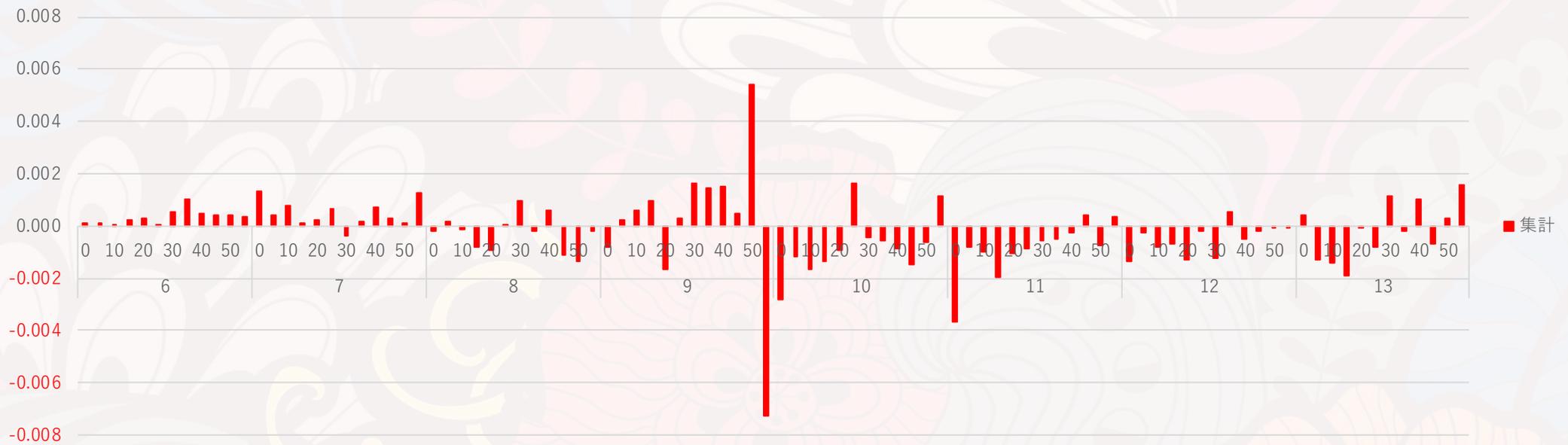
- 情報収集と試験

- 情報①

- 仲値は銀行の公示価格を決める時間
 - 仲値の前はドル円が上がる

検証) 仲値の前はドル円が上がる?

過去14年の時間別増減



FX自動売買ソフトのデザイン

- 基礎ロジック

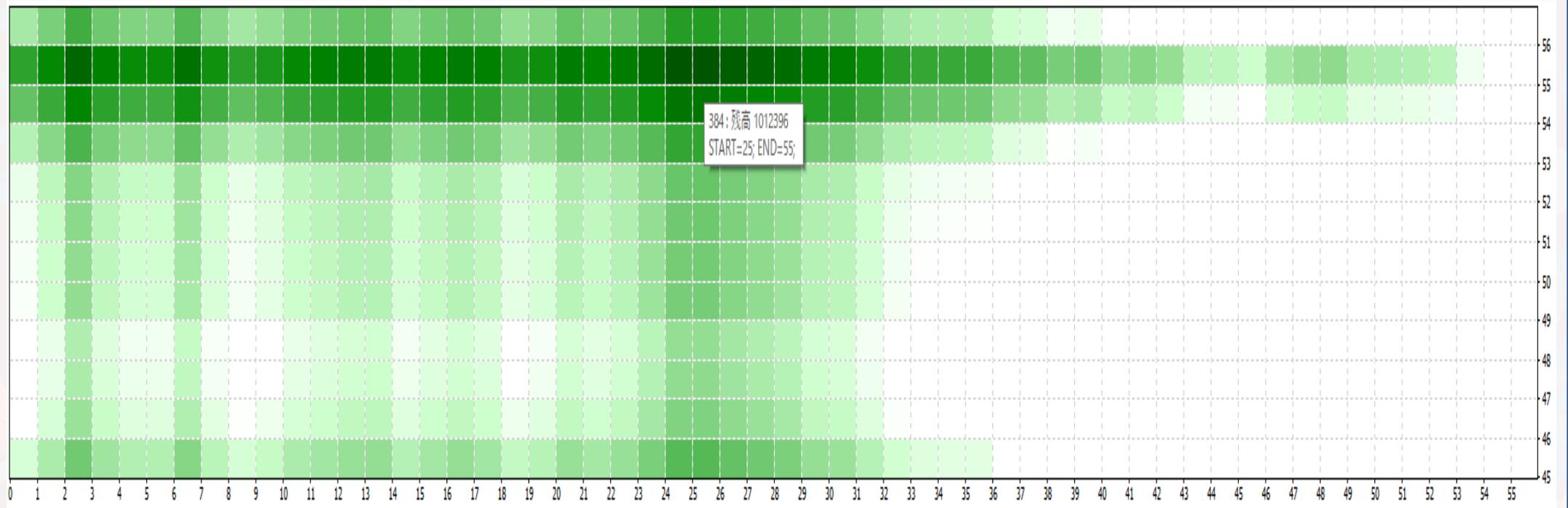
- ① 9：55までの上昇
- ② 9：55からの下降

- MT4で検証

- ① 上昇時間の利益を効率よく稼ぐには何時にエントリー？
- ② 下降時間の利益を効率よく稼ぐには何時にクローズ？

検証) 上昇何時にエントリー？

2015.1.1-2020.7.31 損益グラフ (色の濃いところが最も利益の出た場所)



9 : 25 B U Y 9 : 55 E X I T

0.01ロット
(約4-5,000円)
2005年から試験

初期証拠金	1000000.00	スプレッド	4
純益	32448.00 総利益	151317.00 総損失	-118869.00
プロフィットファクタ	1.27 期待利得	8.11	
絶対ドローダウン	80.00 最大ドローダウン	3756.00 (0.37%) 相対ドローダウン	0.37% (3756.00)
総取引数	4003 売りポジション(勝率%)	0 (0.00%) 買いポジション(勝率%)	4003 (54.18%)
	勝率(%)	2169 (54.18%) 負率(%)	1834 (45.82%)
	最大 勝トレード	757.00 敗トレード	-754.00
	平均 勝トレード	69.76 敗トレード	-64.81
	最大 連勝(金額)	12 (930.00) 連敗(金額)	10 (-482.00)
	最大 連勝(トレード数)	1424.00 (9) 連敗(トレード数)	-1021.00 (4)
	平均 連勝	2 連敗	2



検証) 下降何時にクローズ?

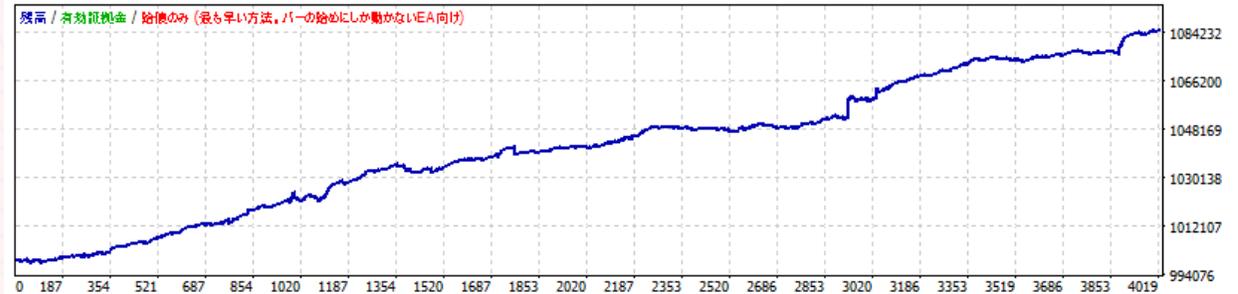
• 結果

2:55 SELL

4:44 EXIT

	利益	勝率	ドローダウン
仲値前	32,448	54.18%	3,756
仲値後	84,898	55.23%	5,660

テストバー数	5734288	モデルティック数	11466126	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	1000000.00		スプレッド	4	
純益	84898.00	総利益	283246.00	総損失	-198348.00
プロフィットファクタ	1.43	期待利得	21.15		
絶対ドローダウン	1662.00	最大ドローダウン	5660.00 (0.55%)	相対ドローダウン	0.55% (5660.00)
総取引数	4014	売りポジション(勝率%)	4014 (55.23%)	買いポジション(勝率%)	0 (0.00%)
		勝率(%)	2217 (55.23%)	負率(%)	1797 (44.77%)
		最大 勝トレード	6591.00	敗トレード	-3456.00
		平均 勝トレード	127.76	敗トレード	-110.38
		最大 連勝(金額)	16 (1160.00)	連敗(金額)	10 (-742.00)
		最大 連勝(トレード数)	7333.00 (4)	連敗(トレード数)	-3456.00 (1)
		平均 連勝	2	連敗	2



FX自動売買ソフトのデザイン

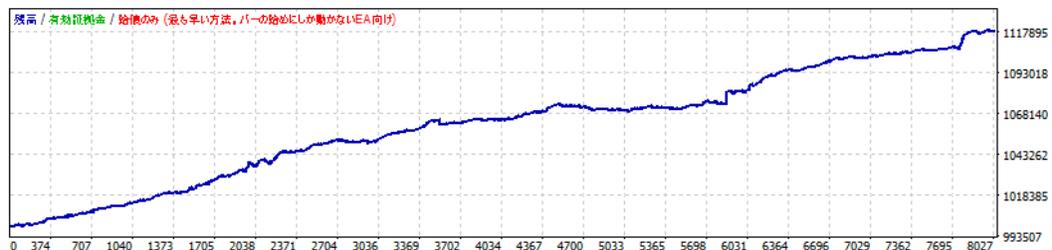
- ここまで
情報) 仲値前はドル円が上昇する



結果) 9:25 BUY 9:55 EXIT

さらに発見
9:55 SELL 11:44 EXIT

テストバー数	5734292	モデルティック数	11466134	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	1000000.00	スプレッド			4
純益	118584.00	総利益	434197.00	総損失	-315613.00
プロフィットファクタ	1.38	期待利得	14.79		
絶対ドローダウン	544.00	最大ドローダウン	4702.00 (0.45%)	相対ドローダウン	0.45% (4702.00)
総取引数	8017	売りポジション(勝率%)	4014 (55.26%)	買いポジション(勝率%)	4003 (54.21%)
		勝率(%)	4388 (54.73%)	負率(%)	3629 (45.27%)
		最大 勝トレード	6591.00	敗トレード	-3456.00
		平均 勝トレード	98.95	敗トレード	-86.97
		最大 連勝(金額)	13 (1040.00)	連敗(金額)	10 (-1245.00)
		最大 連勝(トレード数)	7702.00 (5)	連敗(トレード数)	-3609.00 (2)
		平均 連勝	2	連敗	2



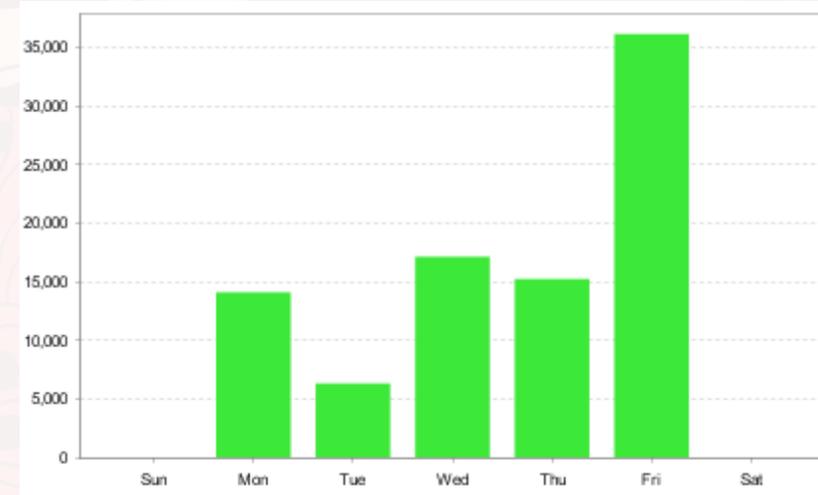
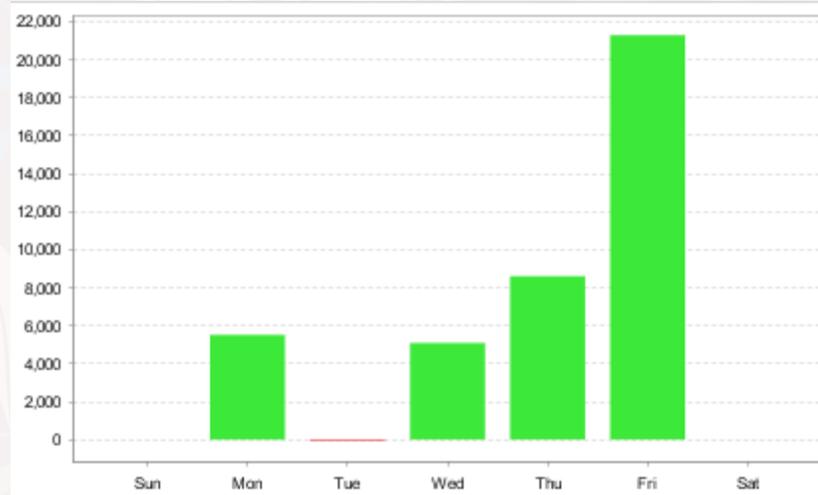
FX自動売買ソフトのデザイン

- 情報収集と試験
 - 土日の両替が前倒しで金曜日になるので金曜日は成績がいい

仲値前後で曜日別検証

仲値前後で曜日別検証

左) 仲値前 右) 仲値後



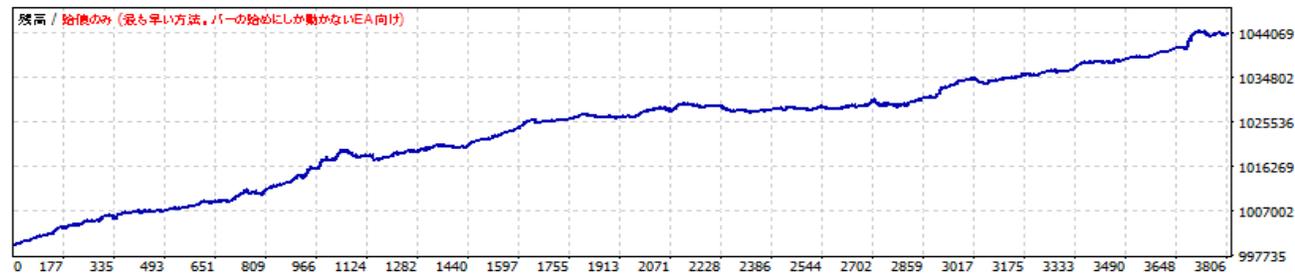
FX自動売買ソフトのデザイン

- 情報収集と試験
 - 銀行休日は両替がないために相場が動かない
※為替相場は動きます
 - 銀行休日、平日の仲値前後を検討

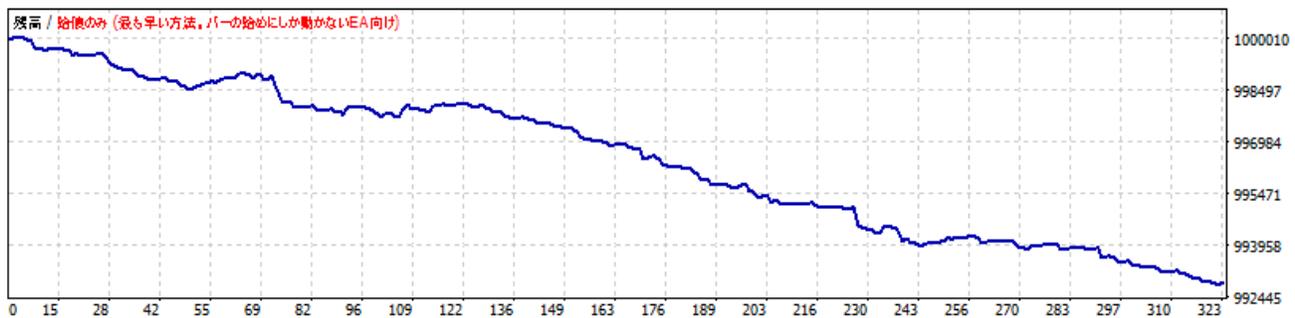
銀行休日、平日の仲値前後を検討

- 仲値前 (上昇)

平日



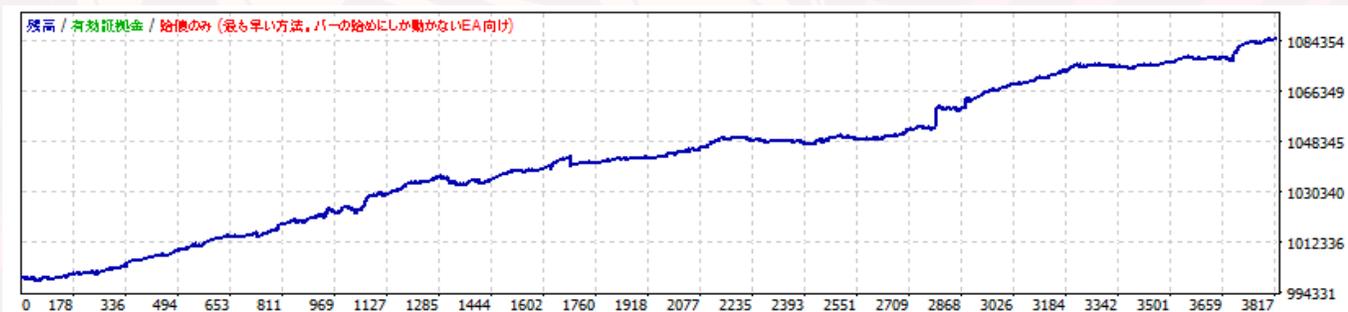
祝日



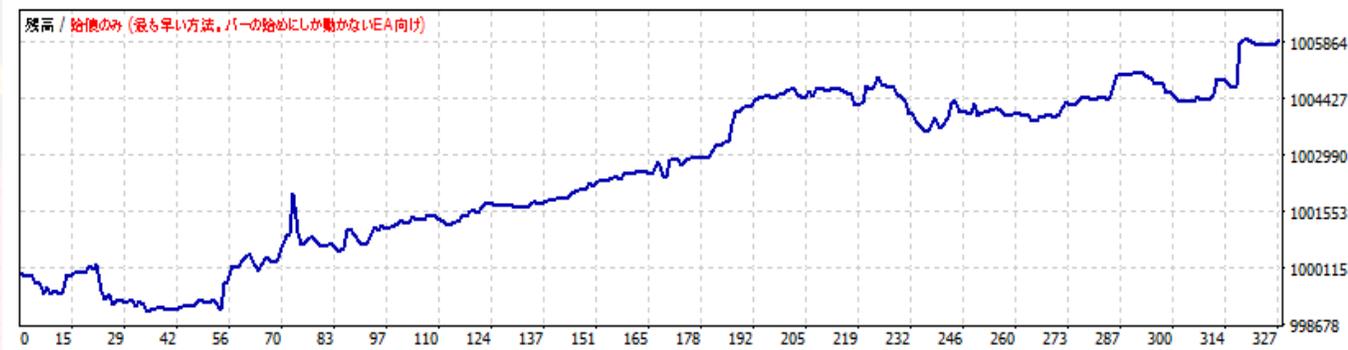
銀行休日、平日の仲値前後を検討

- 仲値後 (下降)

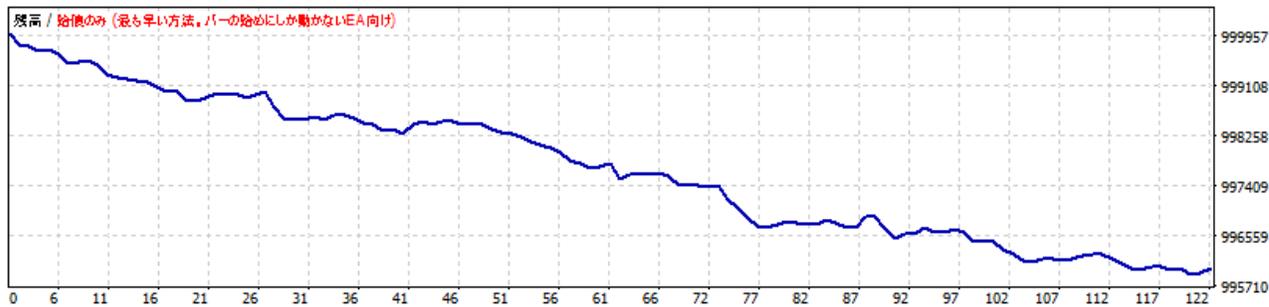
平日



祝日

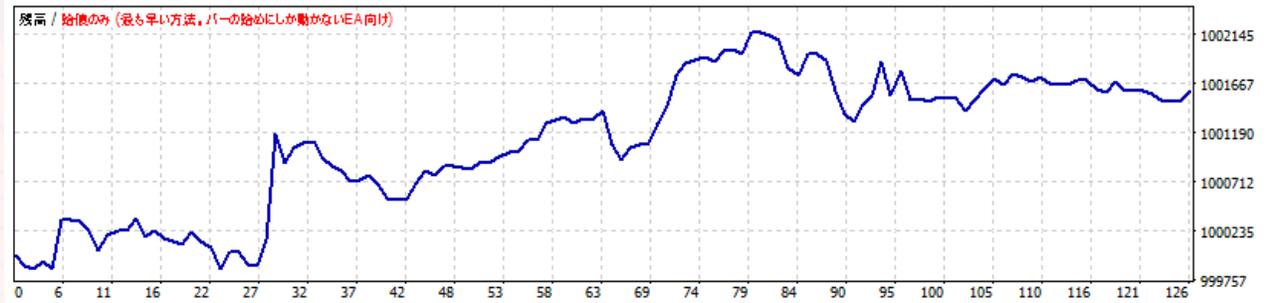


アメリカの祝日は？



仲値前
(上昇)

仲値後
(下降)

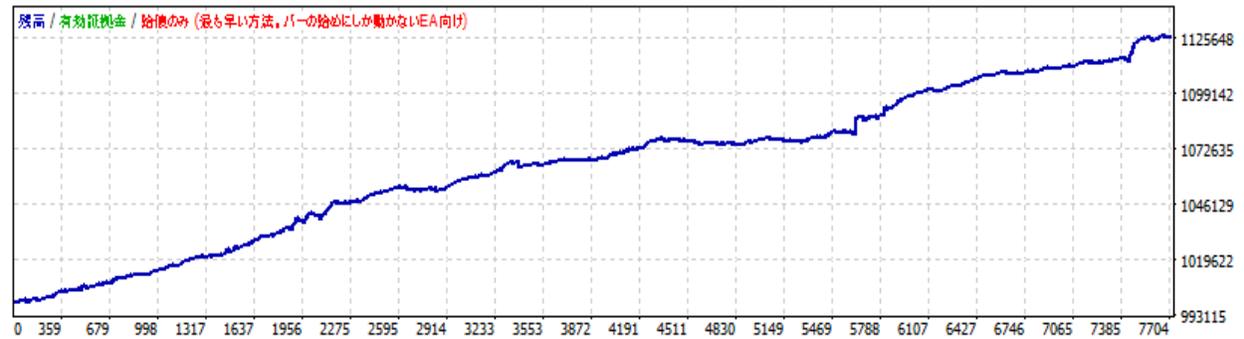


日米 祝日の影響

	平日	国民の休日	NATIONAL HOLIDAY
仲値前	○	✕	✕
仲値後	○	○	△

	利益	ドローダウン
仲値前 + 仲値後	118,584	4,702
休日考慮	126,339	4,014

初期証拠金	1000000.00	スプレッド	4
純益	126339.00	総利益	429003.00
総損失	-302664.00	期待利得	16.42
プロフィットファクタ	1.42	絶対ドローダウン	574.00
最大ドローダウン	574.00	最大ドローダウン	3976.00 (0.38%)
相対ドローダウン	0.38%	相対ドローダウン	0.38% (3976.00)
総取引数	7694	売りポジション(勝率%)	4014 (55.26%)
買いポジション(勝率%)	3680 (55.71%)	負率 (%)	3426 (44.53%)
最大 勝トレード	6591.00	最大 勝トレード	-3456.00
平均 勝トレード	100.52	平均 勝トレード	-88.34
最大 連勝(金額)	14 (836.00)	最大 連勝(金額)	9 (-586.00)
最大 連勝(トレード数)	7702.00 (5)	最大 連勝(トレード数)	-3609.00 (2)
平均 連勝	2	平均 連勝	2

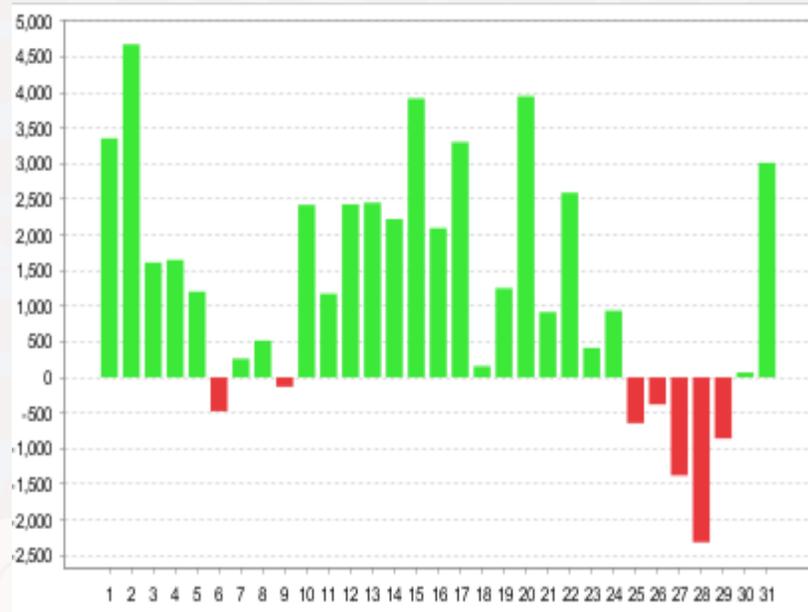


FX自動売買ソフトのデザイン

- 情報収集と試験
 - 十五日（ごとおび）5の倍数の日は締め日が多いのでドルの需要が上がる
 - 月末は輸出業者の両替も入る為 需要が相殺

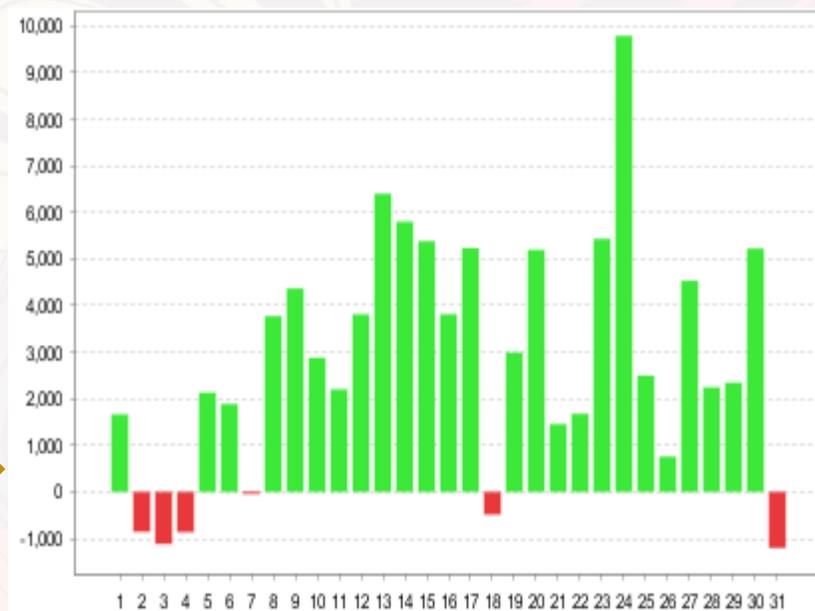
日にち別に仲値前後を検討

日にち別に仲値前後を検討



仲値前
(上昇)

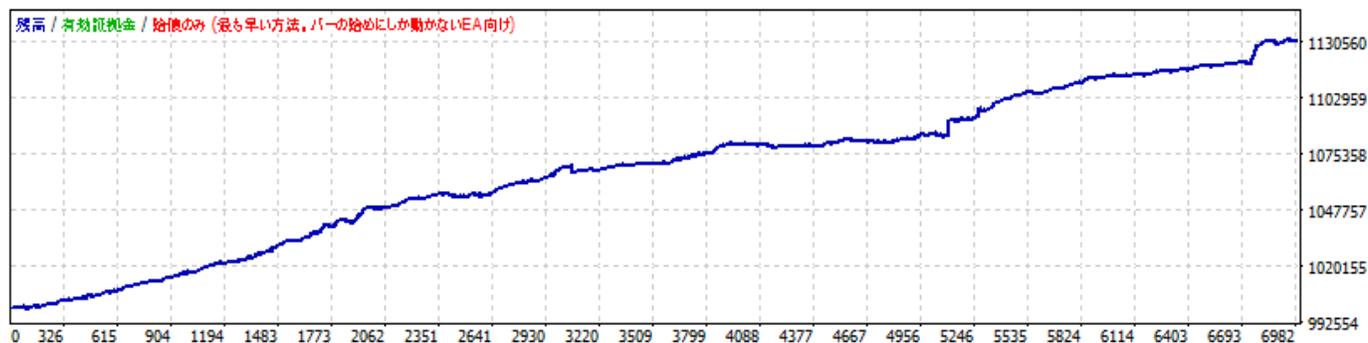
仲値後
(下降)



FX自動売買ソフトのデザイン

	利益	ドローダウン
仲値前	32,448	3,756
仲値後	84,898	5,660
仲値前 + 仲値後	118,584	4,702
休日考慮	126,339	4,014
月末考慮	131,415	3,831

初期証拠金	1000000.00	スプレッド	4
純益	131415.00 総利益	404495.00 総損失	-273080.00
プロフィットファクタ	1.48 期待利得	18.85	
絶対ドローダウン	892.00 最大ドローダウン	3831.00 (0.36%) 相対ドローダウン	0.36% (3831.00)
総取引数	6973 売りポジション(勝率%)	4014 (55.26%) 買いポジション(勝率%)	2959 (58.20%)
	勝率(%)	3940 (56.50%) 負率(%)	3033 (43.50%)
	最大 勝トレード	6591.00 敗トレード	-3456.00
	平均 勝トレード	102.66 敗トレード	-90.04
	最大 連勝(金額)	16 (1174.00) 連敗(金額)	9 (-586.00)
	最大 連勝(トレード数)	8123.00 (6) 連敗(トレード数)	-3609.00 (2)
	平均 連勝	2 連敗	2



FX自動売買ソフトのデザイン

- 成績

最低年利 25%

平均年利 164%

最高年利 295%

MONTHLY PERFORMANCE (\$)

Year	Jan	Feb	Mar	Apr	May	Jun	Jul	Aug	Sep	Oct	Nov	Dec	YTD
2020	301	-769	8645	2178	338	-1548	1926	-575	451	0	0	0	10947
2019	237	217	126	767	-238	1115	773	-105	-17	656	109	818	4458
2018	917	1569	620	-216	1109	356	-276	87	372	518	-270	1309	6095
2017	2643	1443	721	1109	1313	485	-986	882	1594	219	1302	848	11573
2016	1990	-198	-614	327	-791	7498	-162	1010	-174	1069	3511	1265	14731
2015	652	694	-961	255	-649	234	-70	-873	1911	263	99	637	2192
2014	-407	554	-1159	124	200	-46	-35	624	-902	-32	1848	493	1262
2013	1332	584	239	2313	-165	0	3346	933	104	22	81	-109	8680
2012	137	49	890	891	594	-173	295	208	255	-258	883	136	3907
2011	1126	368	613	895	-130	1401	1662	2826	487	-2134	674	329	8117
2010	178	1706	16	-66	-886	40	417	490	-548	556	2162	1654	5719
2009	434	-980	2724	3950	174	-50	500	308	1566	2088	760	-476	10998
2008	710	1460	2192	930	1832	-212	1440	1082	1062	4860	-1196	2648	16808
2007	804	920	-168	2098	1050	942	648	512	308	486	2002	834	10436
2006	-352	1328	600	40	2420	634	1116	632	780	54	1868	330	9450
2005	-112	754	-1016	1292	-318	980	0	1822	426	492	306	1416	6042

プレゼント E A

無料版 (0.01ロット限定/サイト表示/SAXO BANK限定)

<https://amser.co.jp/x.zip>

証拠金 1万円 0.01ロット
推奨エンドポイント 6カ月
中止ポイント -2,000円



製品版 98,000円 (税込み・SAXO BANK限定)

<https://openterrace.jp/detail.html?id=1437>

証拠金 20万円 0.2ロット
推奨エンドポイント 6カ月
中止ポイント -40,000円



プレゼントEAの利用について

- 今回のプレゼント対象EAは、サクソバンク証券でのみご利用可能です。MT4口座を未開設のお客様は、この機会にぜひご検討ください。
- MT4口座開設についての詳細やスプレッド等については、以下で検索またはQRコードをご参照ください。

サクソバンク MT4 検索



- MT4口座の初回入金額は**100万円**

*ご入金後、意図的な出金が原因で口座残高が100万円を下回った場合は、MT4の使用ができなくなる場合がありますのでご注意ください

