

岡三RSS

カリキュラム

2009年9月版

概要

このカリキュラムは、35日間(5週間)で岡三RSSを使った自動発注が行えるようになることを目標に作成されています。

このカリキュラムに沿って、マニュアル、サンプルファイル、よくあるご質問、リファレンス集、「システムトレード『超』楽勝法」を参考に学習を進めてください。

学習するなかで疑問点がございましたら、専用のメールアドレスにご質問ください。

このカリキュラムは、岡三RSSをインストールする所からスタートしています。既にある程度マスターされている方は、途中からスタートしても構いません。

それではRSSマスター目指して、頑張ってください。

第1週

ダウンロード・インストール

岡三RSSを使うには、まず岡三デスクトップと岡三RSSの申込、ダウンロード、インストールが必要です。

この手順につきましては「インストール手順」、

http://www.okasan-online.co.jp/ont/guide/install/ont_rss/index.html

もしくは「岡三RSS操作マニュアル」の「2 ダウンロードから起動まで」を参照ください。

http://www.okasan-online.co.jp/ont/guide/manual/pdf/ont_rss/ont_rss_01.pdf

岡三デスクトップの起動とログイン

岡三RSSはExcel®のアドインです。Excel®上で岡三RSSの関数を使うには、岡三デスクトップの起動とログインが必要です。

岡三デスクトップの起動とログインについては「岡三デスクトップ操作マニュアル」の「2-3 起動」、「3.1.1.4. ログイン・ログアウトアイコン」を参照ください。

http://www.okasan-online.co.jp/ont/guide/manual/pdf/ont_desktop/ont_desktop_01.pdf

関数入力メニューを使ってデータ取得

岡三 RSS には関数を簡易入力するためのツール「関数入力メニュー」が用意されています。

課題

日本株関数入力ボタンをクリックし、日本株の関数入力メニューを表示し、銘柄情報取得関数 (QUOTE) を使って、トヨタ自動車の現在値を取得してみましょう

関数入力メニューの使い方は、「岡三 RSS 操作マニュアル」の「3-2 関数入力メニュー」を参照ください。

インストール直後のデータ取得に関するよくあるご質問は、「リファレンス集」の「3 よくあるご質問」の「(イ)インストール時のトラブルに関して」にまとめていますので参照ください。

サンプルファイルのダウンロード

岡三 RSS をすぐに活用できるように、サンプルファイルを用意しています。早速以下の URL で同意確認後、サンプルファイル「日本株サンプル」、「先物サンプル」、「IR ブレイクを利用したモデル」、「IR ブレイクを利用した発注モデル」をダウンロードしてください。

<http://www.okasan-online.co.jp/ont/use/sample/download.html>

どのようなサンプルファイルがあるかは、「リファレンス集」の「2 サンプルファイル」にまとめていますので参照ください。

「このブックには、ほかのデータソースへのリンクが含まれています」というエラーが出た場合は、「読み込んだシートが更新されない場合」を参考にリンク元を変更してください。

<http://www.okasan-online.co.jp/ont/use/sample/popup01.html>

QUOTE 関数を使ってみよう

ファイル「日本株サンプル」のシート「クォート」を開いてください。このシートでは QUOTE 関数で銘柄情報を取得しています。

課題

以下の手順で『クォート』シートと同じシートを新たに作成してみましょう

1. 新しいファイルを新規作成します。
2. A2 セルに「8609」と入力し、A20 セルを選択。
3. 日本株関数入力ボタンをクリックし、日本株の関数入力メニューを表示。
4. 「セル選択」タブを開き、銘柄コードの選択ボタンをクリックし、A2 セルを選択。
5. 市場コードの選択ボタンをクリックし、B2 セルを選択。

6. 取得項目の「銘柄コード」を選択し、Shift ボタンを押しながら「約定数量」を選択し、全ての項目を選択。
7. 縦方向を選択後、登録ボタンをクリックすると、A20 セルから縦方向に岡三証券グループの銘柄情報が表示されます。
8. 『クォート』シートの各セルに何が入力されているかを確認し、該当する値を A20 セル以下からみつけ、カット(Ctrl+X) & ペースト(Ctrl+V)で、『クォート』シートと同じセル番号へ移動。

FBOARD 関数を使いこなそう

ファイル「先物サンプル」のシート「板」を開いてください。このシートでは FBOARD 関数で先物の板情報を取得しています。関数の最初の F は Futures (先物)。

D8 セルに「気配値-2」、D9 セル「気配値-1」、D10 セル「気配値 0」と-2 から 13 まで順に 16 段階で番号が 1 つ上がるごとに価格が下がっています。

売気配は売気配数量-2 から売気配数量 5 までの 8 本、買気配は買気配数量 6 から買気配数量 5 までの 8 本に値が入っています。

「ツール」-「オプション」でゼロ値のチェックをはずすと、ゼロが表示されません。

課題

『板』シートと同じシートを新たに作成してみましょう

関数入力メニューには上下 5 本(売気配数量 1~5 と買気配数量 6~10)しかないのですが、残り上下 3 本はご自身で作成してください。

限月は適宜入れ替えてください。「0」を入れると期近、「1」を入れると期先になります。

FCANDLE 関数を使いこなそう

ファイル「先物サンプル」のシート「四本値」を開いてください。このシートでは FCANDLE 関数で先物の四本値を取得しています。

FCANDLE 関数のような一覧情報取得関数は、関数を入力するセルと値が表示されるセルが異なります。M1 セルに「市場コード」を取得する関数を入力し、表示先を A3 セル、本数を 20 本と指定すると、A3 セルから A22 セルの 20 行に「市場コード」が表示されます。

各関数で共通な引数は一ヶ所にまとめて入れたほうが便利です。各関数で共通な引数は K 列にまとめて入れ、M 列の各関数は K 列を参照しています。

引数の詳細につきましては「岡三 RSS 関数マニュアル」の「FCANDLE」を参照ください。

http://www.okasan-online.co.jp/ont/guide/manual/pdf/ont_rss/ont_rss_02.pdf

取得期間と本数の両方を指定した場合は、取得期間が優先されます。

課題

『四本値』シートと同じシートを新たに作成してみましょう
日足(取引日ベース)で1ヵ月分の『四本値』を取得してみましょう
5分足で朝9時から順に1日分の『四本値』を取得してみましょう

第2週

注文関数利用上の注意

注文関数をテストするときは、誤発注を避けるため場中には行わないでください。

テスト中は必ず注文画面、注文確認画面は表示あり(0を指定)にして、注文確認画面でキャンセルし、注文画面は「閉じる」で終了してください。

もし誤って注文が実行された場合は、速やかに注文を取消してください。

なお、本カリキュラムにより発生したいかなる損害に対しても、当社は一切の責任を負うものではありませんので、あらかじめご了承ください。

FNEWORDER 関数で先物の発注テストをしてみよう

ファイル「先物サンプル」のシート「注文」を開いてください。このシートでは FNEWORDER 関数で先物の発注を行っています。

A2 セルに新規発注用の関数が入っており、A2 セルが「発注待ち」になっていれば注文可能状態です。

最初は「注文可否選択ボタン」が赤色(注文できません)になっているのを確認してください。岡三 RSS ツールバーの各ボタンの説明は、「岡三 RSS 操作マニュアル」の「3-1 岡三 RSS ツールバー」を参照ください。

「注文可否選択ボタン」をクリックし青色(注文可能)にするだけでは注文できません。以下の操作で注文関数の入ったセルの式を再計算させる必要があります。

- ✓ 注文関数の入ったセルを選択し、F2 キーを押しセルの中に入り、Enter キーを押す
- ✓ 注文関数の入ったセルを選択し、ダブルクリックでセルの中に入り、Enter キーを押す
- ✓ 注文関数の引数を変更する
- ✓ 注文関数を含む条件式が発注の条件を満たす

課題

以下の手順で先物の新規発注をテストしてみましょう

1. 他の発注が実行されないように、A22 セル、A33 セルの関数を消去。
2. C6 セルを適宜入れ替える。「0」を入れると期近、「1」を入れると期先。
3. C14～C16 セルが「0」(表示あり)であることを確認。
4. C17 セルに先物の取引パスワードを入力。
5. 「注文可否選択ボタン」をクリックし青色(注文可能)にする
6. A2 セルを選択し、F2 キーを押す。
7. 次に Enter キーを押すと、A2 セルが「発注完了」に変わる。
8. 注文画面が表示されるので、注文ボタンをクリック。
9. 注文確認画面が表示されるので、キャンセルをクリックし閉じる。
10. 注文画面に戻るので、右上の×(閉じる)をクリックし注文画面を閉じる。

発注 ID は Excel を閉じるまで、同じ ID は一度しか使えません。Book を閉じただけでは同じ ID は使えません。再度注文するときは発注 ID を書き換えるか、Excel を再起動する必要があります。

発注 ID に関するよくあるご質問は、「リファレンス集」の「3 よくあるご質問」の「(オ)発注に関して」にまとめていますので参照ください。

課題

以下の手順で 2 件目の新規発注をテストしてみましょう

1. C18 セルの発注 ID を「F002」に書き換えて Enter キーを押す。
2. 注文画面が表示されるので、注文ボタンをクリック。
3. 注文確認画面が表示されるので、キャンセルをクリックし閉じる。
4. 注文画面に戻るので、右上の×(閉じる)をクリックし注文画面を閉じる。
5. 「注文可否選択ボタン」をクリックし赤色(注文できません)に戻す。

先物の決済は取引種類を「2」にします。建玉番号と建玉枝番号を指定することもできます。建玉番号と建玉枝番号を指定しないと、先入れ先出しで決済されます。

課題

以下の手順で先物の決済発注をテストしてみましょう

1. Excel を一旦閉じて、再起動します。
2. 他の発注が実行されないように、A2 セル、A33 セルの関数を消去。
3. C6 セルを適宜入れ替える。「0」を入れると期近、「1」を入れると期先。
4. C14～C16 セルが「0」(表示あり)であることを確認。
5. C17 セルに先物の取引パスワードを入力。
6. 「注文可否選択ボタン」をクリックし青色(注文可能)にする。
7. A22 セルを選択し、F2 キーを押す。
8. 次に Enter キーを押すと、A22 セルが「発注完了」に変わる。
9. 決済建玉が無い場合は、「決済建玉がありません」エラーがでる。
10. 決済建玉が有る場合は、注文画面が表示されるので、注文ボタンをクリック。
11. 注文確認画面が表示されるので、キャンセルをクリックし閉じる。
12. 注文画面に戻るので、右上の×(閉じる)をクリックし注文画面を閉じる。
13. 「注文可否選択ボタン」をクリックし赤色(注文できません)に戻す。

Excel の IF 関数を使うことで、利食いや損切りの条件発注ができます。例えば現在値が A2 セルで新規発注した買建玉の単価を 5%上回ったら利食いの売決済、5%下回ったら損切りの買決済を行う場合は、A33 セルのような条件式を書きます。

ここで、B35 セルは FQUOTE 関数で取得したリアルタイムの現在値、C12 セルは買建玉の単価、B36 セルは利食い率、B37 セルはロスカット率で、現在値が買建玉単価 × 利食い率を上回るか買建玉単価 × ロスカット率を下回れば、FNEWORDER 関数が実行され、それ以外では A33 セルに「保有」と表示します。

課題

以下の手順で、利食いの決済注文をテストしてみましょう

1. Excel を一旦閉じて、再起動します。
2. 他の発注が実行されないように、A2 セル、A22 セルの関数を消去。
3. C6 セルを適宜入れ替える。「0」を入れると期近、「1」を入れると期先。
4. C12 セルを現在値と同じにして、A33 セルを「保有」にする。
5. C14～C16 セルが「0」(表示あり)であることを確認。
6. 現在値 ÷ 1.05 より低い値を C12 セルに入力。
7. C33 セルが「発注待ち」に変わるのを確認

課題

C12 セルの買建玉単価を高くて損切りの決済注文をテストしてみましょう

決済注文が本当に出ないように、該当する建玉がないのを事前に確認してください。

第 3 週

IR ブレイクを利用した売買モデルをつくろう

ファイル「IR ブレイクを利用したモデル」を開いてください。これは「システムトレード『超』楽勝法」の 6 章で紹介している、IR ブレイクを利用した売買モデルの検証を行うシートです。

課題

IR ブレイクを利用した売買モデルを理解しましょう

「システムトレード『超』楽勝法」6 章の P122～P133 と、ファイル「IR ブレイクを利用したモデル」を見比べて、このモデルの根幹となる売買シグナルを発生させるロジックと Excel シートでの表現方法を理解します。

ロスカットからモデルの評価まで行おう

売買シグナルが発生しエントリーしてポジションを持つと、次に考えるのはイグジットです。今回のモデルはロスカット幅を超えると損切りし、超えなければ引成りでイグジットします。

一通りの売買モデルができますと、次はバックテストで最適なパラメータを探します。

課題

ロスカットからバックテストまでを理解しましょう

「システムトレード『超』楽勝法」6 章の P134～P143 と、ファイル「IR ブレイクを利用したモデル」を見比べて、イグジットのロジックとバックテストでの評価指標を理解します。

第4週

岡三 RSS で発注まで行おう

ファイル「IR ブ레이크を利用した発注モデル」を開いてください。このシートは「システムトレード『超』楽勝法」の7章のP152～P157で紹介している、岡三 RSS を使った発注モデルです。

エントリーからイグジットまでのロジックは、6章のIR ブ레이크を利用したモデルが元になっています。これに、売買シグナルが発生したら岡三 RSS を使って発注するというロジックが追加されています。

P2セル～P7セルにFCANDLE関数があり、これで30分足を生成しています。

J4セル～N4セルにFNEWORDER関数があり、エントリーとイグジットの売買シグナルが出たら、発注する条件式が組まれています。

課題

以下の手順で発注モデルのエントリーをテストしてみましょう

1. 他の発注が実行されないように、L4セル、M4セル、N4セルの関数を消去
2. G6～G8セルが「0」（表示あり）であることを確認。
3. G9セルに先物の取引パスワードを入力。
4. E18セルの高値を、H18列のイニシャルレンジの高値とC5セルのフィルターの和より高い値に変更します。
5. J4セルが「発注待ち」になります。
6. 「注文可否選択ボタン」をクリックし青色（注文可能）にする
7. J4セルを選択し、F2キーを押す。
8. 次にEnterキーを押すと、J4セルが「発注完了」に変わる。
9. 注文画面が表示されるので、注文ボタンをクリック。
10. 注文確認画面が表示されるので、キャンセルをクリックし閉じる。
11. 注文画面に戻るので、右上の×（閉じる）をクリックし注文画面を閉じる。
12. 「注文可否選択ボタン」をクリックし赤色（注文できません）に戻す。

「同様の手順で売りでのエントリーをテストしてみましょう」

F18セルの安値を、I18列のイニシャルレンジの安値からC5セルのフィルターを引いた値より安い値に変更します

課題

以下の手順で発注モデルのイグジットをテストしてみましょう

1. 他の発注が実行されないように、J4 セル、K4 セル、N4 セルの関数を消去
2. G6～G8 セルが「0」(表示あり)であることを確認。
3. G9 セルに先物の取引パスワードを入力。
4. E18 セルの高値を、H18 列のイニシャルレンジの高値と C5 セルのフィルターの和より高い値に変更します。
5. O19 セルのロスカット値以下の値を F19 の安値に入れます。
6. L4 セルが「発注待ち」になります。
7. 「注文可否選択ボタン」をクリックし青色(注文可能)にする
8. L4 セルを選択し、F2 キーを押す。
9. 次に Enter キーを押すと、L4 セルが「発注完了」に変わる。
10. 注文画面が表示されるので、注文ボタンをクリック。
11. 注文確認画面が表示されるので、キャンセルをクリックし閉じる。
12. 注文画面に戻るので、右上の×(閉じる)をクリックし注文画面を閉じる。
13. 「注文可否選択ボタン」をクリックし赤色(注文できません)に戻す。

課題

同様の手順で買いでのロスカットをテストしてみましょう

F18 セルの安値を、I18 列のイニシャルレンジの安値から C5 セルのフィルターを引いた値より安い値に変更します。

O19 セルのロスカット値以上の値を E19 の安値に入れます。

課題

以下の手順で引成りでのイグジットをテストしてみましょう

1. 後場の終わった 16 時以降に行います
2. 他の発注が実行されないように、J4 セル、K4 セル、L4 セル、M4 セルの関数を消去
3. G6～G8 セルが「0」(表示あり)であることを確認。
4. G9 セルに先物の取引パスワードを入力。
5. E18 セルの高値を、H18 列のイニシャルレンジの高値と C5 セルのフィルターの和より高い値に変更します。
6. K18 セルに「B」と表示されます。
7. P18～P28 セルまでに 1 があつたら、その行の F 列の値を I 列の値にします。

8. P18～P28 セルまでに-1 があったら、その行の E 列の値を H 列の値にします。
9. N4 セルが「発注待ち」になります。
10. 「注文可否選択ボタン」をクリックし青色(注文可能)にする
11. N4 セルを選択し、F2 キーを押す。
12. 次に Enter キーを押すと、N4 セルが「発注完了」に変わる。
13. 注文画面が表示されるので、注文ボタンをクリック。
14. 注文確認画面が表示されるので、キャンセルをクリックし閉じる。
15. 注文画面に戻るので、右上の×(閉じる)をクリックし注文画面を閉じる。
16. 「注文可否選択ボタン」をクリックし赤色(注文できません)に戻す。

第 5 週

課題

自分のアイデアで売買モデルを作成してみましょう

途中で詰まったら、どのようなモデルを作成したいか、何で詰まっているかをメールで相談してください。

お疲れ様でした。
資料に不備や不明な点がございましたら、ご指摘ください。