

外国為替自動取引システムの構築

富山県立大学工学部電子・情報工学科
1515051 横井稜

指導教員：奥原浩之

1 はじめに

外国為替取引をするのは、リスクがある。どのように為替チャートが変動するかは確実には予想できない。一般に、投資家のうち利益を得ているものは2割程度しかいないと言われているが、その理由は行動心理学によれば、人間心理は損失を拡大させるように働くことが知られている。つまり投資判断において、人間心理によらない客観的なアプローチが必要であるため、近年はアルゴリズムによるシステムトレードが盛んである。

また、最新の市場データの収集、分析、発注までも自動で行うことで、投資活動における人的負担を軽減することができる。自動取引システムとして、既にMetaTraderが存在する。しかし、MetaTraderはMQL言語という独自のプログラム形式を採用しているため汎用性が乏しい。そこで本論文では、FX取引の仲介業者としてOANDAを採用し、リアルタイムの為替データをOANDA REST APIで取得する。REST APIで扱うプログラミング言語としてpythonを用いる。

2 評価指標

この章では、MT5で用いられている評価指標を幾つか抜粋し、その意味と求め方を述べる。図1がMT5の評価指標の例である。プロフィットファクターは、純利益を純損失で割った数値で、リカバリファクターは、ストラテジーの危険性、つまりエキスパートアドバイザーカーが利益を得るために賭ける金額を反映する。これは、利益と最大ドローダウンの割合として計算される。シャープレシオは、戦略の効率と安定性を特徴付ける。これはポジション保持時の算術平均利益とそれからの標準偏差の比を反映している。期待利得は、総純損益を総トレード回数で割った値が表示される。その値は次の取引の期待リターンを表示すると考えられている。ドローダウンは、資金の減り具合を示す。

ヒストリー品質	99%	ティック		
バー	99145	ティック	394854	銘柄
初期証拠金	10 000			1
総損益	4 694	残高絶対ドローダウン	0	証拠金絶対ドローダ...
総利益	64 880	残高最大ドローダウン	6 358 (30....)	証拠金最大ドローダ... 84
総損失	-60 186	残高相対ドローダウン	30.29% (6 ...)	証拠金相対ドローダ... 6 961 (32.2...
プロフィットファクター	1.08	期待利得	2.56	証拠金維持率 440.12%
リカバリファクター	0.67	シャープレシオ	0.03	Z-Score -0.16 (12.7...
AHPR	1.0003 (0.0...	LR Correlation	0.63	OnTester 結果 0
GHPR	1.0002 (0.0...	LR Standard Error	2 203	
取引数	1833	ショート(勝率 %)	929 (25.62...)	ロング(勝率 %) 904 (24.56...
総約定	3666	勝ちトレード(勝率 %)	460 (25.10...)	負けトレード(負率 %) 1373 (74.9...
		最大 勝ちトレード	2 108	負けトレード -634
		平均 勝ちトレード	141	負けトレード -44
		最大 連勝数(金額)	7 (1 580)	連敗数(金額) 21 (-825)
		最大 連勝利益額(数)	2 108 (1)	連敗損失額(数) -1 050 (7)
		平均 連勝数	1	連敗数 4

図1 MT5の評価指標

3 Metatrederとの比較

この章では、MTとOANDAのREST APIを比較する。多くの取引会社ではMT4と呼ばれるツールとExpert Adviserを組み合わせたFXの自動取引の仕組みが導入可能である。MTは移動平均、RSI、ボリンジャー・バンド等、50種類以上のテクニカル指標がある。また、ストラテジーテスターがあり、過去のチャートで、手法を試すことができる。そして、無料または有料で公開されているエキスパートアドバイザーやインジケーターがある。しかし、プログラミング言語としてMQLを用いているので汎用性が乏しい。

次に、REST APIについて説明する。REST APIサービスを利用する事により、自分で開発したトレードツールから、暗号化された通信チャネルを使用し、OANDAのオンライン取引システムへ接続することができる。これにより、為替レートの取得、注文、チャートへのアクセスなどを含む全ての取引機能を利用でき、自動売買するなどの自分の考えた取引環境や取引条件でトレードすることが可能となる。また、プラットフォームやプログラミング言語に依存しない仕様である。しかし、自分で一からシステムを構築する必要がある。

4 外国為替自動取引及び評価システムの構築

前回は、OANDA REST API v1を用いて外国為替自動取引ができるプログラムを作成した[1]。しかし、海外ではOANDA REST API v1のサービスが終了が予告されし、v20への移行が始まっている。したがって、今回は、v20で動作するよう前に作成したプログラムを改良する。また、リアルタイムで10秒足のローソク足チャートおよび移動平均線を表示できるようにした。移動平均線は、終値を用いて作成した。

図2がそのフローチャートである。

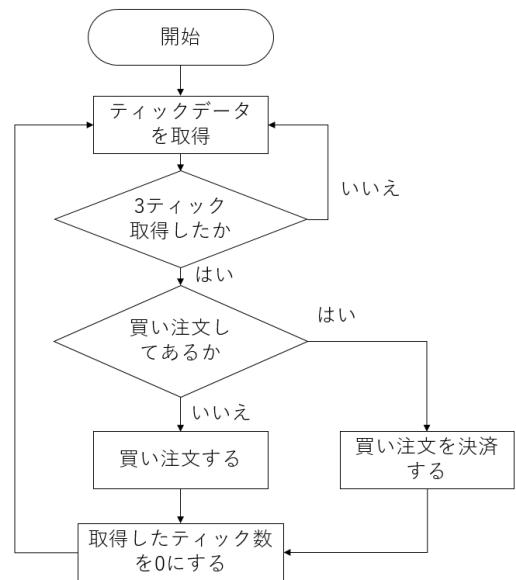


図2 フローチャート

5 実行結果

今回、作成したシステムを実際にデモ口座で運用した。銘柄としては、ドル円とした。図3が、その実行結果である。図3のように、10秒足のローソク足と移動平均線がリアルタイムで表示される。しかし、自分のローソク足はティックデータをohlcの形に直しているだけなので、その前のローソク足と繋がっていない。

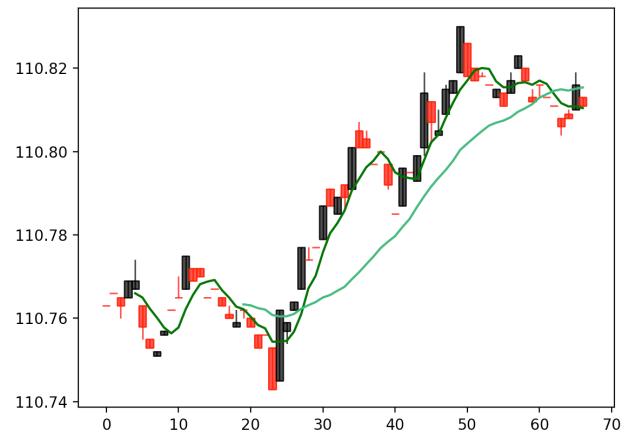


図3 実行結果

6 おわりに

本論文では、外国為替自動取引およびローソク足チャートを描くシステムを構築した。

今後の課題は、評価指標を増やし、戦略性のあるストラテジーを作成することおよびローソク足チャートを改善することである。その改善策として、ローソク足チャートを前回の終値の値を今回の始値の値にすることが挙げられる。

参考文献

- [1] <http://www.algo-fx-blog.com/fx-python-random-simple-trade-system/>