

日経先物ロボット by Excel VBA (MarketSpeed II RSS 用)

2023年12月10日

Copyright(C) by H.Imoto

■ 概要

日経先物ロボットは Windows10 以降で動作する自動売買ツールです。  
楽天 MarketSpeed II RSS + Excel でシグナルを抽出し自動発注します。  
マーケットスピード II RSS は発注機能を搭載しているため、自動売買が可能になりました。

■ 動作環境

Microsoft Windows 10 以降  
Excel2016 以降 (32bit、64bit)の動作する環境。  
楽天 MarketSpeed II RSS の動作環境はマーケットスピードの動作環境に順じます。  
楽天証券の先物・オプション取引口座を開設すると無料で楽天 MarketSpeed II RSS が使用出来ます。

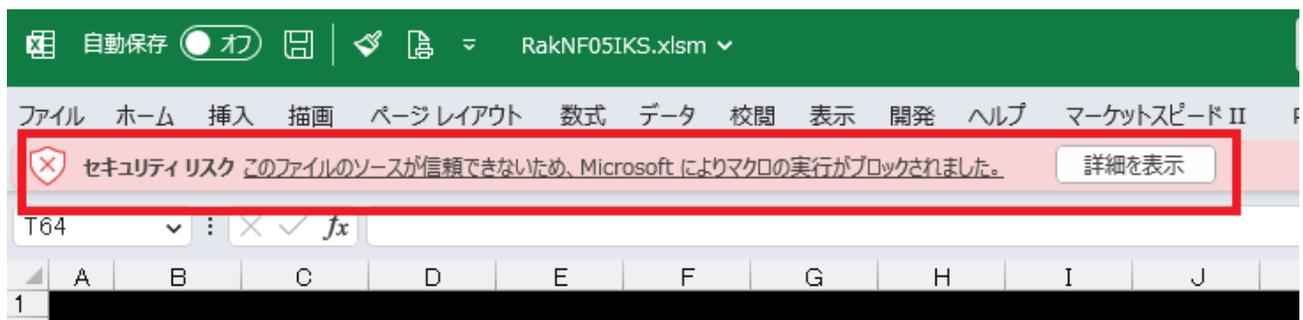
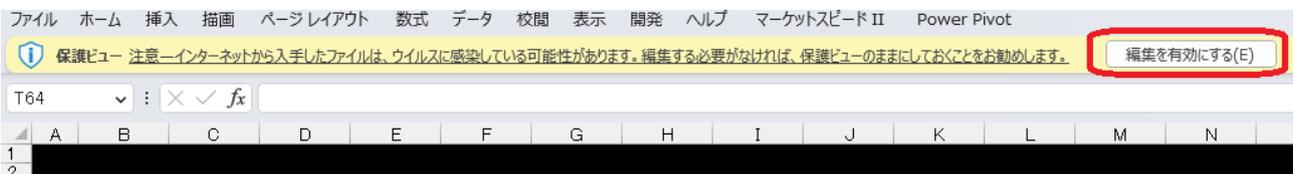
■ 検証環境

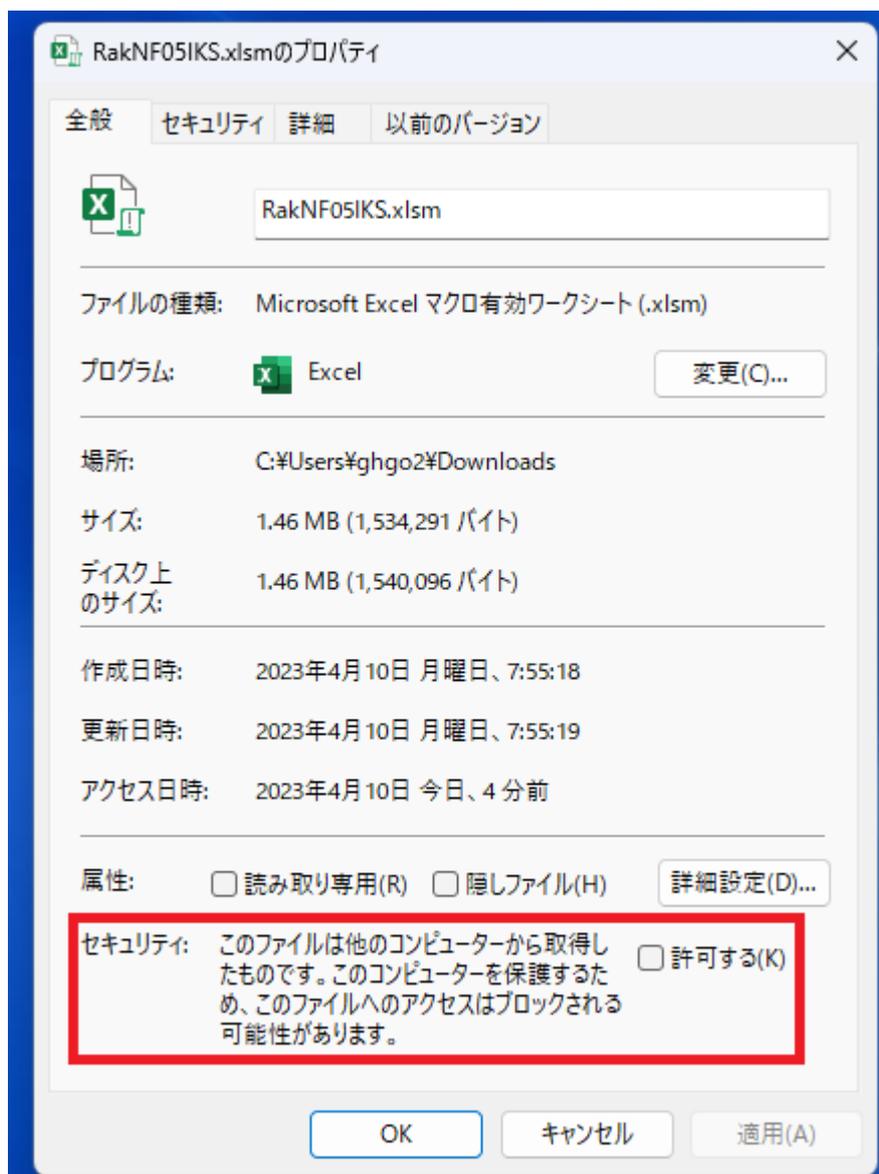
楽天 MarketSpeed II RSS  
Windows10 + 23 インチディスプレイ (1 枚)  
ディスプレイ左半面に MARKETSPEED II、右半面に RakNF05IKS.xlsm を表示しています。  
MARKETSPEED II オンラインヘルプを参照してアドイン登録→RSS 利用同意書の同意→  
RSS 注文機能利用設置→RSS 設定完了  
[アドイン登録 | マーケットスピード II RSS オンラインヘルプ](#)  
[https://marketspeed.jp/ms2\\_rss/onlinehelp/ohm\\_001/ohm\\_001\\_01.html](https://marketspeed.jp/ms2_rss/onlinehelp/ohm_001/ohm_001_01.html)

■ RakNF05IKS.xlsm のダウンロード

ライセンスキーを取得された方は下記 url から最新版をダウンロードしてください。  
[https://drive.google.com/drive/folders/1si9M\\_5hJng0CYyUhXYf2AtrbR8v0Cs\\_Q](https://drive.google.com/drive/folders/1si9M_5hJng0CYyUhXYf2AtrbR8v0Cs_Q)

■ RakNF05IKS.xlsm の起動 セキュリティリスクのマクロブロックを解除する。





#### ■ RakNF05IKS.xlsm の再起動

RakNF05IKS.xlsm 起動時に「ライセンスキー」入力画面が出ますのでライセンスキーを入力してください。

「ライセンスキー」を未契約の方は「キャンセル」をクリックして下さい。

VBA に保護が掛かっていますが「ライセンスキー」を入力すれば PW が Range (“F53”) に表示されます。

数式バーを表示して Range (“F53”) パスワードをコピーして Alt+F11 で VBA を開いてください。

VBAProject(RakNF05IKS.slxm)を W クリックしてください。(画像参照)

インプットボックスが出ますのでパスワードをペーストしてください。

マクロが開きますので編集が可能になります。

各シートのパスワードは「0000」です。

VBA 編集で自在に分足 (5, 10, 15, 30) の変更及び売買手法の構築も可能です。

#### ■ 5 分足株価 Data.xlsx のダウンロード (画像参照)

ブログ「5 分足株価 Data.xlsx」からダウンロードして下さい。<http://fcimoto.blog.fc2.com/>

Summary シート内「分析」ボタンをクリックすると 5 分足株価 Data ダウンロードメッセージがでます。

クリックしてブログから 5 分足株価 Data.xlsx を開いてすべてのデータ (Range (“B5”) ~ 最終セル) をコピーします。(Ctrl + C)







5分足株価データ : <http://fcimoto.blog.fc2.com/>

最新版 RakNF05IKS.xlsm 及び Ok3NF05IKS.xlsm : <http://fcimoto.blog.fc2.com/>

☆使用条件及び配布条件

当プログラムの使用、または使用不能によって生じたあらゆる損害についていかなる責任も負いません。

☆免責、無保証

当プログラムは私「いもと」が、個人的に趣味で作成したソフトウェアです。

使用条件において免責、無保証を定めていますので、この条件に同意できない場合は、

当プログラムを使用しないで下さい。

XX

☆質問等

サポート外のメール、電話等の質問には一切お答え致しません。

不具合修正や最新ベータ版等の参考になることはブログにアップしています。

XX

### ■謝辞

このプログラムを作るに当たって「自動売買ロボット：森田佳佑著」「Window マクロテクニック：小林シヤ著」を参考にさせて頂きました。

その他、ネット上で公開されている Tips や有用なツール使用させて頂いております。

公開されている方々に感謝致します。

### ■参考図書

「Excel 関数」「Excel VBA：土屋和人著」「Excel VBA Win64/32 API プログラミング：木村あつし著」「Python で Excel、メール、Web を自動化：中嶋 英勝著」「投資苑：福井 強訳」

XX

### ■追記 1

売買手法作成方法

Module2 の最終行 Function Robot\_Method() に売買手法マクロを書き込みます。

```
End Function
Function Robot_Method()
'-----
'プロシージャが大きすぎるため売買手法を分割
'こちらに独自の売買マクロを書き込んでください。
'-----
On Error Resume Next 'エラー回避処理 (2021/09/12)
'-----
'-----
```

```
End If
'-----
'2-1"逆張り売買(最高値の安値、最安値の高値)(2022/04/30)////////////////////////////////////
'-----
If E_Time(1) >= TimeValue("09:05") And E_Time(1) < TimeValue("14:45")
Or E_Time(1) >= TimeValue("17:00") Or E_Time(1) <= TimeValue("05:00") Then
'-----
If op(2) Then flag(4) = flag(2)
```

売買手法は RakNF05IKS.xlsm Calculation シートを参考にして EMA・MACD・一目均衡表・Stochastic・Parabolic・Bollinger bands・為替ドル/円・売買時間・出来高等を組み合わせて作成します。  
売買手法は市販品がたくさんありますが私は「投資苑」を参考にさせて頂きました。



■ 追記 2

リアル売買注文の方法

非営業日にテストして下さい。

① Summary シートの分析ボタンをクリック、エントリーは当方の売買手法です。

3											
4	時刻	始値	高値	安値	終値	Time	Long	Short	Entry Sigr	Entry Pric	E:
1289	10/06 22:45	31025	31025	30990	31000			▽			
1290	10/06 22:50	31005	31055	30975	30980			▽			
1291	10/06 22:55	30980	31000	30950	30965	22:55		▽	Short Entr	30975	
1292	10/06 23:00	30965	30975	30930	30960	23:00		▽			E
1293	10/06 23:05	30960	30970	30905	30915	23:05		▲			SI
1294	10/06 23:10	30915	30920	30875	30890			▲			

② Analysis シートエントリー行 (1291) を確認し Calculation1291~1310 行に空白行を挿入する。

4	時刻	始値	高値	安値	終値	出来高	Volume	EMA Diff	EMA_Crs	Sig	EMA(45)	Sig	C
1289	10/06 22:45	31025	31025	30990	31000	274922	9749	-3.64	0.63	▽	31065	▲	
1290	10/06 22:50	31005	31055	30975	30980	285317	10395	-5.68	-9.05	▲	31062	▲	
1291	10/06 22:55	30980	31000	30950	30965	295701	10384	-6.85	-17.44	▲	31057	▲	
1292													
1293													
1294													
1295													
1296													
1297													
1298													
1299													
1300													
1301	10/06 23:00	30965	30975	30930	30960	304577	8876	-6.62	-22.66	▲	31053	▲	
1302	10/06 23:05	30960	30970	30905	30915	314600	10023	-11.41	-34.13	▲	31047	▲	

③ Summary シートの分析ボタンをクリックして下さい。

3												
4	時刻	始値	高値	安値	終値	Time	Long	Short	Entry Sigr	Entry Pric	Exit S	
1287	10/06 22:35	31045	31110	31040	31080			▽				
1288	10/06 22:40	31080	31085	31015	31030			▽				
1289	10/06 22:45	31025	31025	30990	31000			▽				
1290	10/06 22:50	31005	31055	30975	30980			▽				
1291	10/06 22:55	30980	31000	30950	30965	22:55		▽	Short Entr	30975		
1292												
1293												

④ Analysis シートエントリー行 (1291) を削除。

3											
4	時刻	始値	高値	安値	終値	Time	Long	Short	Entry Sigr	Entry Pric	Exit S
1287	10/06 22:35	31045	31110	31040	31080			▽			
1288	10/06 22:40	31080	31085	31015	31030			▽			
1289	10/06 22:45	31025	31025	30990	31000			▽			
1290	10/06 22:50	31005	31055	30975	30980			▽			
1291											
1292											
1293											

⑤ Summary シート a.Range(L11~O11)を削除 a.Range("L20")を「S」 → 「E」に書き換える。

分足終値	本日始値	本日高値	本日安値	Time	Entry	Entry.P	Position	Exit	Exit.P
31,165	31,080	31,395	30,855						
	30,920								

設定	設定値
監視設定	0
監視時刻	8:45:00
現在時刻	10:55:18
設定時刻	8:45:00
自動売買	1

31350	31345	31320	31315
31350	31345	31320	31315
	2		
	51		

31335	31340	31345	31350	31345
31335	31340	31345	31350	31345

⑥ SummaryシートマーケットスピードⅡを「発注可」、a.Range(I15、I19)をクリックして「1」にする。

ファイル ホーム 挿入 描画 ページレイアウト 数式 データ 校閲 表示 開発 ヘルプ **マーケットスピードⅡ**

接続中 **発注可** 投資情報 チャート 注文約定 各種設定 更新

Units	L.C = 30	A.V = 55	MACD	IR, Target
			-10	
			90	
			10	

売買銘柄	現在時刻	現在値	分足始値	分足高値	分足安値	分足終値	本日始値	本日高値
日経Mini	06:00:01	31,335	30,980	31,000	30,950	30,965	31,080	31,395
168120019		31,335	+335	31,000		31,165	30,920	
169030019								

Date	Period	Time	Price	設定	設定値
2023/10/07	8:45:00	00:00:50	6:00:09.44	監視設定	1
0	00:01:00	8:45:01	30,980	監視時刻	8:45:00
0	00:02:00	8:45:02	31,000	現在時刻	10:59:12
0	04:59:50	8:49:59	30,950	設定時刻	8:45:00
31,080	05:00:00	8:50:00	30,965	自動売買	1
31,395	05:00:50	8:50:01			

⑦ Sub OnTime\_Robot\_System()を「F8 ステップイン」で売買を確認する。

```

222 End Sub
223
224 Sub OnTime_Robot_System()
225     ' Top(1)=MACD+EMA」及び「op(2)=一目均衡表+EMA」の手法を検証するマクロ
226     ' On Error Resume Next 'エラー処理
227
228     Equity = a.Range("C3") '総残高
229     Contracts = 100 '単元株数
230     Los_cut = a.Range("D5") 'ロスカット
231     Slippage = a.Range("C7") 'スリッページ
232     Target_Price = a.Range("E3") '目標価格
233     '-----フィルタの期間(2023/05/07)
234     If op(1) Then DI_Length = b.Range("Y4").End(xlDown).row
235     If op(2) Then DI_Length = b.Range("AD4").End(xlDown).row
236     Position = a.Range("O11")
237     lastrow = b.Range("B4").End(xlDown).row 'Sheets("Calculation")の最終行
238     i = lastrow '一時的に最終行をiに変換する。
239     c.Range("H" & i; "V" & i).NumberFormatLocal = "G/標準"
240     c.Range("H" & i; "V" & i).HorizontalAlignment = xlGeneral
241

```

⑧ 「F8：ステップイン」の結果を表示。



⑨ RakOrder シートに指値売買で発注 d.Range(C5)が「1」で発注します。

	A	B	C	D	E	F	G	H	I
1									
2		N225MF	168120019						
3					Reset				
4		新規注文				先物OP	取消注文		
5		=@IF(C5=1	1			Locked	0		
6		1	発注ID	10001		1	発注ID	10002	
7		2	発注トリガー	1		2	発注トリガー	0	
8		3	銘柄コード	68120019		3	注文番号	0	
9		4	売買区分	1					
10		5	注文区分	0		売数量	値段	買数量	
11		6	注文数量	2		40	31365		
12		7	価格区分	1		41	31360		
13		8	注文価格	31345		41	31355		
14		9	執行数量条件	3		45	31350		
15		10	執行時間条件	1		12	31345		
16		11	注文期限				31320	2	
17		12	逆指値条件価格				31315	51	
18		13	逆指値条件区分				31310	58	
19		14	逆指値価格区分				31305	81	
20		15	逆指値価格				31300	93	
21									

⑩ マーケットスピードⅡ 発注画面リアル売買では既に発注していますが画面はマーケットスピードⅡを「発注不可」で検証しています。

⑪ Excel マーケットスピードⅡを「発注可」にすると確認画面が出ます。

条件発注 (自動ロスカット)		
Locked 売	Locked 買	0
現在値	31335	
利食値		
損失値		
0 建単価		
LC/AV		
配信中		
建玉数量		
-----		

✕

**マーケットスピード II RSS**

⚠️

ワークシート上に注文関数が存在する場合、即時に発注される可能性があります。  
(有効となる注文件数：1件)

発注機能を有効にしてくださいよろしいですか？

OK      キャンセル

⑫ 発注機能「OK」

6	建口
7	

✕

**Realtime Spread Sheet 先物OP個別新規注文確認**

**168120019 日経225ミニ 23-12**

通常注文

売買	売建
市場	大阪
数量	2枚
価格	31,345円
執行数量条件	FAS
執行時間条件	当セッション

執行      キャンセル

