

ITRADE注文定義方法注重点

注文種別	設置場所	設置値	その他	備考
当日注文	発注時間指定	フレーム0にする(当日の売買)		
翌日注文	発注時間指定	フレーム1にする(翌日の売買) 売買当日が0なので、新規は全て0指定となり、1以降を指定するのは、通常は手仕舞いの注文のみ。		手仕舞いのフレームは0が仕舞い日と同日、1は仕舞い日翌日を意味する。
新規注文に関する注重点	有効期限	有効期限は0日に設定する。アクティブポートフォリオでは、毎日売買対象銘柄が異なるので、注文の締結は行わない。		
	フレーム	新規注文のフレームは0日設定。条件成立の翌日売買が基本なので、		
手仕舞い注文に関する注重点	フレーム	手仕舞い注文は、新規注文とは事情が異なる。新規注文は成立しなければそのままだが、手仕舞い注文は成立する必要がある。手仕舞い注文は、必ず前日の手仕舞い注文が必要になる。つまり、セッション指定や時間指定を行なった場合、それが成立しなかった場合は、翌日より実行される。別の種類の注文(例えばタイムストップ注文)を別途指定が必要である。	実際の発注では、ブローカーの注文有効期限も考慮しなければならない。信用取引の期間(6か月)も考慮しなければならない。(ブローカーの注文有効期限は、トリガー系注文にすることで、調整することができる)	*下記の「セッション/時間指定注文」の「有効期限と強制成行の制限」を参照
	フレーム	同じタイミングで成立する注文が同時に出された場合、並びが後ろの注文が有効となり、それより前に並んでいる成立可能な注文は全てキャンセルされる。(利食い注文と横切り注文を同時に出せるようにするために、この仕様になっている)。日定ペースで良い価格と良い注文を出した場合は、どちらも成立することになるので、並びが後ろ側の注文が成立することになるので、注意が必要。	トリガー系注文の場合は、トリガー-onとなるタイミングが同じ注文が、先入れの優先権を持つ。しかしトリガー-on発注のタイミングは、トリガー-onの次のチェックタイミングで発注をチェックする仕組みになっているので、注文の種類と並びによっては、思っている通りに発注されないケースがある。	
フレーム	フレーム	手仕舞いのフレームを0に設定すると、エントリーした当日から注文の評価が始まって翌日まで、日足で判定される。翌日以降の注文は判定しない。翌日以降の注文は判定しない。また、翌日以降の注文は判定しない。また、翌日以降の注文は判定しない。		指標の経過日数はセッションを持った日(0)からカウント開始。フレームは1から評価するを指定する(セッションを持った日以外のもの、有効期限は評価が始まってから何日有効かを規定するもの。フレーム、有効期限は経過日ペースで計算。
	フレーム	フレーム0で仕舞い約定直後から、手仕舞い発動(セツト条件も詳細参照)		
経過日数の定義と判定	モジュール/ポジション状態	経過日数0日=エントリー当日、経過日数1日=エントリー翌営業日		経過日経過日数は、営業日のみで計算。経過日数は土日祝日も含んで計算。ポジションを取った日は0日となり、翌日が続くまで1日経過となりませす。
ブローカー注文期限に関する件	注文種別	LIMIT (一旦注文が出てしまえば、そこからブローカーのブックに落ちるので、ブローカーの注文有効期限が経過すると、注文は勝手に取り消されてしまう)	この問題を解決するには、トリガーリミット注文にすること。	例: 約定率の10%より高いリミットでもOKだが、ブローカーの注文有効期限を超える可能性がある場合は、トリガーリミットの方が安全。
	注文種別	トリガー注文であっても、トリガーをトリガーとして一旦ブローカーに注文が投げられたら、約定しないので、約定させたい限りまで実際の注文が出ないようトリガー設定にする。		
繰り越し注文	注文種別	その条件をすべて満たしていきたくらいまで実際の注文が出ないようトリガー設定にする。		例: 前日高値のn%以上にトリガーリミットを置いて手仕舞い
	注文種別	その条件をすべて満たしていきたくらいまで実際の注文が出ないようトリガー設定にする。		
セッション/時間指定注文	発注時間指定 発注時間指定	新規はフレーム0にする(当日朝の売買) セッション1(寄り(前場寄り)、セッション2(引け(大引け)) セッション1(寄り(前場引け)、セッション2(後場寄り)、その他時間指定	日足で判定が可能 日足で判定できない	
有効期限	注文を出すセッションの開始や終了時間に合わせる		「有効期限なし」は、無期限だと意味があるので、セッション指定注文では、ここに期間を入れる必要がある。	
有効期限と強制成行の関係	強制成行有効にするには、「有効期限」を指定しなければならない。有効期限が満了する前に強制成行が実行されるので、出されている注文の最長有効期限に合わせて、有効期限指定を行って必要あり(タイムストップを最長にして、これに合わせておけば確実)		ここが「有効期限なし」となっていない場合、強制成行はonに設定しても、実行されないので要注意。	
① 価格寄り注文注文	発注時間指定 発注時間指定	新規はフレーム0にする(当日朝の売買) セッション1(寄り(前場寄り))を選択。成行と指値は、スリッページなし、トリガー系注文はスリッページ設定が必要。 発注が実行された後、約定しなかった場合は有効期限が数日指定されていても再発注はされません。(トリガーがセツトしない場合は有効期限内は条件を再評価して取り返します。) 但し手仕舞い注文に関しては、発注が実行された状態で約定せずキャンセルされ、且つ有効期限が残っている場合、再発注が行われます。(手仕舞い不可防止機能)	日足でも判定可能 トリガー系+成行注文(RVRS TRG MARKET, TRG MARKET)は、条件が揃った瞬間に判定してから成行を執行するので、発注の成行の有効期限は短く設定するが、プラスになることも有り得る。	
② 価格引け注文注文	発注時間指定 発注時間指定	新規はフレーム0にする(当日朝の売買) セッション1(寄り(前場寄り))を選択。後場の条件が揃った時点で判定し、発注。 発注が実行された後、約定しなかった場合は有効期限が数日指定されていても再発注はされません。(トリガーがセツトしない場合は有効期限内は条件を再評価して取り返します。) 但し手仕舞い注文に関しては、発注が実行された状態で約定せずキャンセルされ、且つ有効期限が残っている場合、再発注が行われます。(手仕舞い不可防止機能)	トリガー系+成行注文(RVRS TRG MARKET, TRG MARKET)は、トリガー一価格条件オンになった瞬間に判定してから成行を執行するので、発注の有効期限は短く設定するが、プラスになることも有り得る。	
③ 価格寄り注文注文	発注時間指定 発注時間指定	新規はフレーム0にする(当日朝の売買) セッション2(後場寄り)を選択。後場の条件が揃った時点で判定し、発注。 発注が実行された後、約定しなかった場合は有効期限が数日指定されていても再発注はされません。(トリガーがセツトしない場合は有効期限内は条件を再評価して取り返します。) 但し手仕舞い注文に関しては、発注が実行された状態で約定せずキャンセルされ、且つ有効期限が残っている場合、再発注が行われます。(手仕舞い不可防止機能)	トリガー系+成行注文(RVRS TRG MARKET, TRG MARKET)は、トリガー一価格条件オンになった瞬間に判定してから成行を執行するので、発注の有効期限は短く設定するが、プラスになることも有り得る。	
④ 大引け注文注文	発注時間指定 発注時間指定	新規はフレーム0にする(当日朝の売買) セッション1(寄り(前場寄り))を選択(秒指定が無い場合は、大引けは秒前判定で発注される) 発注が実行された後、約定しなかった場合は有効期限が数日指定されていても再発注はされません。(トリガーがセツトしない場合は有効期限内は条件を再評価して取り返します。) 但し手仕舞い注文に関しては、発注が実行された状態で約定せずキャンセルされ、且つ有効期限が残っている場合、再発注が行われます。(手仕舞い不可防止機能)	日足で判定可能	MARKE+大引け注文注文+ANDで買った条件で経過日数
⑤ 時間指定注文	発注時間指定 発注時間指定	新規はフレーム0にする(当日朝の売買) 任意の時刻を入れる 注文が解除する時間まで、寄りからのミリ秒単位で定義	日足で判定可能	複数の手仕舞い条件となっていて、当日大引け成行、翌日の成行の種類の注文がある場合、当日大引け成行の方の設定が有効期限なしとなっていた時に、大引け時に約定しなかった場合、翌日にキャンセル注文がかり、翌日成行の注文がキャンセルとなり手仕舞い出来ないう状況になる可能性があります。ですが大引け注文の有効期限を0日としておけば、約定しない場合引け後にブローカーから自動的に失効が帰ってきて、翌日朝にキャンセルを行う必要がないため、手仕舞い出来ないという状況を防いでくれます。
ペイオフ(※) (毎日の案件のみで判定で、その日の案件が利益になった時点で手仕舞い(繰り越し注文))	トリガーリミットフレーム+有効期限	エントリー価格のように、指値/指値を待つ場合は、一旦指値注文が出たら、その後も指値にならないため、翌日以降再発注可能な注文で約定しない、かといって有効期限でキャンセルしてしまうと、次の日の注文が約定しない。	条件無し(成行、指値)で、(条件がセツトになって無い)ものは、ブローカーに投げた瞬間に注文が出る。	フレーム1+条件指定注文+トリガーリミット+有効期限(日)で成行可能
LDO=前日安値を本日終値で下回っていたら、本日大引けで買いポジションを手仕舞い(繰り越し注文)	大引け限定STOP注文	大引け限定(時間指定)ストップ注文として定義する。注文とセツトにした指値(前日安値)の値が毎日変わるため、繰り越しが可能。翌日以降の手仕舞いであればフレーム1を指定。	時間指定で、不成立の場合は毎日出し続けたい場合は、条件付時間指定注文にすること。	
指し送り	強制成行	大引け(10)秒前の時点で指値が成立しなかったら、キャンセル(指値を有効期限指定)して、強制成行に切り替え。	有効期限指定指値(大引け10秒前=21500000(注))も、強制成行の組み合わせで設定する。	
引け差指し	大引け限定STOP	当日の終値判定が必要な条件(例えば、当日が指値という条件)でも、翌日終値判定であれば、日足で判定する。当日大引け注文は、実際には大引けの秒前に判断し出されるので、その段階ではまだ大引けがついていないが、バックテストには、大引けの値がついているものと判定されている。	ストップ注文は、トリガー付き注文なので、トリガーがセツトするまではブローカーに注文が出ない。したがって、大引け限定注文でも毎日指値が可能。	