

2013年4月8日

インヴァスト証券株式会社
代表取締役社長 川路 猛
(JASDAQ コード: 8709)

シストレ 24 月間レポート (2013年3月)

人気ストラテジーTOP10のうち プラスは4割

対円通貨ストラテジーが8つランクイン

インヴァスト証券 FX 自動売買サービス「シストレ 24」の月間レポート (2013年3月) をお知らせいたします。
(※シストレ 24 では、「売買プログラム」のことをストラテジーといいます。)

なお、昨年1月より毎月発行しておりました本レポートは、今月号を持ちまして終了させていただきます。
今後は、リニューアルいたしました「シストレ 24 攻略サイト」(<http://www.invast.jp/st24mr/advantage/>) 等にて、鮮度の高い情報を提供してまいりますので、ぜひご覧ください。引き続き「シストレ 24」をよろしく願います。

【レポートサマリー】

- ・お客様に選ばれたストラテジーTOP10のうちプラスは4割。キプロスショックの影響か。
- ・先月に続き、対円通貨ストラテジー人気を集め8つがランクイン。
- ・圏外からのランクインは2つ。短期的トレンドフォロー型ストラテジーがランクイン！

■3月 人気ストラテジーランキング TOP10 (期間 2013年3月1日~3月31日)

シストレ 24 に搭載されたストラテジーのなかで、実際に取引された (お客様に選ばれた) ストラテジーのランキングです。

RANK	前月 RANK	ストラテジー名	通貨ペア	選択比率	期間損益 pips	1万通貨円換算
1	1	ThirdBrainFx	AUD/JPY	56.7%	-784.7	-78,470 円
2	4	Home Runs	USD/JPY	20.6%	-1,138.9	-113,890 円
3	2	ThirdBrainFx	CAD/JPY	17.2%	-1,230.5	-123,050 円
4	5	ExoticFx	USD/JPY	15.0%	-720.0	-72,000 円
5	3	Pminvestcapital	EUR/GBP	13.0%	-312.3	-44,703 円
6	7	Pip master	NZD/USD	12.7%	+118.0	+11,114 円
7	圏外	sky_05_MA2_UJ	USD/JPY	8.7%	+283.0	28,300 円
8	10	ThirdBrainFx	NZD/JPY	7.1%	-888.2	-88,820 円
9	圏外	Slalom	USD/JPY	6.8%	+470.4	+47,040 円
10	9	QuickShift	EUR/JPY	6.6%	+61.0	+6,100 円

※損益 pips は取引画面の上のストラテジーカードから該当する期間の決済時損益情報を掲載しています。

※選択比率は月間の総取引人数に対して、期間中、実際に取引(決済)した人数となります。

※損益円換算は、3月29日の(株)東京金融取引所「くりっく365」の終値で換算しています。

※期間損益は、該当期間の実現損益の合計であり、評価損益は含まれておりません。

3月の人気ランキングでは、TOP10のうち4つのストラテジーが利益をあげる結果となりました。

2月に続き対円通貨ペアのストラテジーが人気を集めTOP10圏内に8つランクインしましたが、その結果は、好調な2月とは対照的に不調なものが目立ちました。キプロスショックの影響を受けたストラテジーが多くあった一方、圏外からランクインし利益を上げているストラテジーもあります。お客様ご自身が選んでいるストラテジーチェックしていただくことはもちろん、相場動向にマッチしたストラテジーの検索も定期的に行いましょう。

※本ランキング使用上のご注意

本ランキングに掲載されているストラテジーは、シストレ24に存在するごく一部のストラテジーです。本ランキングはシストレ24運用利益を保証するものではなく、また、全てのストラテジーで利益が出ているわけではありません。他のストラテジーの詳細や損益、ランキングについては「Myシストレ24」または取引画面よりご確認ください。

■ストラテジーレポート | インヴァスト証券投資情報室 山口哲也

対円通貨はキプロスショックで調整の動きに

2013年3月の外国為替相場は、本邦の金融緩和期待と引き続き強めの米経済指標により、米ドル/円は3月12日に3年8カ月ぶりとなる高値96.72(東京金融取引所くりっく365)まで上昇いたしました。その後、キプロスへの金融支援を背景としたリスクオフの動きにより円は買われ、対円通貨は総じて3月末にかけては軟調な展開となりました。

ThirdBrainFx などの人気ストラテジーは不調な結果に

こういった相場状況の中、人気ランキング1位~4位は、ThirdBrainFx (AUD/JPY)、HomeRuns (USD/JPY)、ThirdBrainFx (CAD/JPY)、ExoticFx (USD/JPY) と、根強い人気を保つトレンドフォロー型のストラテジーがランクインしました。この4ストラテジーに共通する特徴は、日足ベースでトレンドを判断し明確なトレンドが継続する場合には大きな利益をあげやすい点だと思われます。しかしながら、3月は前述の通り対円通貨の相場反転が影響し、結果をあげることができなかったと考えております。

sky_05_MA2_UJ(USD/JPY)とSlalom (USD/JPY) が初ランクイン!

人気ランキングTOP10に初めてランクインした7位のsky_05_MA2_UJ (USD/JPY) と9位のSlalom (USD/JPY) もトレンドフォロー型のストラテジーではありますが、どちらも利益を上げる結果となりました。

上位を占めるストラテジーが中期的なトレンドフォロー型であるのに対して、この2つのストラテジーはトレンドを判定する期間や取引期間(建玉の保有期間)から、より短いサイクルで取引する短期的なトレンドフォロー型ストラテジーであることが見て取れます。そのため、米ドル/円の相場の波を上手に乗りこなして利益を上げたものと考えられます。

また、この2つのストラテジーは、短期的なトレンドフォロー型のストラテジーという以外にも、最大ポジションが1で、売ポジションと買いポジションの転換を柔軟に行うなど共通する特徴があります。

逆に異なる点は、sky_05_MA2_UJ (USD/JPY) は、Slalom (USD/JPY) より勝率がやや高めで平均利益が少なく平均損失が大きいことが統計情報から読み取ることができます。

こういった違いがあるものの、ストラテジーの特徴から考えると、ボラティリティが小さい相場展開で、短いサイクルで乱高下する際には注意が必要です。

引き続き 対円相場とユーロ動向に注目

4月からの相場動向については、4月4日の日銀政策決定会合後の対円通貨の相場の動向と、ユーロ動向に注目しております。(レポートは4月4日の夕方記載)

3月28日の参議院で黒田日銀総裁の金融政策の説明は、「市場の期待に働きかけ、市場とのコミュニケーションをおこなっていく」という内容でした。4月4日の日銀政策決定会合までの対円相場からは、市場の期待感は低下していたとも受け取れますが、発表された金融政策は「量的・質的金融緩和の導入」と事前に想定されていた選択肢をほぼ全て盛り込み、国債の購入規模やリスク資産の購入規模などは予想額を上回るものとなっています。

このような市場対話型の金融政策は今後も継続すると考えられ、米ドル/円においては引き続き円安トレンド継続との見方ができるかと思えます。

一方、ユーロ圏に目を向けると、比較的体力のあるドイツの経済指標も弱めの数値となっており、2月のレポートでお伝えした通り、ユーロ/ドルはテクニカル的にも下げトレンドの継続が確認されております。

このような相場状況で、ストラテジーの選択・見直しをおこなわれる際には、ポートフォリオ全体の建玉数量を元に資金管理を徹底するのは当然ながら、ご利用されるストラテジーが取引する通貨ペアのトレンドを確認し、トレンドフォロー型のストラテジーを中心にポートフォリオを組みることが有効ではないかと考えます。

■ FX自動売買サービス「シストレ24」とは

シストレ24のプラットフォームは、その性能の高さから世界中で20社以上に導入されているTradency社の「Mirror Trader」。バックトレードシステムは、機関投資家などのプロ投資家向けに開発され、世界のプロ投資家やブローカーから高い評価を受けているFX取引の最先端システムCURRENEX社のトレードシステム。さらにストラテジーはMirrorTrader標準搭載の約1500種類に加えて、国内で実績のあるストラテジープロバイダー各社のストラテジーを追加搭載しています。世界中の優れたパートナー企業との連携により、最高水準の性能を兼ね備えたFXシステムトレードを無料でご提供いたします。

【お問合せ先】

- ・サポートセンター TEL:0120-729-566 受付時間 8:00~18:00 (土日、元日を除く)
- ・メディア関係お問合せ先 営業企画部 TEL:03-3595-8907

本社所在地：東京都港区西新橋一丁目6番21号 NBF 虎ノ門ビル

代表者：代表取締役社長 川路 猛

資本金：59億6,508万円 設立：昭和35(1960)年8月10日

上場市場名：JASDAQ(コード：8709) 事業内容：金融商品取引業

登録番号：金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第26号

加入協会：日本証券業協会、一般社団法人金融先物取引業協会

URL：<http://www.invast.jp/>

●本レポートは、投資判断の参考となる情報提供を目的にしたもので、収益の保障や投資助言、投資勧誘を目的としたものではありません。●過去の実績は、将来の結果を保証するものではありません。●提供する情報等は作成時現在のものであり、今後予告なしに変更又は削除されることがございます。●ストラテジー選択など投資にかかる最終決定はお客様ご自身の判断と責任でなされるようお願いいたします。●各種情報の内容については万全を期しておりますが、その正確性を保証するものではありません。また、これらの情報によって生じたいかなる損害についても、当社は一切責任を負いかねます。●本レポートの内容に関するすべての情報について、当社の許可なく転用・販売することを禁じます。

【リスク・費用などについての重要事項】

本取引は、取引通貨の価格および金利等の変動により損失が生ずるおそれがあります。また、スワップポイントが受取りから支払いに転じることもあります。当社は、必要証拠金率が一定水準以上となった場合、全建玉を自動的に強制決済（ロスカット）いたしますが、本取引は、預託すべき証拠金額以上の取引が可能なため、急激な相場の変動等によっては、証拠金の額を上回る損失が発生するおそれがあります。

■売買手数料は、新規注文・決済注文ともに無料です。■本取引は、通貨ペアの売付けの価格と買付けの価格に差（スプレッド）があり、相場急変時等はスプレッドが拡大する場合があります。■証拠金は、時価評価額の4%の額（円換算額）で、証拠金の25倍までのお取引が可能です。（平成25年4月1日現在）

【シストレ24に関する重要事項】・「シストレ24 Mirror Trader」（以下「本サービス」といいます）は、お客様がストラテジーを選択し、選択したストラテジーが設定したシグナルにしたがって自動売買を行う取引システムです。また、お客様の裁量により、手動売買を行うことも可能です。・選択したストラテジーは、無効にすることや、ポートフォリオから除外することができます。その際、既に自動売買で成立したポジションについては、自動売買により決済されますが、手動売買で決済することも可能です。・複数のストラテジーを組合せた場合、利益が大きくなる可能性がある反面、損失が増幅する可能性があります。・本サービスは、お客様の証拠金預託額に応じて取引のクラス分けがなされ、1回の売買シグナルにおける発注数量がクラスごとに制限されます。・ストラテジーの過去における実際の運用成績は、将来の運用成績を保証するものではなく、相場の状況によっては、過去の運用成績を大きく下回るおそれがあります。・本サービスは、当社が正確性・確実性を期すよう努めておりますが、完全性を保証するものではありません。また、予告なしに情報および内容を変更する場合がありますのでご注意ください。・本サービスの利用によって生じた損害（パソコンやネットワークに生じた損害を含み、損害の種類を問いません）やその修理費用などに関して、当社は、一切責任を負いませんのでご了承ください。・本サービスは、ストラテジープロバイダー（ストラテジー提供者）の判断により、ストラテジーが予告なく削除・変更される場合があります。・本サービスは、ストラテジープロバイダー（ストラテジー提供者）が決済シグナルを当社の取引時間外に発信した場合、取引開始後に約定するため、シグナル発信時の価格と約定価格が大きく乖離する可能性があります。この場合、お客様の証拠金状況によっては、ロスカットされるおそれがあることや、お預かりした証拠金を上回る損失が発生するおそれがあります。・本サービスは、設定された最大保有ポジション数以上の建玉を保有する可能性があります。この場合、お客様の証拠金状況によっては、ロスカットされるおそれがあることや、お預かりした証拠金を上回る損失が発生するおそれがあります。・本サービスは、同一ストラテジーの売買シグナルでも約定時間および約定価格が異なる場合があります。