

# 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トゥルー・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

2021年2月25日更新

金標準先物	白金標準先物	原油先物	NY金	NY原油
78.7	148.0	1068	30.1	1.79

ドル円	ユーロドル	トルコリラ	メキシコペソ円	南アランド円
0.59	0.0063	0.27	0.08	0.13

日経225	NYダウ
418.4	370.3

## ■小次郎講師から一言

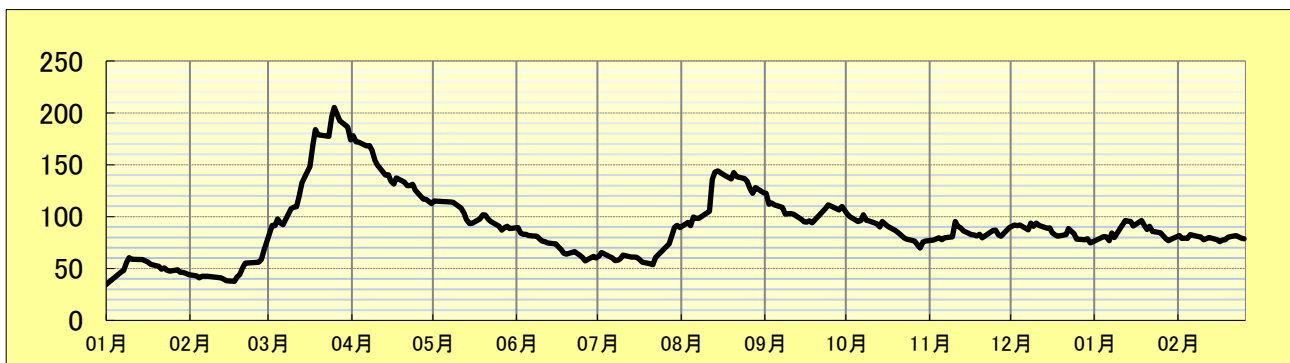
皆さんは皆さんが取引しようとしている商品が1日当たり平均どれくらい変動するかを把握しているでしょうか？その数値をATRと呼び、ワイルダー氏が計算法を考案し、伝説のタートルズ流トレードシステムのリスク管理の考え方の根幹となりました。

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。

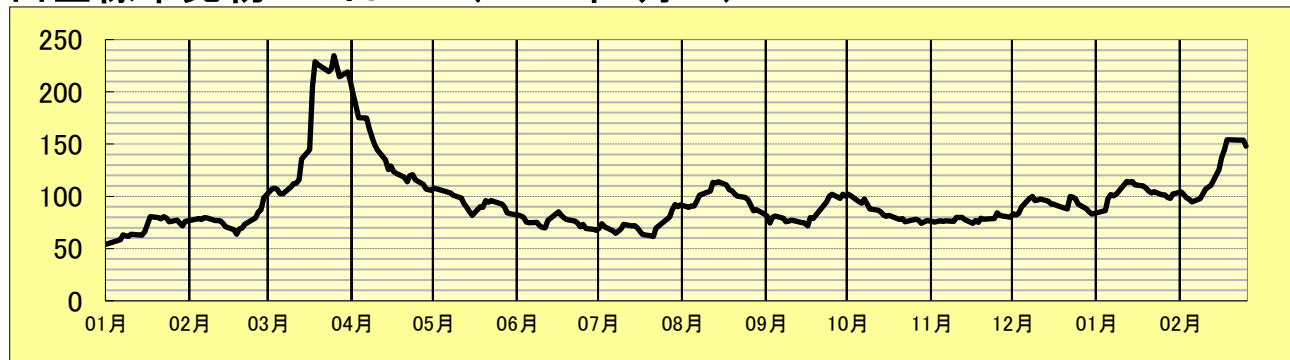
ATRはトレンド形成時に増加し、トレンドがなくなると減少する傾向があるので、トレンド発生を読み取るテクニカル指標としても使われます。

※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

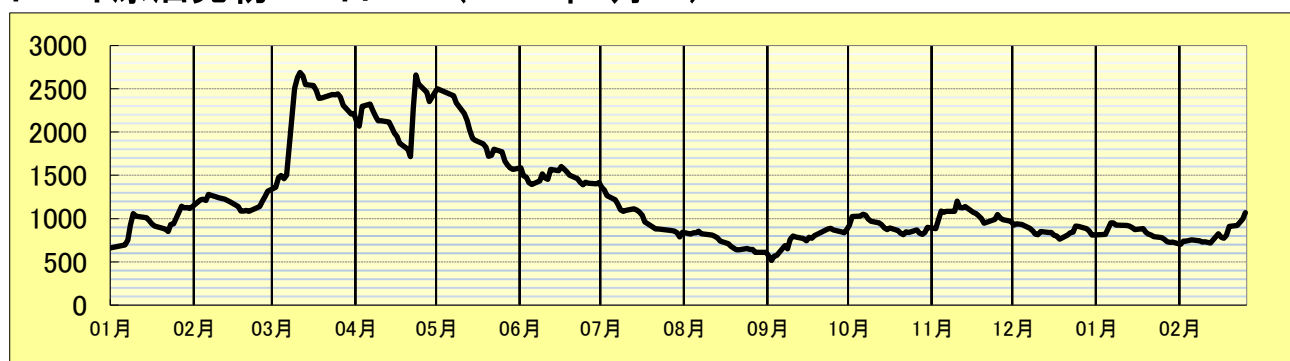
### 金標準先物 20日ATR(2019年1月～)



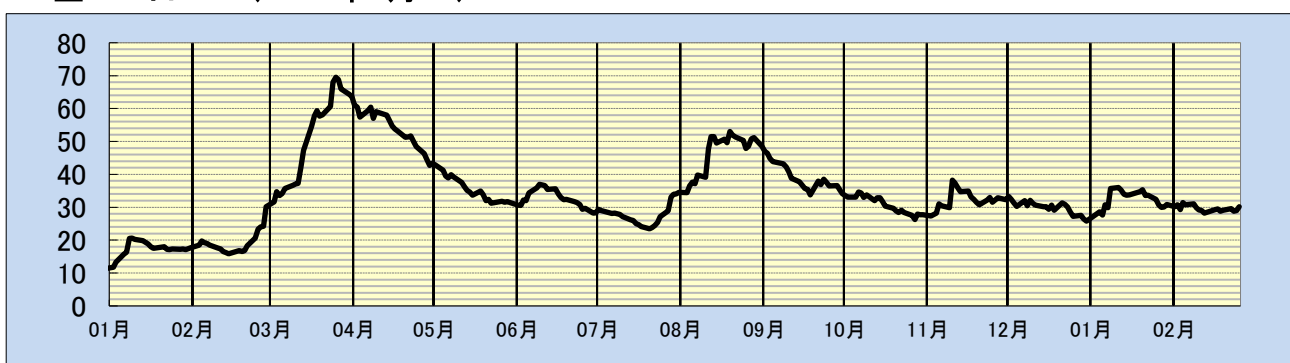
### 白金標準先物 20日ATR(2019年1月～)



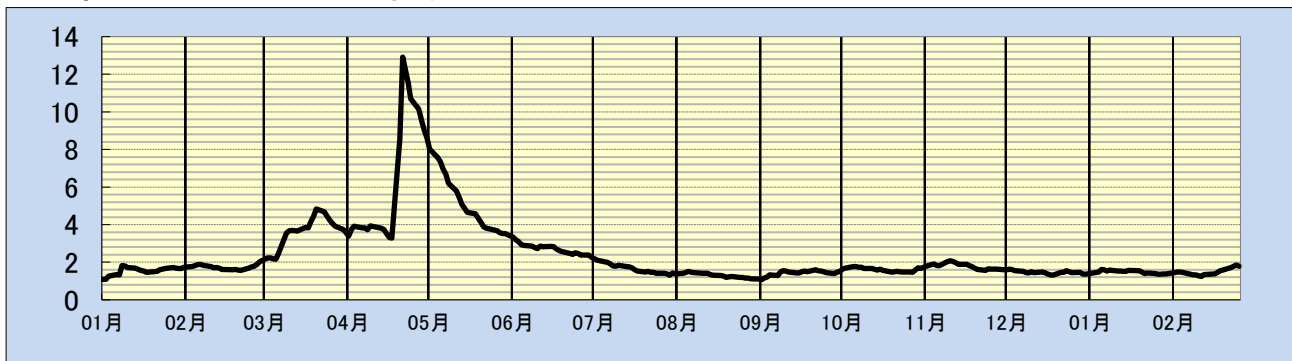
### ドバイ原油先物 20日ATR(2019年1月～)



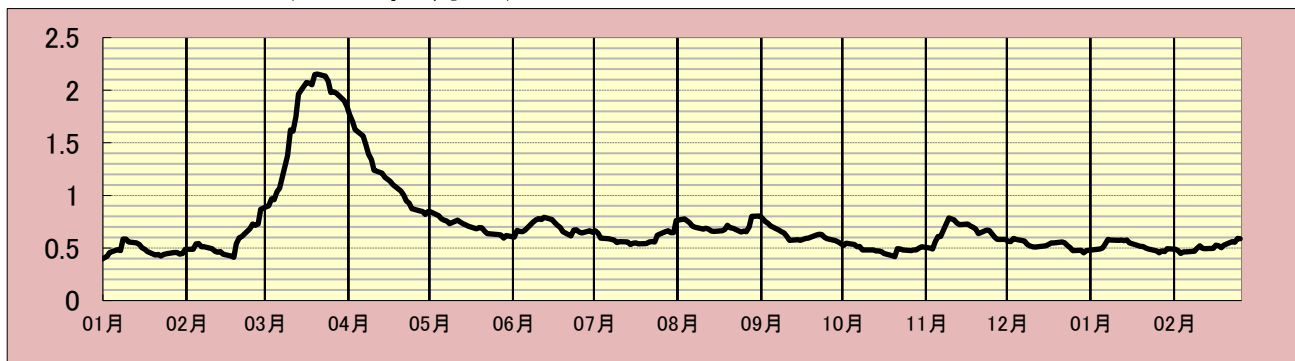
### NY金 20日ATR(2019年1月～)



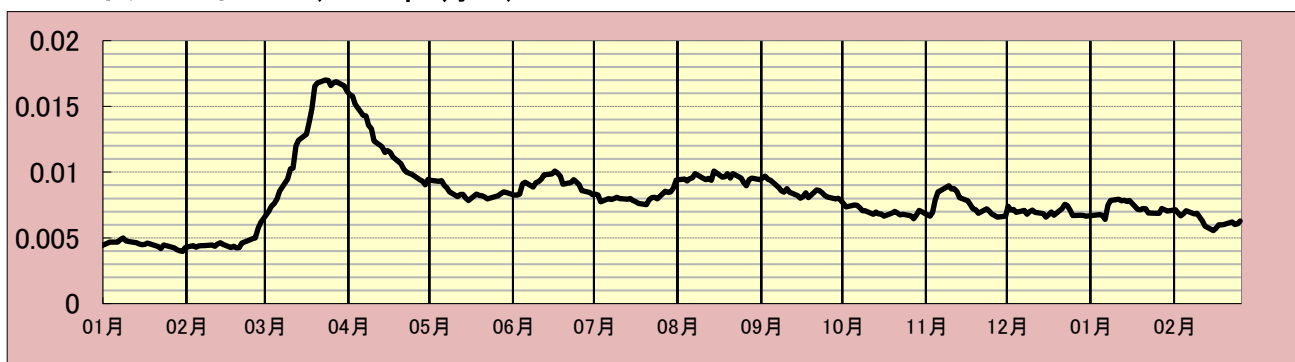
WTI原油 20日ATR(2019年1月～)



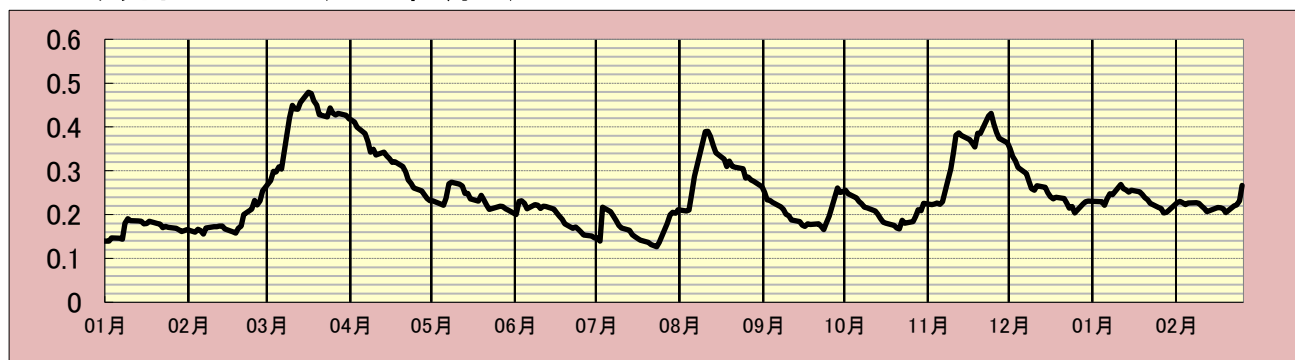
ドル円 20日ATR(2019年1月～)



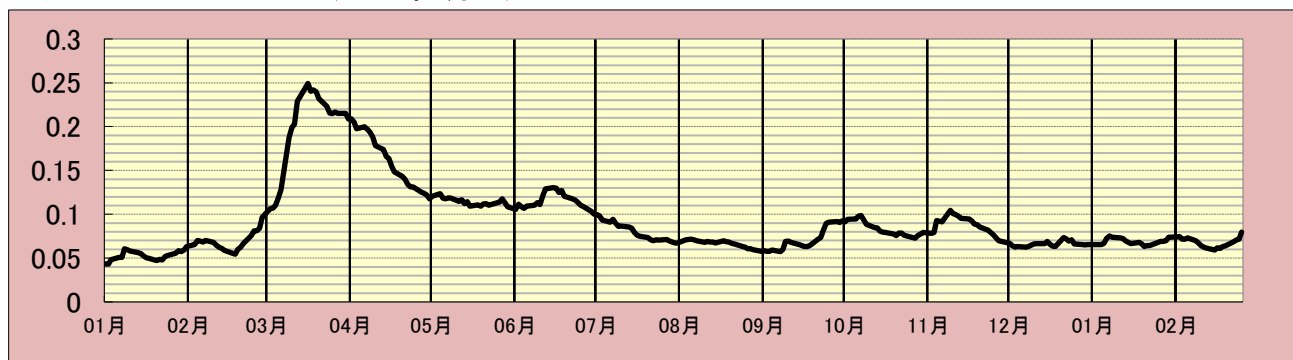
ユーロドル 20日ATR(2019年1月～)



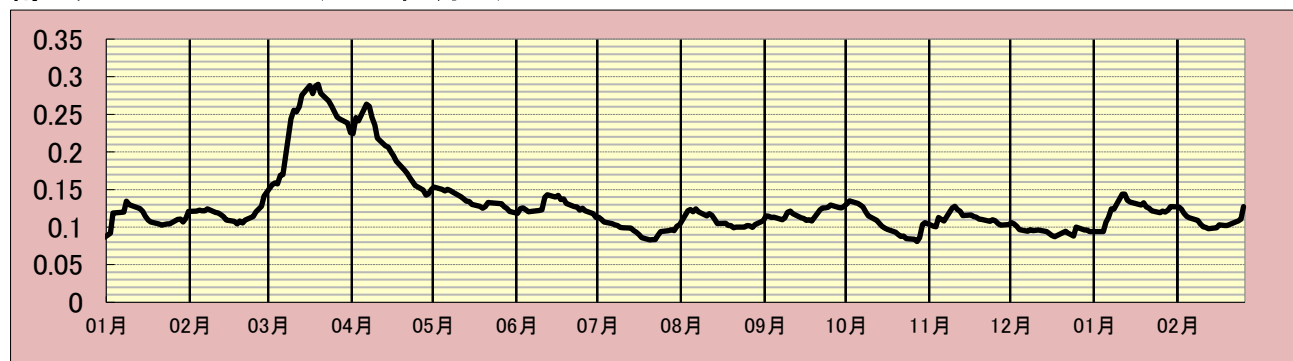
トルコリラ円 20日ATR(2019年1月～)



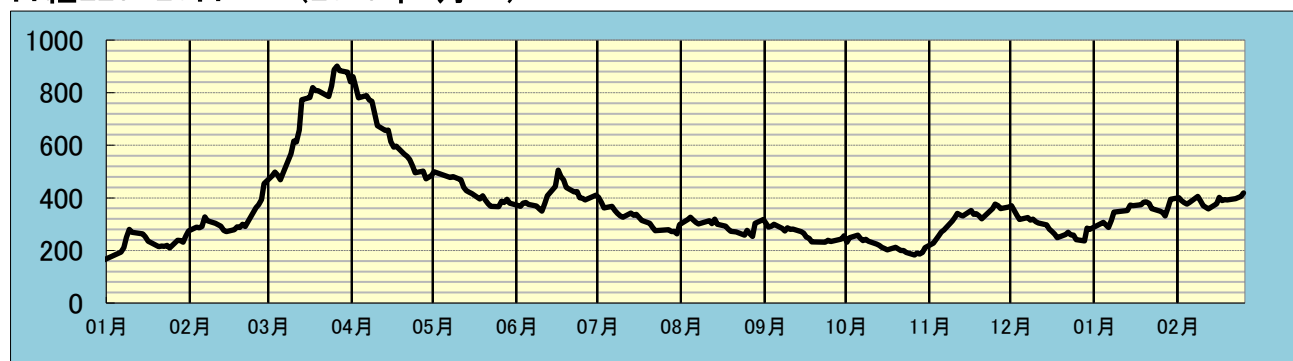
メキシコペソ円 20日ATR(2019年1月~)



南アランド円 20日ATR(2019年1月~)



日経225 20日ATR(2019年1月~)



NYダウ 20日ATR(2019年1月~)

