

News Release

各 位

岡三オンライン証券株式会社
代表者：取締役社長 池田 嘉宏
所在地：東京都中央区

岡三オンラインFX専用自動売買ツール「アルゴトレード365」 「リスクマネジメント機能」および「売買モデル」追加のお知らせ

岡三オンライン証券株式会社は、平成24年6月4日(月)より、岡三オンラインFX(くりっく365)専用システムトレード「アルゴトレード365」において、「リスクマネジメント機能」および「売買モデル」を追加いたしましたので、お知らせします。

■ お客さまの資金に適した上限取引枚数を通知する「リスクマネジメント機能」

リスクマネジメント機能は、お客さまの証拠金に対して、お取引量が適切かどうかを診断してくれる機能です。売買システム毎に過去のトレード結果に基づいた最大リスク量を算出し、お客さまのお取引が過大な取引と判断した場合は、適正なお取引量をご提案いたします。

この機能を利用することで、証拠金に対して過大なリスクを抱える危険性を事前に防止し、システムトレード本来の特長である「中長期的に安定的な利益を追求していく投資手法」を活かしたお取引が可能となります。また、リスク管理機能の仕組みや使い方、開発業者である株式会社オスピスの開発秘話などを盛り込んだ専用コンテンツもご用意しております。

HOME ポートフォリオ **リスクマネジメント** クイック検索 Myページ

リスクマネジメント機能

リスクマネジメント機能(以下、「本機能」)は、ユーザーが過大なリスクを取ることによって、取引を継続できなくなる可能性を縮小し、収益の機会を増大させることを目的とした機能です。

リスクマネジメントとは

- 使い方
- FAQ
- 開発秘話 エピソード1
- 開発秘話 エピソード2
- 開発秘話 エピソード3

■ そもそも「リスク」とは?

一般的に運用におけるリスクとは、「不確実性」や「運用成果の変動幅」のことを意味しますが、「リスク」とは、自動売買設定した売買システムの損益により生じる有効証拠金額の変動幅のことを指します。

リスクと言っても必ずしも悪い意味ではありません。そもそも投資活動において収益を上げるためが必要であって、リスクを取らずに収益を上げることはできません。しかし、ためためにリスクを取上げることができないのも事実です。

そして、この「リスク」を管理することを「リスクマネジメント」と言います。

本機能は、ユーザーの有効証拠金額の変動幅を一定の範囲に抑えることで、より長期間取引を継続の機会を増大させることを目的としています。

■ リスクマネジメント機能の仕組み

本機能では、売買システムのトラッキングレコード、ロスカット幅、通貨ペア毎の必要証拠金額などを「リスク」を定義しています。

ユーザーが自動売買設定しようとしている売買システムの「リスク」と、自動売買設定しようとする銘柄から、推奨する上限枚数を計算しています。

ユーザーが過大なリスクを取ろうとした場合、つまり、入力した取引枚数が推奨する上限枚数を上回ることをお知らせし、適切な枚数をご提案します。

売買システム : ムーブマン CHF/JPY 60分足

取引枚数 : 枚

※取引枚数は1～100の整数をご入力ください。

**この取引枚数ではリスクが適正水準をオーバーします。
27枚以下で設定することをお勧めします。**

→ 設定しようとした取引枚数でこの売買システムを追加すると「リスク」の総量が適正水準の上限を超えます。メッセージに表示されている取引枚数以下で自動売買を設定すれば、「リスク」の総量が適正水準内に収まりますので、取引枚数の再設定をお勧めします。「リスク」の総量を適正水準に収めることにより、取引を継続しやすい状態となり、収益機会が増えます。

自動売買を設定する

※画像はイメージのため実際の画面とは異なる場合があります。

■ 新売買モデル「アトライズ」

今回新たに追加した売買モデル『アトライズ』は、テクニカル指標の数値と直近のレンジを複合的に監視し、ブレイクした方向にポジションを取る順張り型の売買モデルです。

《iPhone アプリ画面イメージ》



取扱開始日		平成24年6月4日(月)
追加足		30分足/60分足
売買モデル	売買モデル名	アトライズ
	タイプ	順張りトレード(ドテンあり)
	特徴	監視時間内のATR(Average True Range)が一定水準以上の時、直近のレンジをブレイクしたら、順張りで新規にエントリーする。

※画像、運用成績はイメージのため実際の画面とは異なる場合があります。

今回の売買モデル追加により、「アルゴトレード365」では、10種類の売買モデルをベースとした297個の売買システムでの自動売買が可能となり、より相場状況に即した売買システムを選択してお取引いただけるようになります。

「アルゴトレード365」では、今後もお客さまにより良いサービスをご提供できるよう、売買モデルや新機能の追加に努めてまいります。

以上

取り扱い金融商品に関する留意事項

●商号：岡三オンライン証券株式会社/金融商品取引業者関東財務局長（金商）第52号

●加入協会：日本証券業協会、(社) 金融先物取引業協会

●リスク：【株式等】株価変動による値下りの損失を被るリスクがあります。信用取引、先物取引、オプション取引および株価指数証拠金取引では投資金額（保証金・証拠金）を上回る損失を被る場合があります。株価は、発行会社の業績、財務状況や金利情勢等様々な要因に影響され、損失を被る場合があります。投資信託、不動産投資証券、預託証券、受益証券発行信託の受益証券等は、裏付け資産の評価額（指数連動型の場合は日経平均株価・TOPIX等）等、先物取引、オプション取引および株価指数証拠金取引は対象指数等の変化に伴う価格変動のリスクがあります。外国市場については、為替変動や地域情勢等により損失を被る場合があります。上場新株予約権証券は、上場期間・権利行使期間が短期間の期限付きの有価証券であり、上場期間内に売却するか権利行使期間内に行使しなければその価値を失い、また、権利行使による株式の取得には所定の金額の払込みが必要です。株価指数証拠金取引では建玉を保有し続けることにより金利相当額・配当相当額の受け払いが発生します。【外貨建て債券】債券の価格は基本的に市場の金利水準の変化に対応して変動するため、償還の前に売却すると損失を被る場合がございます。また、額面金額を超えて購入すると償還時に損失を被る場合がございます。債券の発行者又は債券の元利金の支払いを保証している者の財務状態の悪化等により、債券の価格が変動し損失を被る場合がございます。債券の発行者又は債券の元利金の支払いを保証している者の財務状態の悪化等により元本や利子の支払いが滞り損失を被る場合がございます。外貨建て債券は外国為替相場の変動などにより、円換算でのお受取金額が減少する恐れがあります。これにより円換算で投資元本を割込み、損失を被る場合がございます。【FX】外国為替証拠金取引は預託した証拠金の額を超える取引ができるため、対象通貨の為替相場の変動により損益が大きく変動し、投資元本（証拠金）を上回る損失を被る場合があります。外貨間取引は、対象通貨の対円相場の変動により決済時の証拠金授受の額が増減する可能性があります。対象通貨の金利変動等によりスワップポイントの受取額が増減する可能性があります。ポジションを構成する金利水準が逆転した場合、スワップポイントの受取から支払に転じる可能性があります。為替相場の急変時等に取引を行うことができず不測の損害が発生する可能性があります。【各商品共通】システム、通信回線等の障害により発注、執行等ができず機会利益が失われる可能性があります。

●保証金・証拠金：【信用】最低委託保証金 30 万円が必要です。信用取引は委託保証金の額を上回る取引が可能であり、取引額の 30%以上の委託保証金が必要です。【先物・オプション】発注必要証拠金および最低維持証拠金は、「(SPAN 証拠金額 × 当社が定める掛け目) - ネットオプション価値の総額」とし、選択取引コース・取引時間によって掛け目は異なります。当社の Web サイトをご確認ください。また、変更の都度、当社の Web サイトに掲載いたします。【株価指数証拠金取引】発注証拠金（必要証拠金）は、株価指数ごとに異なり、取引所により定められた証拠金基準額となります。Web サイトで最新のものをご確認ください。【FX】個人のお客様の発注証拠金（必要証拠金）は、取引所 FX では、取引所が定める証拠金基準額に選択レバレッジコースに応じた所要額を加えた額とし、店頭 FX では、取引金額（為替レート × 取引数量）× 4%以上の額とします。法人のお客様の発注証拠金（必要証拠金）は、取引所 FX では、取引所が定める証拠金基準額とし、店頭 FX では、取引金額（為替レート × 取引数量）× 0.34%以上（最低 500 円）の額とします。発注証拠金に対して、取引所 FX では、1 取引単位（1 万又は 10 万通貨）、店頭 FX では、1 取引単位（1,000 通貨）の取引が可能です。発注証拠金・取引単位は通貨ごとに異なります。Web サイトで最新のものをご確認ください。

●手数料等諸費用の概要（表示は税込）：【日本株】個人のお客様の取引手数料には 1 注文の約定代金に応じたワンショットと 1 日の合計約定代金に応じた定額プランがあります。法人のお客様は 1 注文の約定代金に応じたワンショットのみとなります。上限手数料は、現物ではワンショットが 1,260 円、定額プランが約定代金 100 万円以下で上限 780 円、以降約定代金 100 万円ごとに 420 円加算、また、信用ではワンショットが 400 円、定額プランが約定代金 200 万円以下で上限が 630 円、以降約定代金 100 万円ごとに 315 円加算します。手数料プランは変更可能です。信用取引手数料は月間売買実績により段階的減額があります。信用取引には金利、管理費、権利処理等手数料、品貸料、貸株料の諸費用が必要です。【上場新株予約権証券】日本株に準じます。【中国株】国内取引手数料は約定金額の 1.05%（最低手数料 5,250 円）。この他に香港印紙税、取引所手数料、取引所税、現地決済費用の諸費用が必要です。売買にあたり円貨と外貨を交換する際には、外国為替市場の動向をふまえて当社が決定した為替レートによるものとします。【外貨建て債券】外貨建て債券を募集・売出し等により、又は当社との相対取引により購入する場合は、購入対価のみをお支払いいただきます。外貨建て債券の売買、償還等にあたり、円貨と外貨を交換する際には、外国為替市場の動向をふまえて当社が決定した為替レートによるものとします。【先物】取引手数料は、日経平均株価先物が 1 枚につき 315 円（取引枚数により段階的減額あり）、日経 225mini が 1 枚につき 42 円です。【オプション】売買手数料は、約定代金に対して 0.168%、最低 210 円です。【株価指数証拠金取引】取引手数料は、1 枚につき 157 円です。【投資信託】お申込みにあたっては、当該金額に対して最大 3.675%の申込手数料をいただきます。換金時には基準価額に対して最大 0.75%の信託財産留保金をご負担いただく場合があります。信託財産の純資産総額に対する信託報酬（最大 2.4525%（年率））、その他の費用を間接的にご負担いただきます。また、運用成績により成功報酬をご負担いただく場合があります。詳細は目論見書をご確認ください。【FX】取引所 FX 通常コースの取引手数料は 1 取引単位あたり 100 円（取引枚数により段階的減額あり）です。1 倍コースでは 1 取引単位あたり 1,050 円です。店頭 FX は無料です。スプレッドは、通貨ごとに異なり、為替相場によって変動します。Web サイトで最新のものをご確認ください。

●お取引の最終決定は、契約締結前交付書面、目論見書等および Web サイト上の説明事項等をよくお読みいただき、ご自身の判断と責任で行ってください。