

第1章 株でも先物でもFXでも システムトレードなら 勝ちやすい!

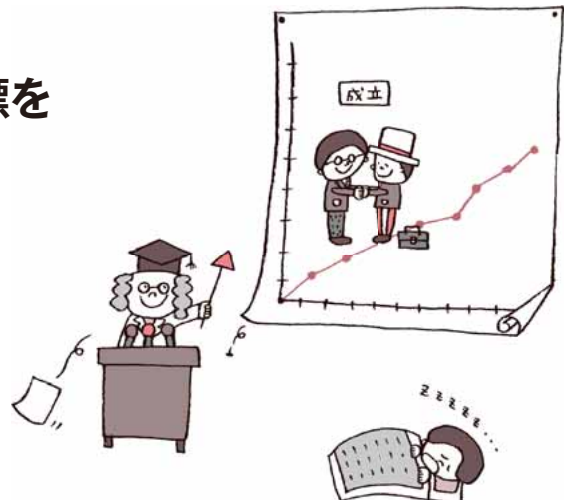
- 008 アナタが株や先物で負けるホントの理由は?
- 010 システムトレードってどんなもの?
- 012 使うとどんなメリットがあるの?
- 014 デメリットはあるの? 注意すべき点は?
- 016 売買モデルの作り方のポイントは?
- 018 売買モデルの作り方を具体的にみていこう
- 020 バックテストってどんな作業をするの?
- 022 バックテストの結果と分析
- 024 「行動ファイナンス」入門コラム①

第2章 システムトレードに 欠かせない 「日経平均先物」 って何だ?

- 026 代表的な「株価を測る物差し」を取引する商品
- 028 やっと「二十歳」を過ぎた若い金融商品
- 030 約1000万円の取引が約100万円の元手のできる
- 032 いい証券会社を選ぶことが勝つ第1歩
- 034 「値洗い」と「追証」についても理解しておこう
- 036 メリットと注意点をきちんとおさえよう!
- 038 「行動ファイナンス」入門コラム②

第3章 システムトレードで 重要なテクニカル指標を おさえよう

- 040 そもそもテクニカル指標って何だろう?
- 042 トップバッターはあの有名な移動平均線!
- 044 移動平均線の発展型・MACDのキホン
- 046 オシレーター系の代表格、ストキャスティクス
- 048 相場の反転を見極める時に使うと便利なRSI
- 050 統計学を応用したボリンジャーバンド
- 052 相場の勢いや方向性が数字でわかるDMI
- 054 「行動ファイナンス」入門コラム③





第5章 MACDを利用した 中期的な売買モデル

- 088 まずは有効性を事前に確かめておこう！
- 090 検証シート全体を俯瞰してみよう
- 092 10日間のEMAを求め
- 094 70日間のEMAを求め
- 096 シグナルラインを求め
- 098 MACDを求め
- 099 MACDとシグナルラインの交差の状況を表示する
- 100 売買シグナルを表示する
- 101 保有ポジションの状況を表示する
- 102 エントリーコスト(持ち値)を表示する
- 104 ロスカットの水準を表示する
- 105 ロスカット条件を満たすかどうかを表示する
- 106 最終取引日の前日かどうかを表示する
- 107 最終売買日の到来に伴う決済の有無を表示する
- 108 当日に途転した場合の損益を求め
- 110 ロスカット条件を満たした際の損益を求め
- 111 最終売買日の到来に伴う決済の損益を求め
- 112 累積損益を求め
- 113 累積損益のピーク値を求め
- 114 ドローダウン値を求め
- 115 期間損益を求め
- 116 総トレード数を求め
- 117 勝率を求め
- 118 PFを求め
- 119 平均損益と最大ドローダウンを求め
- 120 「行動ファイナンス」入門コラム⑤

第4章 移動平均線を利用した 中期的な売買モデル

- 056 最もポピュラーな指標は本当に有効か？
- 058 移動平均線の日数の組み合わせを変更
- 060 まずは検証シート全体を俯瞰してみよう
- 062 短期の移動平均線を求め
- 063 長期の移動平均線を求め
- 064 ゴールデンクロス等を表示する
- 065 売買シグナルを表示する
- 066 エントリーコスト(持ち値)を表示する
- 068 保有ポジションの状況を表示する
- 069 ロスカットの水準を表示する
- 070 ロスカット条件を満たすかどうかを表示する
- 071 最終取引日の前日かどうかを表示する
- 072 最終売買日の到来に伴う決済の有無を表示する
- 073 ロスカット条件を満たした際の損益を表示する
- 074 当日に途転した場合の損益を求め
- 076 最終売買日の到来に伴う決済の損益を求め
- 077 累積損益を求め
- 078 累積損益のピーク値を求め
- 079 ドローダウン値を求め
- 080 期間損益を求め
- 081 総トレード数を求め
- 082 勝ちトレード数を求め
- 083 勝率を求め
- 084 PFを求め
- 085 平均損益と最大ドローダウンを求め
- 086 「行動ファイナンス」入門コラム④

第6章 IRブレイクを利用した短期的な売買モデル

第7章

「自動売買」 カンタン詳細マニュアル リアルタイム株価が取れる カッキ的ツール大研究!

- 146 「自動売買」がコレでOK!
- 148 「銘柄情報」がサクサク取れる!
- 149 「板情報」が瞬時に取れる!
- 150 「ローソク足情報」だって詳細に!
- 151 注文や保有の状態もバッチリわかる!
- 152 岡三RSSで売買モデルを作成
- 154 「シグナル発生」から「発注」までを追跡
- 156 「約定」から「ポジション確認」までを追跡
- 158 岡三RSSを手に入れるには?
- 160 本書で紹介した3つの売買モデルのダウンロード先



- 122 まずは有効性を事前に確かめておこう!
- 124 イニシャルレンジの上限を求める
- 125 イニシャルレンジの下限を求める
- 126 シグナル発生時の制限や許可を数式化する
- 128 買いシグナルを表示する
- 129 売りシグナルを表示する
- 130 エントリーコスト(持ち値)を表示する
- 132 保有ポジションの状況を表示する
- 133 ロスカットの水準を表示する
- 134 ロスカット条件を満たすかどうかを表示する
- 135 売買損益を求める
- 136 累積損益を求める
- 137 累積損益のピーク値を求める
- 138 ドローダウン値を求める
- 139 期間損益を求める
- 140 総トレード数を求める
- 141 勝率を求める
- 142 PFを求める
- 143 平均損益と最大ドローダウンを求める
- 144 「行動ファイナンス」入門コラム⑥

第

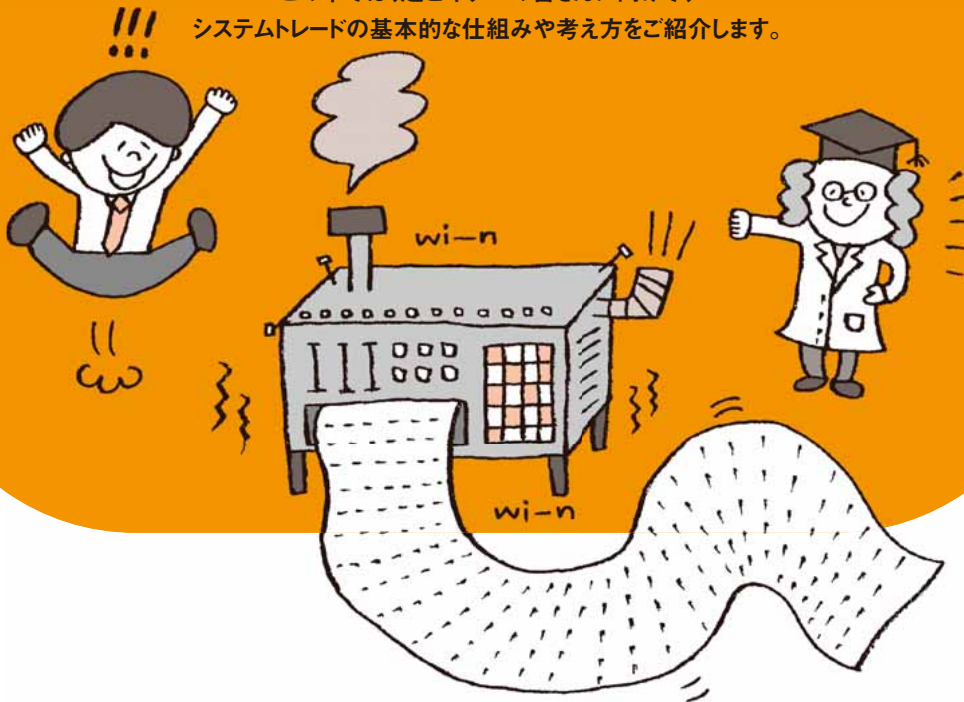
1

章

株でも先物でもFXでも システムトレードなら 勝ちやすい!

誰でも持っている「心理的なクセ」を徹底的に排除することで
儲けられる確率を高める投資法が「システムトレード」です。

この章では、超ビギナーの皆さんに向けて、
システムトレードの基本的な仕組みや考え方をご紹介します。



株でも先物でもFXでもシステムトレードなら勝ちやすい！

アナタが株や先物で負けるホントの理由は？

「なぜ自分は負けやすいのか？」を分析してみよう！

●ついついこんなコトやってませんか？

利益がちょっとでも出ると早く確定させたくなる

損が出ている銘柄をずっと抱えこんでいる

損切った後、その株が上昇することがよくある

結局、高値で買ってしまっている

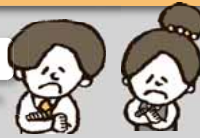
短期で売買するつもりが長期保有になっている

株を買ったあとでその会社の業績などを調べる

株価やネットの掲示板に一喜一憂しがち

チャートで買ったのに今は業績を理由に保有している

うーん確かに……



**経験や知識の不足も問題だが
いちばん大切なのは「心」**

「株や先物やFXに投資しているけど、どうも儲からないなあ」とお悩みの皆さん、皆さんはこんな経験をされたことがありますか？ あれいはいこんな行動をしがちではありませんか？

- ①利益確定を早めにやりすぎる
- ②損を確定するのが嫌で塩漬けにしている銘柄がある
- ③情報は熱心に集めているが、ふと気づくと手元に残っているのは自分にとつて都合のよい情報ばかりだ
- ④「3日間連続で高騰したので、そろそろ一服しそうだ」とか、「4日間連続したので、そろそろ下げ止まりそうだ」と考えてしまう

パソコンの高性能化やブロードバンド回線の普及により、一般の個人でも自宅からネットを通じて株式市場はもちろん、外国為替市場など様々な金融市場に直接アクセスできるようになりました。また、ネット

から様々な投資情報をリアルタイムに収集できるようになりました。しかし、その一方で経験の浅い個人投資家が思わぬ痛手を負うケースも多く、金融市場が身近になったことが投資収益の増加につながっていないのが実情です。小さなミスが大きな損失や利益機会喪失につながり、増えるはずの資金が逆に減ってしまい、マーケットからの退場を余儀なくされることも少なくありません。この小さなミスは、経験や知識の量に起因するというよりは、実は人間が生まれながらに持つ心理的なクセに起因するケースが多くあります。冒頭に挙げたような言動は、そうした心理的なクセが表面化した代表的な例です。

「心理的なクセ」が アナタの取引をダメにする

①②で表れたクセは「プラスの結果が得られそうな場合、人間は確実な結果を好みリスクを避けよう」とし、マイナスの結果になりそうな場合は

●典型的な負け組投資家とは…

損するのだけは
絶対にイヤ!

そろそろ上がるだろう!
根拠はないけど…

気分が悪くなる
ニュースは見えないよ!

塩漬け株
どーしよう…



**「心理的なクセ」を自覚しないで
投資する人は、やっぱり負けやすい!**



でも「心理的なクセ」って誰でも持っているハズ。
それを排除することなんてできないよ!

そこでシステムトレードの出番です!

確実な結果を嫌いリスクを取ろうとしがちになる」こと。このため、「少額でも早く利益を確定して満足を得たい」という感情と「損を確定する苦痛はできるだけ先送りしたい」という感情が相まって、早すぎる利食い・遅すぎる損切りという行動を取ってしまう、トータルで損益がマイナスとなってしまうケースが非常に多くなります。

③で表れたクセは「自分にとって都合の悪い情報は見ない」ということ。ひいきにしているプロ野球チームが負けた翌日のスポーツ新聞は誰だつて読みたくないですよ(まあ、中には負けた試合の記事ほど読みあさる自虐的な人もいるみたいですが)。値段が上がると判断して株を買った。その判断には今でも自信はある。でも株価は下落している。そんな時に、業績が悪化しそうといった新聞記事を冷静に受け止めて、サッサと損切りするなど素早く行動できますか? 見出しだけ見て悪いニュースだとわかったら、本文は読まないのですませてしまうことは今までしたことがないと言ひ切れますか?

④は「典型的な例や目立つものを、そうでないものより起こりやすいと錯覚すること。コイントスで「表・表・裏・表・裏・表・裏」という結

果が出るのと、連続7回表が出るのとでは、確率は同じです(どちらも $1/2$ の7乗)。しかし、前者がより典型的な例、言い換えればより普通っぽく見える例であるため、後者より前者のほうが発生しやすいと錯覚しがちです。株取引でもこれと同じ錯覚をしがちです。「4日間も上げ続けたからさすがに今日は下げるだろう」とか、「こんなに値を下げたことは過去なかった。今こそ買いだ!」などなど。何の根拠もなしにただ単に典型的な例かそうでないかを基準に判断してしまった結果、思わぬ大けがを負うことも少なくありません。

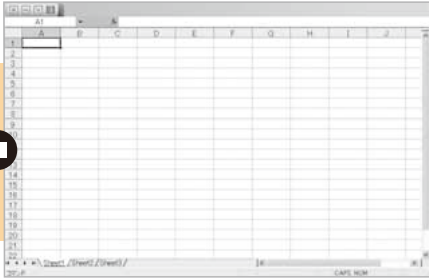
「心理的なクセ」を排除して取引できればいいのだが……

「心理的なクセ」があることを自覚して、それによって判断が曇らされていないかどうかをキチンと点検しながら取引する。それが株やFXで勝つ秘訣です……でも、「それができれば苦労しないよ!」なんて声が聞こえてきそうです。そうです、それは感情を持つ人間にはスゴク難しいことなのです。そこで今回ご紹介したいのが「システムトレード」という取引方法です。次のページから順を追ってご説明します。

「自動売買」がコレでOK!

RSSって何?

エクセル等の表計算ソフトに今の株価などの情報をパッと表示させるツール!



おー!



RSSで何ができるの?

関数や計算式を組み込むことで、**自分だけの売買モデル**ができる!



右から
左へ見てね!

**リアルタイムの株価が
ラクラク取れる!**

「システムトレードの設計図」が
このツールで簡単に作れる!

第1章から6章まで、システムトレードについて説明してきたわけだが、仕組みや作り方の手順はだいたいおわかりいただけたかな? でも、実はまだ本書で説明していない点があることにお気づきだろうか? そう、価格データの取得方法だ。売買モデルを検証するための価格データをどうやって取得するのか。これ、けっこうやっかいな問題なのだ。「ヤフー・ファイナンス」など株のポータルサイトの中には、銘柄ごとに始値・安値・高値・終値の4本値データを取得できるものがあるが、それも日足に限られるし、ウェブ上からエクセルシートにいちいちコピーしなければいけない面倒くささもある。だいたい日経平均のデータは

取得できても、日経平均先物のデータは取れなかったりする。これではせっかくの売買モデルもうまく機能できない恐れがある。

そこでお役に立つのが、こんど岡三オンライン証券が導入した新しい投資ツール「岡三RSS」(運用スタートは09年4月17日夜間より)。RSSは「リアルタイム・スプレッド・シート」の略で、日経平均の先物やオプション、個別株といった投資対象の価格などの情報を、取得しエクセル上に表示させることができるといふ、スグレモノのツールなのだ。しかも、ここが肝心なのだが、取得できる価格情報はリアルタイムつまり、今この瞬間のイキのいいデータが取れるのだ!

これがRSSだ!

N225mini		200906		N225ミニ09/06	
現在値	7,760	前日比(%)	260 (3.47%)	強度	79.95%
出来高	8,984	売気配	25.05%	買気配	74.95%
出来高		売気配		価格	
		成行		買気配	
		200	7,795		
		175	7,790		
		298	7,785		
		436	7,780		
		321	7,775		
		466	7,770		
		544	7,765		
	6	530	7,760		
	312		7,755	371	
	495		7,750	381	
	997		7,745	217	
	1,867		7,740	280	
	755		7,735	326	
	193		7,730	255	
	228		7,725	232	
	1,237		7,720	337	

N225		200906		N225ミニ09/06	
現在値	7,760	前日比	260 (3.47%)	出来高	8,984
売買代金	6,943,659	残存建玉		理論価格	N/A
前日終値	7,500	HV		ペーシス	55.8500
前場後場		夕場		日通し	
始値	7,570	09:00	7,715	16:30	7,570
高値	7,700	10:59	7,760	16:40	7,760
安値	7,570	09:00	7,700	16:31	7,570
終値	7,680	15:10	7,760	16:40	7,760
値幅		上場来高値		SG情報	日経平均年初来高値
	6,010		9,290	2009/06/12	15156.66
	9,010	2009/01/07		88	2008/01/04
最良気配		上場来安値		日経平均	日経平均年初来安値

見た目にはフッターの表計算シートでも、中身がスゴいんです!

以前から、証券会社のトレーディングルームでは、リアルタイムの株価を取得し、エクセル上に表示させてトレーディングやポートフォリオ管理などに役立ててきた。RSSは、そうしたプロ仕様のツールなわけだが、それを個人投資家にも使ってもらおうというのが、岡三オンライン証券の試みだ。

このページの上に掲載したのがRSSの画面。黒地に白文字で精悍なイメージだ。「でも、よく見るとコ

岡三RSSを使うためには岡三デスクトップが必要



※岡三デスクトップの説明は156ページで

レってエクセルのシートだよな？」おっしゃるとおり、RSSはエクセルのアドインツール（アプリケーションに組み込んで、機能を追加するためのツール）なのだ。だから、エクセルを知ってさえいれば使える。少なくとも、エクセルのセルに数字や文字を打ち込める人ならまず使える。エクセルに多少詳しい人なら関数という、計算や表示を簡単に行うための計算式をご存じだと思うが、日経平均先物に係わる各種データは、そうした専門的な関数を知らなくても簡単に取得することができる。

もちろん、知らないより知っていたほうが有利なのは確かで、いくつかの簡単な関数と取得したデータとを組み合わせることで、自分なりの計算や加工も行えるし、発注や約定の情報も取得することができる。次ページからはその関数のいくつかをご紹介します。

本書で紹介した 3つの売買モデルのダウンロード先

移動平均線を利用したモデル

第4章

IRブレイクを利用したモデル

第6章

MACDを利用したモデル

第5章

岡三ネットトレーダー
特設サイト

<http://www.okasan-online.co.jp/ont/>

で手に入ります。

まずは上記サイトへアクセスしてみてください!