



研究発表レポート③

~ Average True Range (ATR) ~

West Village Investment 株式会社
岩本祐介





研究発表

MULTICHARTS DATA

研究発表のurlは以下のとおりです。

<http://www.panrolling.com/seminar/multicharts/study/>

※インジケータやストラテジーの挿入方法等の基本的な使い方、および、最適化の方法等は、第1回のボリンジャーバンド前編、後編をご覧ください。

第3回 移動平均線とその応用 動画  (資料 )

第2回 コロナショックによる暴落に関して - システムトレード的な見地から考察 - 

第1回 ボリンジャーバンド 前編  (資料 ) | 後編  (資料 )

試用版 マルチチャート 試用版 >> お申込みはこちら 



マルチチャートでのATR

■ATR (Average True Range)

パワーランゲージの記述方法 : **AvgTrueRange(期間)**

※True Range とATR

①まず1日の最大の値動きTR (True Range) を計測する。

- (1) 当日の高値 - 前日の終値
- (2) 前日終値 - 当日安値
- (3) 当日の高値 - 当日の安値

以上の中で、最も大きいものをTRと呼び (次項参照) 、

②そのTRの平均値を計算したものがATR

ATR = TRのn日間の移動平均値



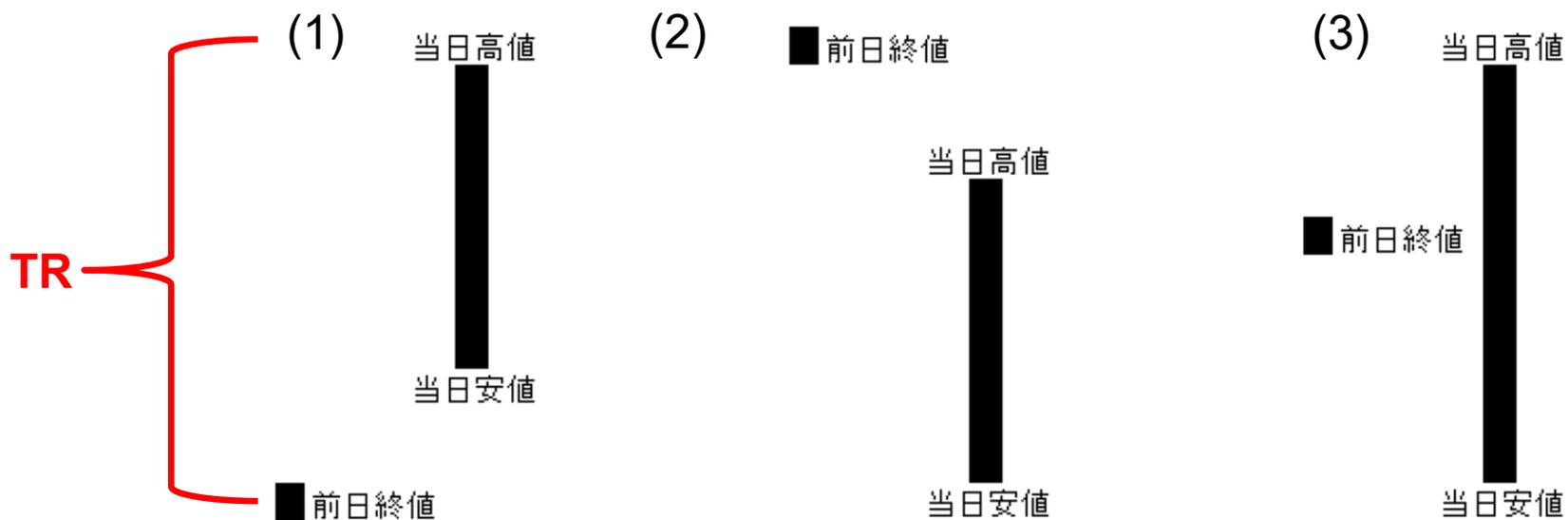
マルチチャートでのATR

※True Range

①まず1日の最大の値動きTR (True Range) を計測する。

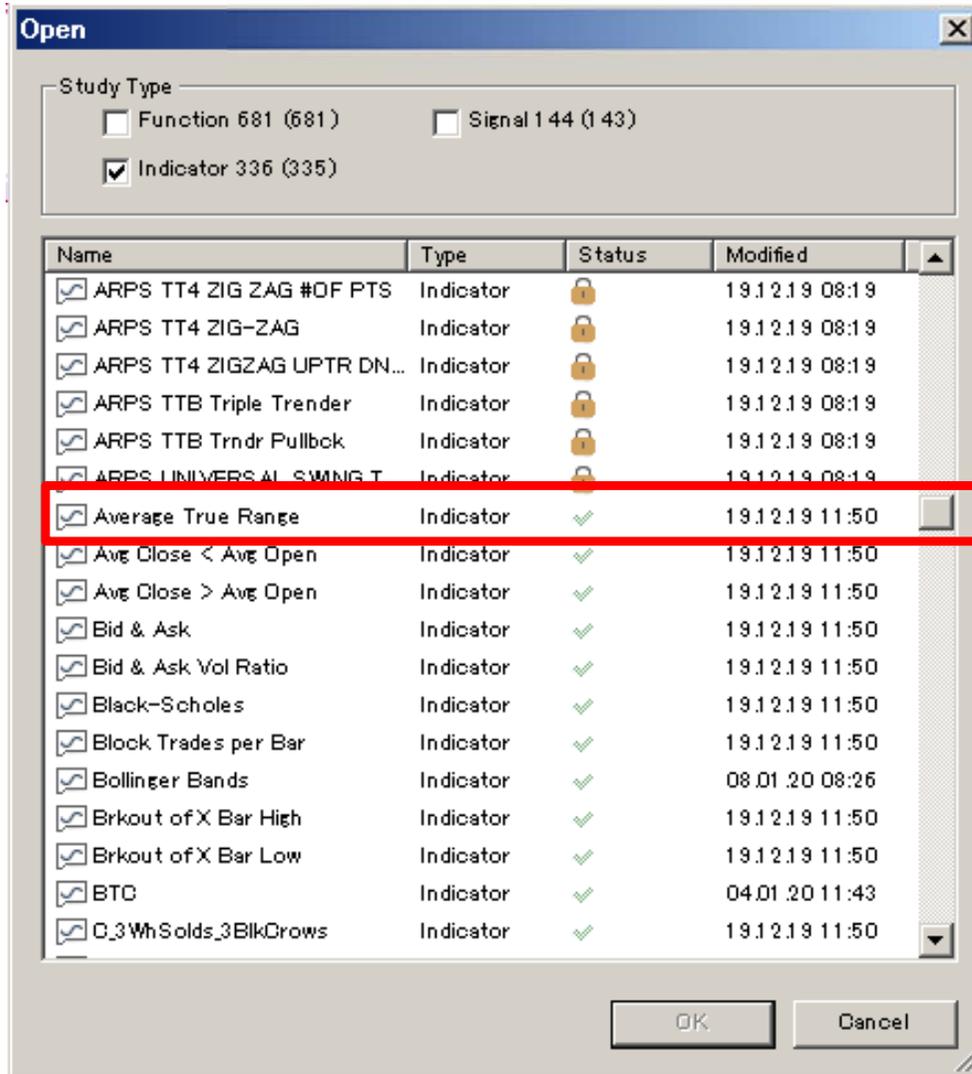
- (1) 当日の高値 - 前日の終値
- (2) 前日終値 - 当日安値
- (3) 当日高値 - 当日安値

以上の中で、最も大きいものがTR。





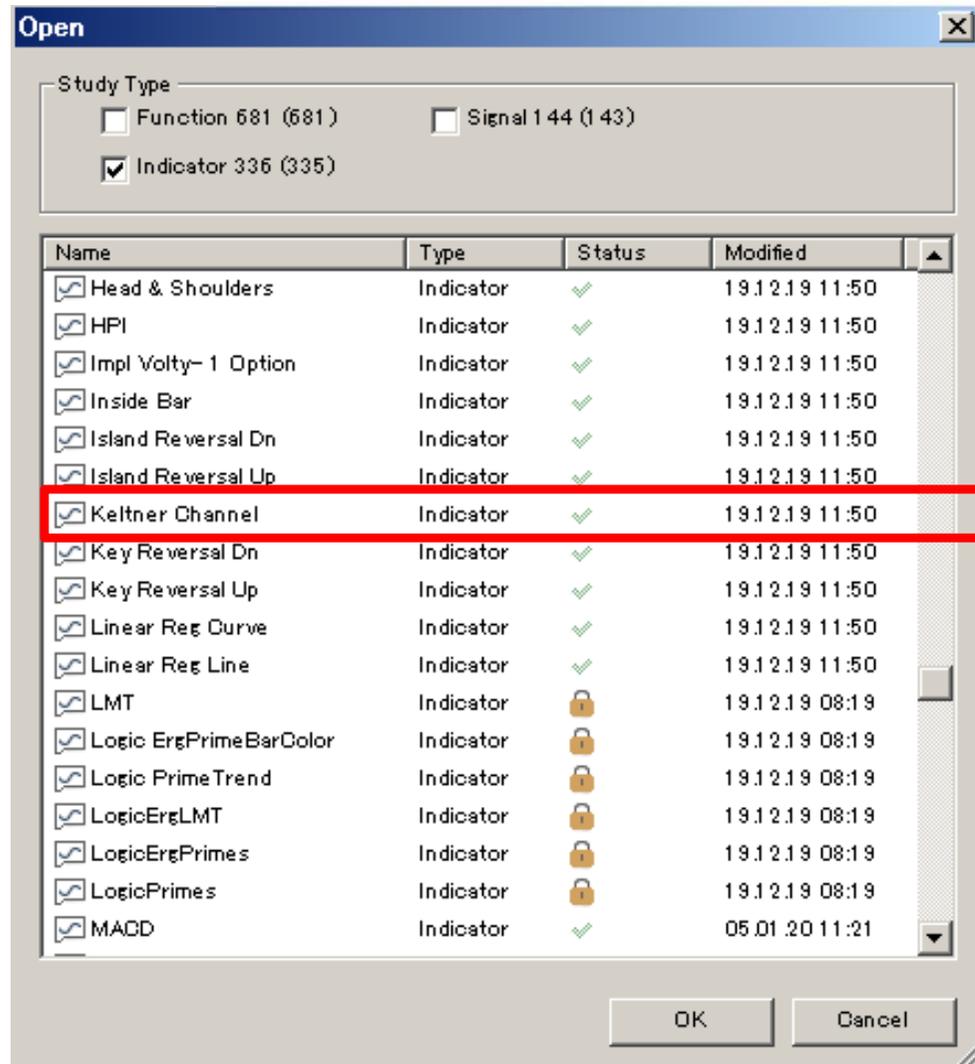
マルチチャートでのインジケータ① ～ATR



Average True Range



マルチチャートでのインジケータ② ～ケルトナーチャネル



Keltner Channel
(ケルトナー・チャネル)



マルチチャートでのATR関連指標 ケルトナー・チャンネル（バンド）

■計算式：

- ①上方バンド：移動平均線 + AvgTrueRange(期間) × 乗数
- ②中央線：移動平均線
- ③下方バンド：移動平均線 - AvgTrueRange(期間) × 乗数

下記のようにプログラムを書ければ正解

例)：期間=20、倍数=1.5

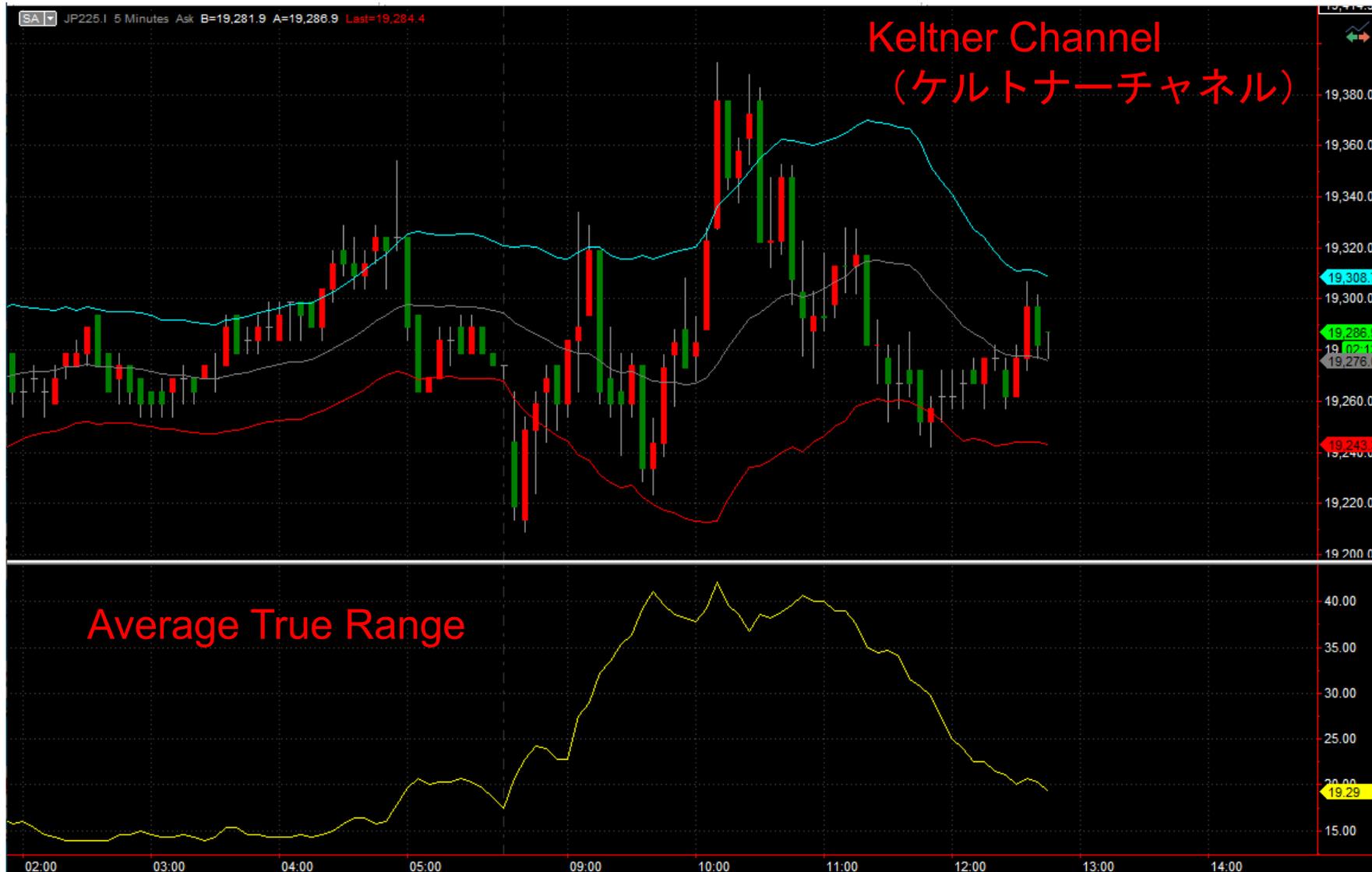
```
Plot1(Average(20) + AvgTrueRange(20) * 1.5);
```

```
Plot2(Average(20));
```

```
Plot3(Average(20) - AvgTrueRange(20) * 1.5);
```

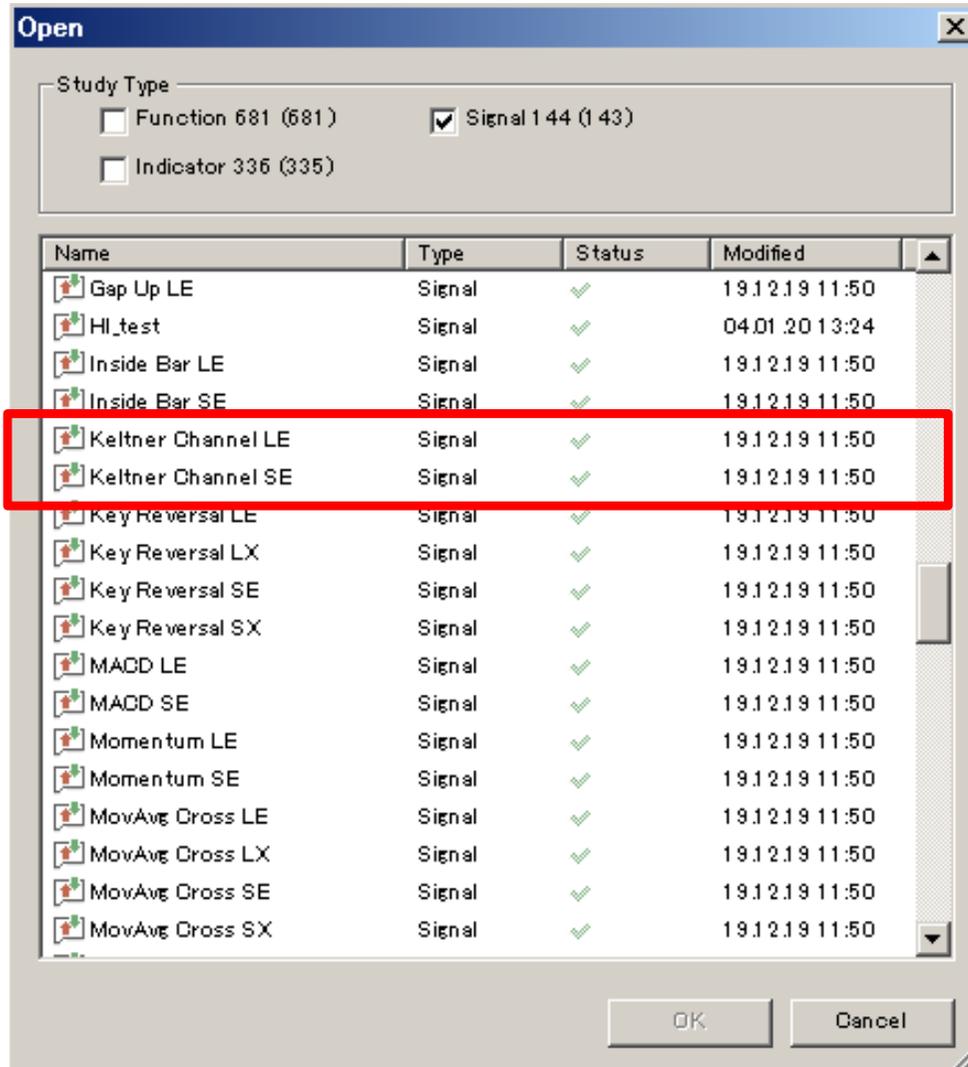


マルチチャートでのATR関連指標





マルチチャートでのストラテジー① ～ケルトナーチャンネル・エントリー



Keltner Channel LE
(ロング・エントリー)

Keltner Channel SE
(ショート・エントリー)



マルチチャートでのストラテジー① ～ケルトナーチャネル・エントリー

■ Keltner Channel LE (ロング・エントリー)

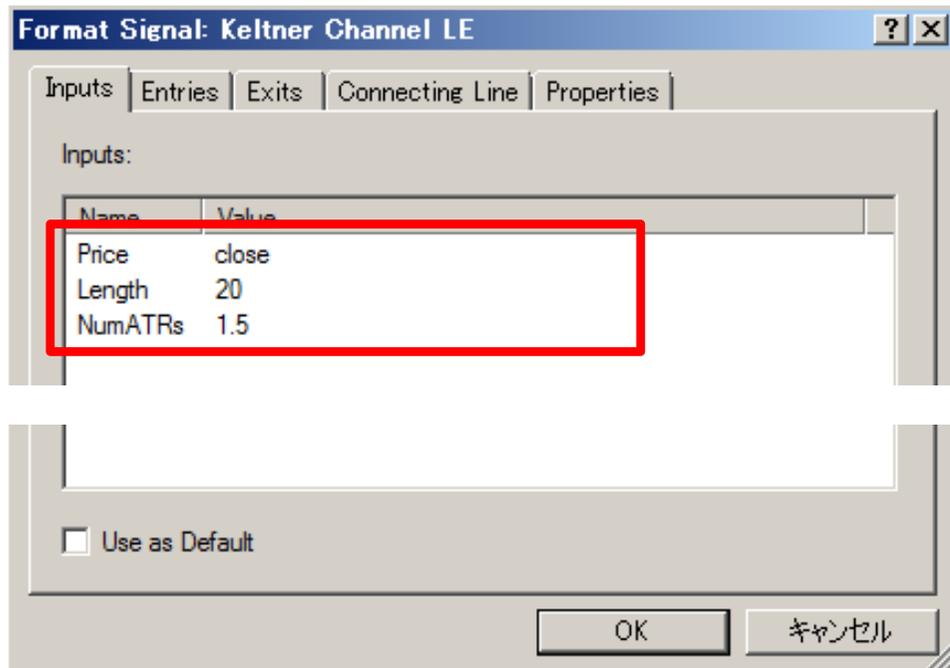
※ Keltner Channel SE (ショート・エントリーは () 内の青字で表示)

● 条件① :

Price(close)がAverage(Length) +(-) AvgTrueRange(Length) * NumATRs
を上方クロスした(下方クロスした)

● 条件② :

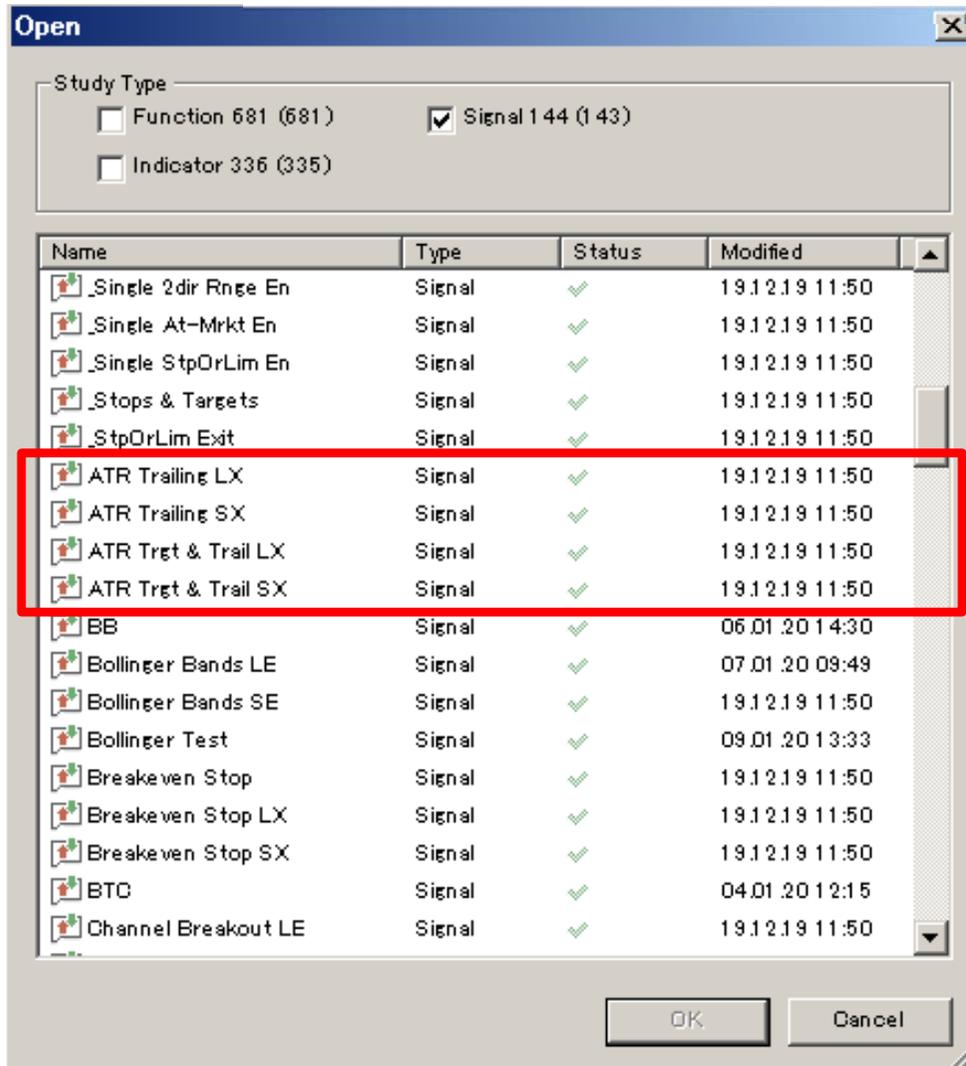
条件①のバーの高値(安値)を1point上(下)回った価格で逆指値ロング(ショート)



Price : open,high,low,closeから選択
Length : ケルトナー中央線の期間、
および、ATRの計算期間
NumATRs : ATRの乗数



マルチチャートでのストラテジー② ～ATR・エグジット



- ・ ATR Trailing LX
(ATRによるロングのトレイリング・エグジット)
- ・ ATR Trailing SX
(ATRによるショート of のトレイリング・エグジット)
- ・ ATR Trgt & Trail LX
(ATRによるロングの指値&トレイリング・エグジット)
- ・ ATR Trgt & Trail SX
(ATRによるショート of の指値&トレイリング・エグジット)



マルチチャートでのストラテジー② ～ATR・エグジット①

■ATR Trailing LX (ATRによるロングのトレイリング・エグジット)

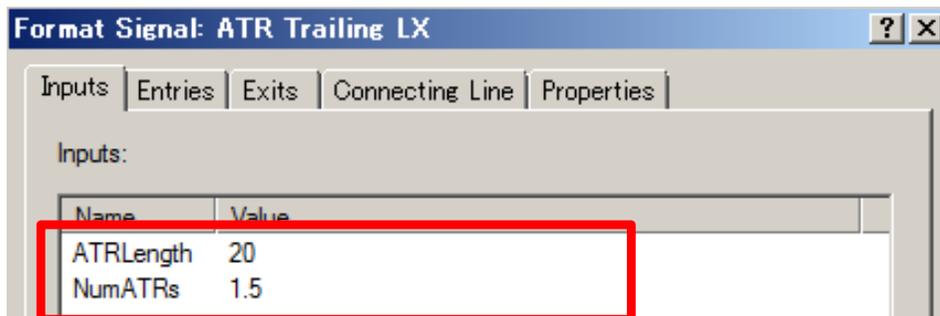
条件 :

ロング・エントリー後につけた高値から $\text{AvgTrueRange}(\text{ATRLength}) * \text{NumATRs}$ 押したところで逆指値によるロングのエグジット

■ATR Trailing SX (ATRによるショート of のトレイリング・エグジット)

条件 :

ショート・エントリー後につけた安値から $\text{AvgTrueRange}(\text{ATRLength}) * \text{NumATRs}$ 戻したところで逆指値によるショートのエグジット



ATRLength : ATRの計算期間

NumATRs : ATRの乗数





マルチチャートでのストラテジー② ～ATR・エグジット②～ロング

■ATR Trgt & Trail LX (ATRによるロングの指値&トレイリング・エグジット)

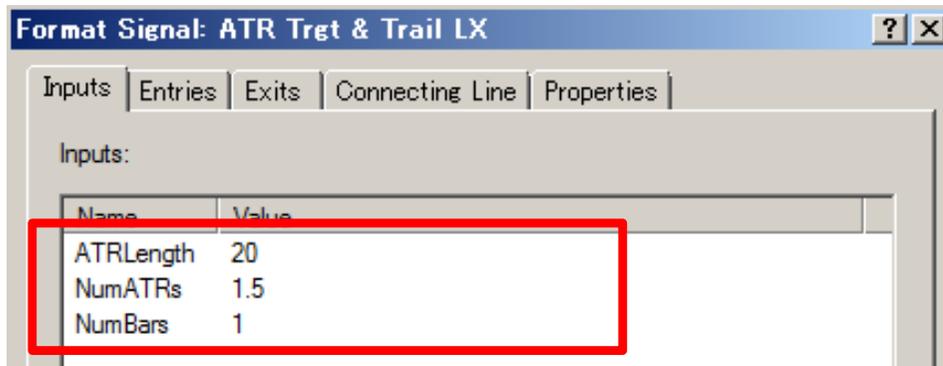
条件 :

- ・ (指値エグジット)

ロング・エントリー価格から $AvgTrueRange(ATRLength) * NumATRs$ 上昇したところで指値によるロングのエグジット (ただし、設定したバー数($NumBars$)以内に限定する)

- ・ (逆指値エグジット)

上記の設定バーを超えた場合は、前のバーの安値に逆指値の売り (エグジット) を置く。



ATRLength : ATRの計算期間

NumATRs : ATRの乗数

NumBars : エントリー後のバーの数





マルチチャートでのストラテジー② ～ATR・エグジット②～ショート

■ATR Trgt & Trail SX (ATRによるショートの指値&トレイリング・エグジット)

- ・ (指値エグジット)

ショート・エントリー価格から $\text{AvgTrueRange(ATRLength)} * \text{NumATRs}$ 下落したところで指値によるショートのエグジット (ただし、設定したバー数(NumBars)以内に限定する)

- ・ (逆指値エグジット)

上記の設定バー数を越えた場合は、前のバーの高値に逆指値の買い (エグジット) を置く。





MULTICHARTS

Raising The Trading Standard

パンローリングはマルチチャートの日本の正規代理店です。マルチチャートの試用版は下記のURLまたは右下のQRコードからお申込みください。

<http://www.tradersshop.com/bin/showprod?c=2011174100005>

まずはお試しく下さい！

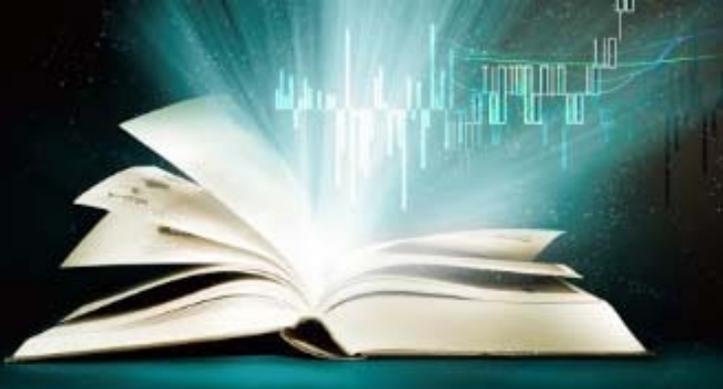
マルチチャート日本語サイトはこちら

<http://www.panrolling.com/seminar/multicharts/>





パンローリングチャンネル



第1回 10分トレードから学ぶエントリー&エグジット編

<https://youtu.be/KJ3gMlfMLpo>

第2回 10分トレードから学ぶ早期エグジット編

<https://youtu.be/rSVRIIs61vKc>

第3回 10分トレードから学ぶ利益確定&ロスカット編

<https://youtu.be/ykErg3MtvA4>

第4回 10分トレードから学ぶまとめ編

<https://youtu.be/OiAIQOeKIKY>