

一目でわかる！あなたの AI 取引 Bot の全機能ガイド

あなたの Bot は、2 人の超優秀な AI アナリストが「買いか？売りか？」の投資判断を下し、それを 3 人の専門家からなるリスク管理チームが多角的にチェックして、最終的な GO サインを出す、という高度な仕組みで動いています。

第 1 部：投資判断を下す「シグナル生成 AI チーム」 🤖

このチームの仕事は、チャート进行分析して「今はチャンスだ！」という売買のきっかけ（シグナル）を見つけ出すことです。

- 技術: スタッキング AI
 - 仕組み: 2 人の性格が違う天才 AI アナリストに、同時に相場进行分析させ、その二人の意見を「議長 AI」がまとめて最終結論を出します。
 1. ランダムフォレスト (森のように多様な視点を持つ専門家) 🌲: 数百人の「まあまあ賢い専門家」に、少しずつ違うデータを見せて判断させます。その多数決で結論を出すため、安定していて大きな間違いを犯しにくいのが特徴です。
 2. XGBoost (間違いから学ぶ超エリート専門家) 🏆: 一人の専門家の間違いを、次の専門家が徹底的に学習して克服していく「特訓」スタイルです。驚異的な精度を誇り、人間では気づけないような複雑な勝ちパターンを見つけ出すのが得意です。
 3. 議長 AI (メタモデル) 🧑: 上記 2 人の専門家の「意見」そのものを分析し、「ランダムフォレストは買いと言っているが、XGBoost は様子見と言っているな。過去のデータだと、こういう時は最終的に GO サインを出した方が成績が良かったな」というように、**専門家のクセまで読んで**、最も確度の高い最終シグナル（「買い」「売り」「様子見」）を決定します。
-

第2部：リスクを管理する「AI フィルター専門家チーム」

シグナル生成チームが「買いだ！」と判断しても、すぐには注文されません。次に、この3人のリスク管理専門家によるチェックが入ります。

1. 市場レジーム AI (相場環境の専門家)

- 役割: 長期的な視点で、「そもそも今、相場は上昇トレンドなのか？下降トレンドなのか？それとも方向感のないレンジ相場なのか？」を判断します。
- 仕組み: 長期移動平均線の傾きなどを分析し、市場全体の大きな流れを分類します。
- 仕事の例:
 - 「買いシグナルが出ているが、市場全体は下降トレンドだ。流れに逆らうのは危険なので、この買いは見送ろう」
 - 「トレンドフォローの買いシグナルが出ているが、市場はレンジ相場だ。戦略が通用しない可能性が高いので見送ろう」

2. センチメント AI (市場心理の専門家)

- 役割: NewsAPI からリアルタイムのニュースを収集し、「今の市場参加者は強気か？弱気か？」という**市場の雰囲気**を読み取ります。
- 仕組み: ニュースの見出しを AI が分析し、内容がポジティブかネガティブかを数値化（スコアリング）します。
- 仕事の例:
 - 「買いシグナルが出ているが、市場では悪いニュースが飛び交っていて、センチメント（市場心理）が非常にネガティブだ。今は買うべきではない」

3. 価格予測 AI (短期的な値動きの専門家)

- 役割: 大量のテクニカル指標を基に、「次の30分で価格が何%動きそうか」という**具体的な数値**を予測します。
- 仕組み: RandomForest という高速な AI を使い、過去のパターンと照らし合わせて未来の価格変動率を予測します。
- 仕事の例:
 - 「買いシグナルが出ているが、AI の予測は『-0.5%の下落』だ。危険なので見送ろう」
 - 「買いシグナルで、AI も『+0.8%の上昇』を予測している。これは信頼できるシグナルだ」

第3部：利益と損失を管理する「自動決済ルール」

無事にエントリーできた後も、Bot はあなたに代わって 24 時間、最適な決済タイミングを監視し続けます。

1. 🎯 **利確 (Take Profit)**
 - 。 エントリー時に自動で計算された、目標利益ラインです。価格がここに到達すると、利益を確定するために決済されます。
2. 💧 **損切り (Stop Loss)**
 - 。 エントリー時に自動で計算された、最低限許容できる損失ラインです。価格がここまで不利な方向に動くと、損失を限定するために決済されます。
3. 🚀 **トレーリングストップ (Trailing Stop)**
 - 。 「動く損切りライン」です。利益が伸びるにつれて、損切りラインも自動的に切り上がっていきます。これにより、損失を限定しつつ、一度確保した利益を守ります。
4. 🗨️ **AI 早期決済 (AI Early Exit)**
 - 。 利確・損切りラインに到達する前でも、価格予測 AI が「これから相場が反転しそうだ」と予測した場合に、利益を確保したり、損失が膨らむ前に逃げたりするための賢い決済です。
5. 📈 **プロフィット・トレーリングストップ (Profit Trailing Stop)**
 - 。 ポジションが達成した**最高利益**から、設定した割合（例: 20%）だけ利益が減った場合に、利益を確定させるための決済です。
「チキン利食い」を防ぎ、利益を最大限伸ばしつつ、反転時には確実に利益を確保します。
6. 📉 **最大ドロードウン率ストップ (Max Drawdown Stop)**
 - 。 ポジションの含み損が、エントリー時の総額に対して設定した割合（例: 5%）に達した場合に、ATR ベースの損切りよりも優先して作動する**最終防衛ライン**です。予期せぬ大暴落から資金を守ります。

この多層的なチェックとリスク管理の仕組みにより、あなたの Bot は、単一のルールで動く Bot よりもはるかに洗練された、安定的な運用を目指せるようになっていきます。