

小次郎講師が説く、投資で勝ち組になるために 知らなければいけない重要な数字「ATR」



ATRとは各銘柄の1日当たりの平均的変動幅のことです。

ウェルズ・ワイルダー氏(J.Welles Wilder)が計算法を考案しました。

本レポートではタートルズが利用していた20日のATRを使用しています。

《計算式》

1)1日の最大の値動き(True Rangeトウルー・レンジ)を算出→(1)(2)(3)で最大の値幅を選択

(1)当日の高値と当日の安値の差→当日の高値－当日の安値

(2)当日の高値と前日の終値の差→当日の高値－前日の終値

(3)前日の終値と当日の安値の差→前日終値－当日安値

2)ATR=TrueRangeのn日間の指数平滑移動平均値を算出

2019年9月20日立会終了時点

東京金	東京白金	東京ガソリン	東京灯油	東京コーン
58.3	56.3	1574.0	1445.4	286.7

2019年9月19日立会終了時点

2019年9月19日立会終了時点

NY金	WTI原油	シカゴコーン	ドル円	ユーロドル
23.90	2.58	7.81	0.59	0.0066

2019年9月20日立会終了時点

日経平均
204.2

■小次郎講師から一言

皆さんは皆さんが取引しようとしている商品が1日当たり平均どれくらい変動するかを把握しているでしょうか？その数値をATRと呼び、ワイルダー氏が計算法を考案し、伝説のタートルズ流トレードシステムのリスク管理の考え方の根幹となりました。

たとえば金のATRに千をかければ金1枚当たりの1日のリスクが計算出来ます。ATRが50円であれば1日(1枚当たり)5万円のリスク、100円であれば10万円のリスクとなります。つまり取引している数量が同じでもATRが違ってくればリスクが違ってくるのです。

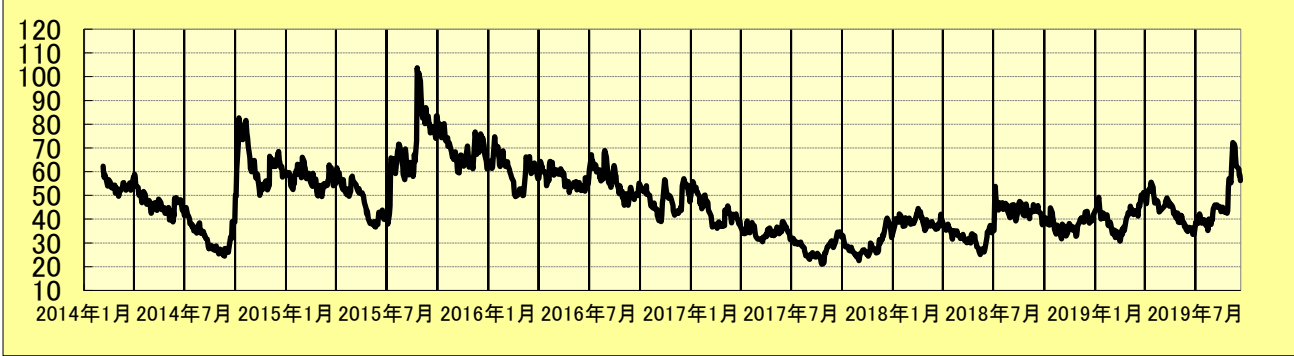
ATRはトレンド形成時に増加し、トレンドがなくなると減少する傾向があるので、トレンド発生を読み取るテクニカル指標としても使われます。

※ATRを使ったリスク管理・資金管理の手法に関しては、小次郎講師のトレーダーズバイブルで詳しく解説する予定

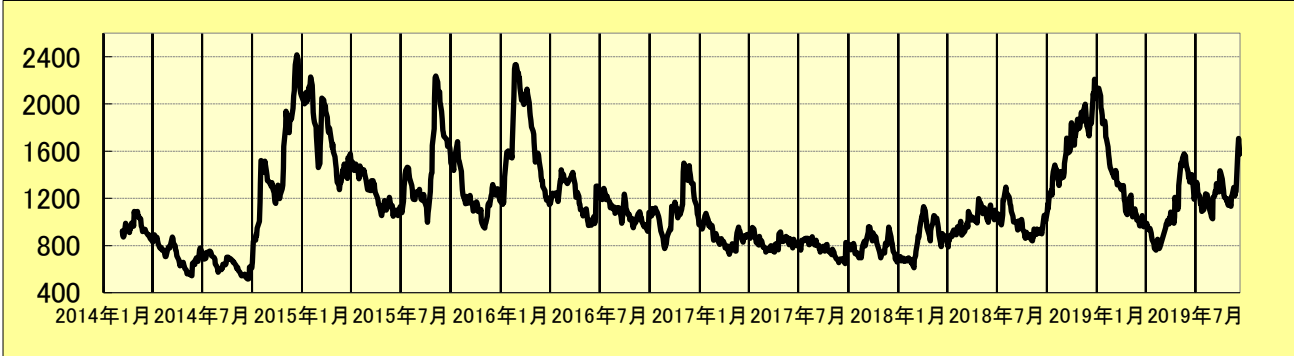
東京金 20日ATR(2014年2月～)



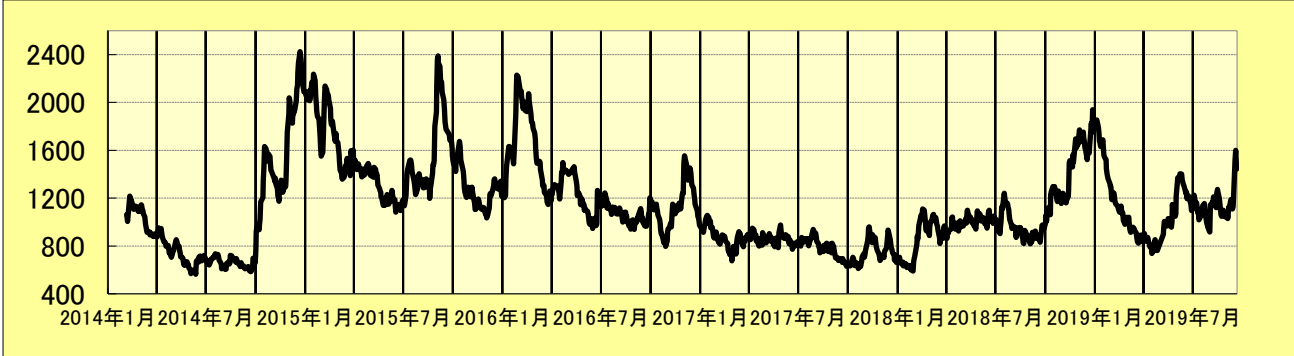
東京白金 20日ATR(2014年2月～)



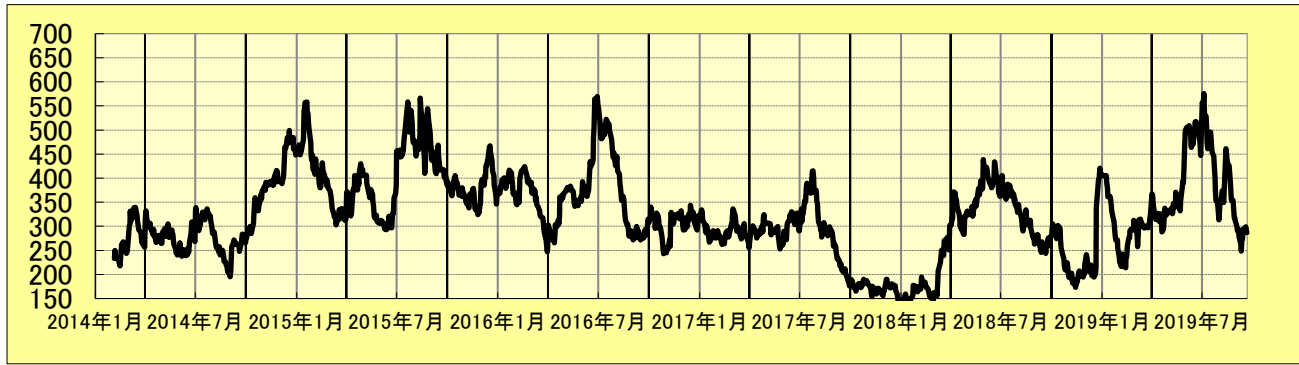
東京ガソリン 20日ATR(2014年2月～)



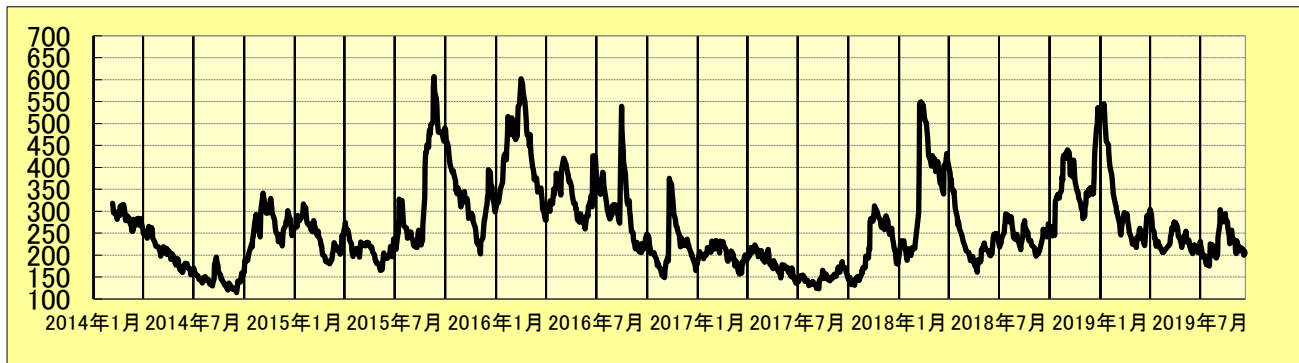
東京灯油 20日ATR(2014年2月～)



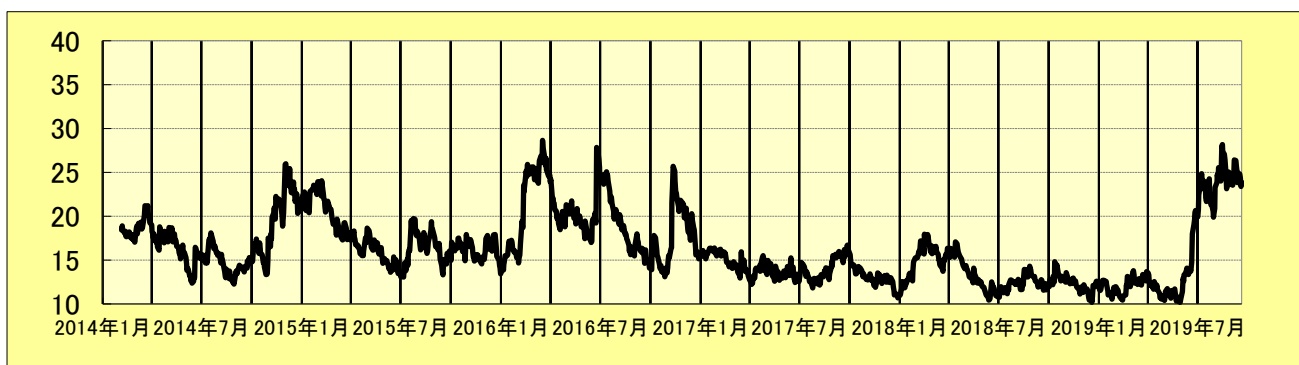
東京コーン 20日ATR(2014年2月～)



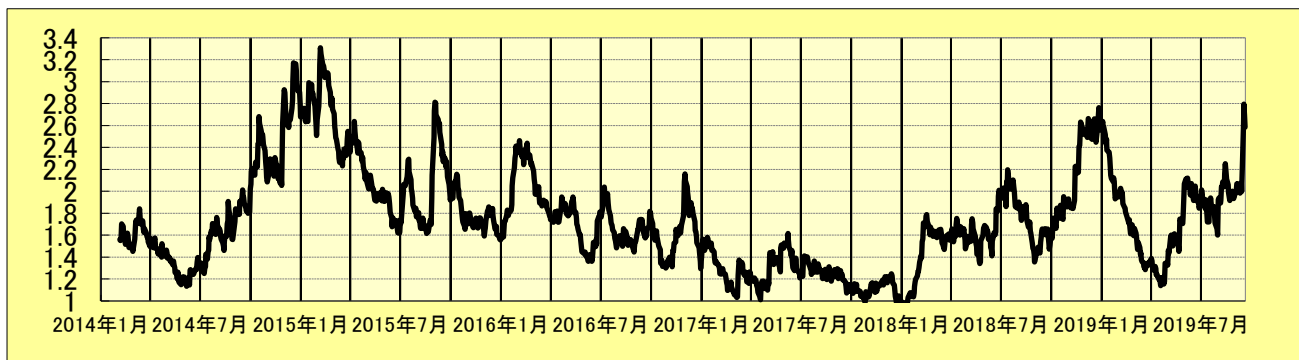
日経平均 20日ATR(2014年2月～)



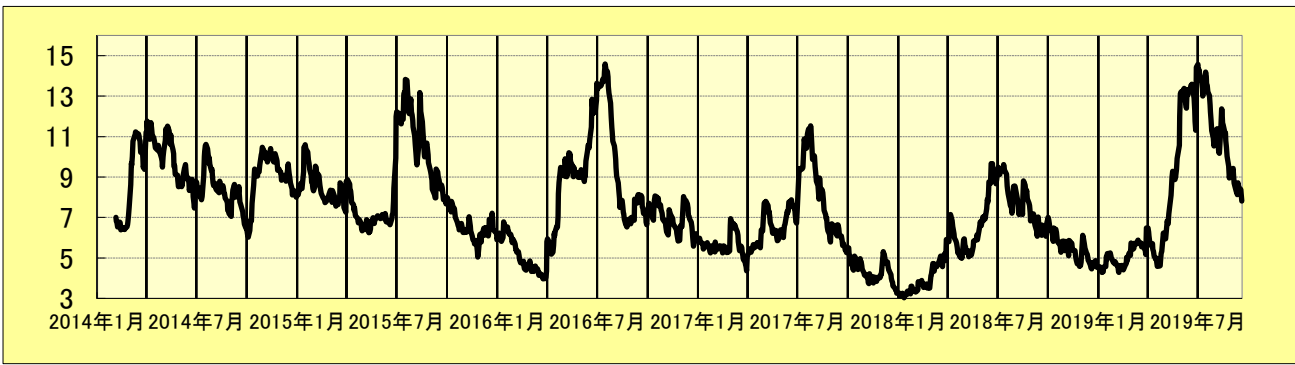
NY金 20日ATR(2014年2月～)



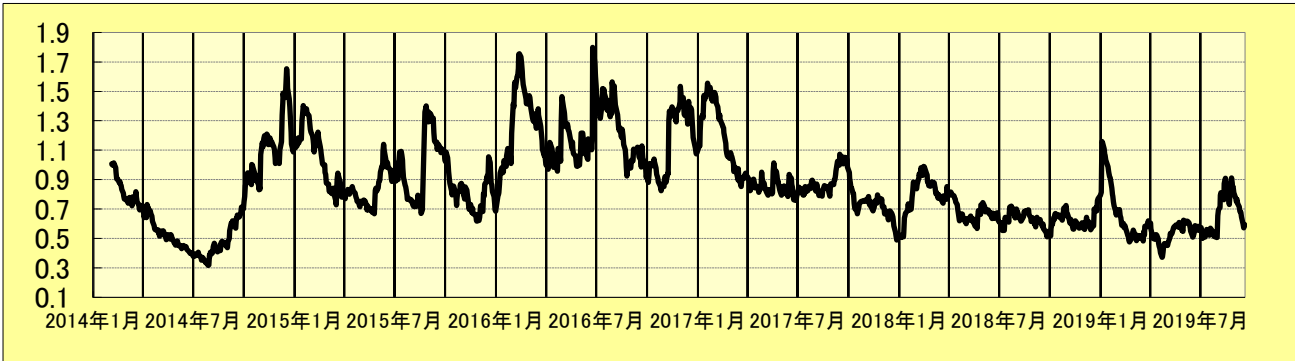
WTI原油 20日ATR(2014年2月～)



シカゴコーン 20日ATR(2014年2月～)



ドル円 20日ATR(2014年2月～)



ユーロドル 20日ATR(2014年2月～)

