





















































00

1.00

1.1 背景

Michael HuddlestonICT

1.2 背景

1. 000000000008000000M50MNM0000ICT00000002. 000000123000000ML000000000003.
000000002025-20260000000000000004. 0000000000OU0Hurst0GARCH0Monte
Carlo0Kelly005. 0000000000000 > 1.50

2. ICT環境

ICT00080000

ICT00	00000
00000	000000000000/00000/000000000000H1000000000
0000000 FVG	0030K00000000000006000000M50D1000000000000
0000 OBS	000000000000K0 —
	000000000000ATR(14)060000000000
00000 BRK	0000000000000000/000000OB0000
0000000 MSS/BOS	00000000000000000000600000000000
000 HVN/LVN	00MT5 tick-
	0000000000000000000000600000000000
0000	00000→00→0000000000K00000
000000	00000000+1.6180+4.000000000000

3. 特徴量エンジニアリング

Diamondデータセットの8特徴量とTFIDF特徴量を抽出する

特徴量	Tenkan	Kijun	Kumo	T/K Cross	Flat History
M5	X	X	-	X	-
M15	X	X	-	X	-
M30	X	X	-	X	-
H1	X	X	X	X	X
H4	X	X	X	X	X
D1	X	X	X	X	X
W1	X	X	X	X	X
MN	X	X	X	X	X

4. Diamondデータセット

Diamondデータセットの10特徴量と109特徴量を抽出する

特徴量	特徴量	特徴量
H1-D1	24	Kijun/TenkanとT/K CrossとKumoとFlat History
W1-MN	8	Kijun W1/MNとKumo W1/MNとFlat History
FVG60TFD	12	M5D1とFVG60TFD/TFIDF%とFlat History
60TFD	12	M5D1とOB60TFD/TFIDF/TFIDF
MSS/BOS60TFD	18	M5D1とBOS60TFDとCHoCH
HVN/LVN60TFD	12	M5D1とHVN/LVN60TFD
60TFD	12	M5D1とBRK60TFD
TFIDF	4	AH/ALとH/L
TFIDF	5	TFIDF→TFIDF→TFIDFとFVG60TFD
M30/M15/M5 Kijun	2	Kijun M30/M15/M5

特徴量: 109 特徴量MN107

5. データセット

MLデータセットの3特徴量を抽出する

特徴量	特徴量	特徴量
1	ml_labeler.py	Diamondデータセットの8特徴量/TFIDF/TFIDFとoutcom
2	ml_trainer.py	XGBoostの5特徴量とscale_pos_weightとTFIDF
3	ml_predictor.py	TFIDFとextract_features() → predict_proba() → ML%とTFIDFとTFIDFとMLPredictorの1とjoblib.loadの5

6. XGBoost v18 —

v18 1,210 GARCH

max_depth	6
learning_rate	0.03
n_estimators	200
subsample	0.8
min_child_weight	3
gamma	0.1
reg_alpha	0.5 L1
reg_lambda	1.0 L2
scale_pos_weight	

123 Kijun 6 TF 18 Tenkan 6 TF 18 T/Kumo 6 M5/M15/M30 12 Carlo GARCH 3

7. 27 XGBoost

27 XGBoost

				CV	OOS PF
v1	6	36	852	61.0%	—
v4	13	111	1,210	62.9%	1.26*
v7	13	25	2,923	60.1%	1.173
v13	4	25	2,923	53-64%	4.000
v15	2025-2026	25 + OU/Hurst	5,009	59.8%	—
v18	13	123 GARCH	1,210	64.0%	0.503 F1

8. v4

1	is_dxy	14.2	
2	rr	10.0	
3	tkx_h1	9.2	H1 Tenkan/Kijun
4	kj_h1	6.9	H1 Kijun
5	sl	6.4	
6	day_wednesday	6.4	FOMC
7	d_kj_h4	6.3	H4 Kijun

