

[表紙] iTRADE の独自仕様集

第 1 版

作 成 日	2016 年 10 月 31 日
最終更新日	2021 年 3 月 12 日

目次

[表紙] iTRADE の独自仕様集	1
目次	2
はじめに.....	3
複数の仕掛けがある時の資金拘束について	3
ティック未満の数値の処理について.....	3
海外指標が休日の時の扱いについて.....	4
大引け設定のバックテストとリアル取引の違い.....	4
権利付き最終日の手仕舞いについて	4
騰落レシオの計算方法について.....	4
実トレード、SIM と FWD、バックテストのランキング値情報の違いについて.....	4

はじめに

iTRADE の独自仕様集では、「iTRADE」のご利用に関する注意事項の詳細について説明しております。

必ず最後までご確認ください。
内容を適宜更新及び、補足致します。

複数の仕掛けがある時の資金拘束について

「事前確定方式」を使用している場合、前日に売買させる可能性のある銘柄を決定します。
その際に使用する価格が2種類あります。

(1) LIMIT 関係(LIMIT, TRG_LIMIT, STOP_LIMIT, LIT)
発注価格で拘束する資金を計算します。

(2) それ以外(MARKET, TRG_MARKET, STOP, MIT)
売買当日に価格が到達する可能性がある最高価格(ストップ高)で拘束する資金を計算します(買い仕掛けの場合)、
(前日終値+制限価格)

こうすることで、事前確定方式時に、選出された銘柄が資金不足によって売買されないということがないように設定されています。

(3)複数仕掛けを設定した場合、
便宜上、一番上に設定されたルールに使用される価格で売買する銘柄を選択しますので、
LIMIT 関係とそれ以外のオーダーを使用した場合、
上に来るオーダーによって、選出される銘柄の枚数が変化します。

、先頭に指値を置き、2番目に成行を置いた場合、仮に成行注文のみが発注されたとしても、指値による資金拘束が2番目の成り行き注文にも適用されますが、証券会社が受注した段階では、成行はストップ値幅を考慮した最大資金拘束を行います。

ですから、iTrade から発注された成行注文に対し、ブローカーは資金不足で注文を拒否するケースが出てくる可能性があります。

これによって、リアルとバックテストの誤差が生じることになります。

ティック未満の数値の処理について

(1) オーダー内でのスリッページ以外の価格の計算

例えば、100円台では呼び値が2円の場合に計算結果が103円であった場合、

$$103 \div 2 = 51 \text{ 余り } 0.5$$

余りを切り捨て、呼び値を掛け直し

$$51 \times 2 = 102$$

という補正を行います。

仮に呼び値が 5 円であった場合は、以下の通りです。

$$103 \div 5 = 20 \text{ 余り } 0.6 \leq \text{切り捨て}$$

$$20 \times 5 = 100$$

仮に呼び値が 0.5 円であった場合は、以下のとおりです。

$$103 \div 0.5 = 206 \text{ 余り } 0$$

$$206 \times 0.5 = 103$$

つまり、ロジックが買いであろうと売りであろうと切り捨て。

(2) スリッページの計算

成り行き系のオーダー (STOP 系を含む) の約定値はスリッページが設定されている場合のみ、売買を判断して、不利な方向にスリッページ (% を Tick 単位に変換した分の価格) を加算しています。

海外指標が休日の時の扱いについて

・海外指標が休日の時は、休日の前日のデータを参照致します。

例: 海外指標の休日の前日に前日日率が 0 以下の時、

次の日に日本が開場していた場合、海外指標が休日なので前日の値を参照します。

移動平均などの計算の際にも休日のデータは参照に入っていません。

大引け設定のバックテストとリアル取引の違い

・セッション 2 (後場引け) について、バックテストでは大引けでの約定設定としていますが、リアル取引では大引けの 10 秒前の発注となっております。

権利付き最終日の手仕舞いについて

・手仕舞いをする時に、権利付き最終日であった場合、手仕舞いがエラーとなり手仕舞い出来なくなります。

その場合、他の手仕舞い条件があり、そちらが条件に合った場合は自動で手仕舞い出来ますが、何も手仕舞い条件が無い場合、手仕舞い出来なくなりますので、証券会社にて手動手仕舞いを行わなければいけません。

* 現在、この現象を救うための修正を検討しております。

騰落レシオの計算方法について

iTRADE では騰落レシオの計算は、「取引市場・その他」でチェックを入れた有効な市場で計算を行っています。

ですので、東証 1 部のみといったような騰落レシオとは結果が異なってくる事が考えられます。

実トレード、SIM と FWD、バックテストのランキング値情報の違いについて

実トレードや SIM (シミュレーションテスト) と FWD (フォワードテスト)、バックテストのランキング値情報において、実トレードと SIM ではランキング値情報に記載されないような銘柄があります。

具体的には上場して数日といったような銘柄は、実トレードや SIM ではランキング値情報に記載されない可能性があります。