



JForex

 **DUKASCOPY**
Swiss Forex Bank & Marketplace

ヒストリカルテスター

Order processing/注文処理



ヒストリカルテスターの注文処理方法を改善しました。いずれかの補間方法が選択された場合、補間価格で注文を執行していました。

これにより、注文価格と約定価格の間にかかなり大きな差が生じていました。これを解決するために、市場ギャップがある場合（ブレイク後にギャップを持って市場が開く）を除いて、現在の注文の価格で注文を執行します。

このような場合、指値 (Limit) (リミット)-注文は約定されやすくなりますが、Max.Slippage (最大スリッページ) 設定のない Stop (ストップ) 注文は最初の価格で約定されます。

Stop (ストップ) 注文にMax.Slippage (最大スリッページ) 設定があり、約定価格が指値外の場合、注文は指値 (Limit) (リミット) タイプの注文として再発注されます。

ヒストリカル・テスターに関する免責事項

データが完全であり、整合性を備えており、あるいは正確であること。特に、データは送信過程においてある程度の誤差が生じることがあるため、当社の取引システムのレートの変動に一致しない場合があること。
テスター・プラットフォームが支障なく動作し、エラー（テスター・プラットフォームの正常稼働を妨げる重大なエラーを含めませんが、それに限りません）のない状態で維持されること。
テスター・プラットフォームまたはデータにウイルスあるいは他の悪意あるコードが含まれないこと。
テスター・プラットフォームまたはデータが第三者の独占的所有権を侵害していないこと、またはテスター・プラットフォームまたはデータの使用が、特定の司法管轄において制限されていないこと。
データまたはテスター・プラットフォームが特定の目的に適合すること。特に当社は、特定のストラテジーの実際のパフォーマンスとテスター・プラットフォームおよびデータを使ってテストされたときのパフォーマンス結果との関連性の有無について一切表明しないこと。

当社に適用される上記の規定は、当社にデータ、テスター・プラットフォームあるいはその一部を提供する第三者に対しても同様に適用されるものとします。データおよびテスター・プラットフォームの使用あるいはそれらへのアクセスをもって、お客様は上記内容への同意および承認をいただいたものと見なします。

同意する

同意しない

ロジックは次のとおりです。

1. Bid 側のトリガーを持つ注文は、Bid ローソク足の補間価格と比較されます (Ask側のトリガーを持つ注文は、Askローソク足の保管価格と比較されます)。
2. Bid側のトリガーを持つ買い注文やAsk側のトリガーを持つ売り注文が、ローソク足の終値、高値、安値、でトリガーした場合、スプレッド調整された注文価格で執行されます。
3. 注文がOpen(初値)価格(ティック)によってトリガー(実行)された場合、必要なサイドに対応するOpen(初値)価格(ティック)によって注文を約定します。

除外されるのは、Max.Slippage (最大スリッページ)が設定された Stop(ストップ) オーダーです。

Open(初値) 価格値ティック(最小値)が Stop Limit (ストップリミット) の外側にある場合、注文は Limit (リミット) 注文に変更されます。

4 ticks OHLC/ティック(最小値) Open-High-Low-Close/始値、高値、安値、終値

4 ティック OHLC - この方法は、利用可能な多くの補間メソッドの中で最も信頼性の高い補間方法です。

各ローソク足を始値、高値、安値、終値の 4 つの価格ティックに補間します。高値と安値の順序は、始値からの距離によって異なります。

高値が始値に近い場合、高値は始値に続く 2 番目の価格として処理されます。