

News Release

各 位

岡三オンライン証券株式会社
代表者:取締役社長 池田 嘉宏
所在地:東京都 中央区

FX 自動売買ツール「アルゴトレード365」月間利益ランキング公開 (2013年6月) ～ランキング 1 位は月間で約 18 万円の利益！トレンドを捕らえた売買システムが活躍～

岡三オンラインFX(くりっく 365)専用FX自動売買ツール「アルゴトレード365」サポートコンテンツ「月間アルゴ情報局」より、搭載されている売買システムの月間利益ランキング(2013年6月)をお知らせいたします。

■ アルゴトレード365 月間利益ランキング (2013年6月)

RANK	売買システム名	期間損益	期間損益 (1万通貨あたり)
 1	ムーヴマン USD/JPY 日足	1,807.5pips	180,750 円
 2	ムーヴマン GBP/AUD 日足	1,646 pips	149,275 円
 3	トレンドイーター GBP/AUD 日足	1,492 pips	135,309 円
4 位	ムーヴマン EUR/AUD 日足	1,473 pips	133,586 円
5 位	波動キャプチャー AUD/JPY 日足	1,083.5 pips	108,350 円

■ 月間利益ランキング概況

2013年6月のアルゴトレード365は、「日足」売買システムが活躍し、ランキングを独占する結果となりました。その中で月間利益ランキング No.1 に輝いたのは、「ムーヴマン USD/JPY 日足」。

2012年10月下旬に保有した買いポジションを決済したことで大きな利益を獲得、月間利益ランキングの No.1 に輝きました。

「ムーヴマン」は、期間内の値動き(ボラティリティ)をベースにトレンドの発生を判断し、トレンドが発生していると判断した場合は、「順張り」で取引を行っていく売買モデルです。

No.1 に輝いた売買システム「ムーヴマン USD/JPY 日足」は、上昇基調に入り始めた2012年10月下旬に買いエントリーを行い、以降「アベノミクス相場」による大きな上昇トレンドを利益にしました。

上昇期間が長かったこともあり、途中で何度か発生した一時的な下落局面では決済シグナルの条件は揃わず、6月上旬の大きな下落局面で利益確定をしました。

取引内容などの詳細につきましては、当社 Web サイトをご参照ください。
http://www.okasan-online.co.jp/fx_tools/algotrade365/info.html

■ 2013年6月の相場概況 (岡三オンライン証券 投資戦略部 部長 武部力也)

「6月のアルゴトレード365は、ドテンありの順張り型売買システム、「ムーヴマン USD/JPY 日足」が堂々の1位となりました。「V字回復」したドル円に対しての冷静な切り替えしが好成績に結びついたものと見ています。

6月上旬のドル円は5月下旬の株安・円高による混乱の持続、安倍首相の成長戦略第3弾への失望がドル安・円高を促し、6/3 から 6/13 の期間で約7円幅の下落を見せました。そうした動きは麻生財務相から“わざわざ”為替介入の可能性を否定させる程でもありました。

その後、年金積立管理運用独立行政法人 GPIF の弾力的な運用変更や米価格付け見通しの引き上げ等があったものの、日銀金融政策会合への失望が円高圧力を持続させています。

しかし6/19のFOMC会合でバーナンキFRB議長が長年続いた金融緩和政策の転換姿勢を見せるとドルは主要通貨に対して急騰。ドル円も日米金融政策の差異「金融緩和・出口論/入口論」とした舵取りの違いが追い風となり、さらには下旬に四半期末のドル転円投需給も手伝って連続週足陽線を見せています。

■ オスピス推奨ポートフォリオ (2013年6月)

システムトレードのプロであり、アルゴトレード365の開発業者である(株)オスピスが推奨するポートフォリオです。今後一ヶ月間で成績が期待できる売買システムの組み合わせを毎月公開しています。

組み合わせる売買システム	取引枚数
CT ヴァル CAD/JPY 60分足	1枚
波動キャプチャー EUR/AUD 60分足	1枚
TF ヴァル USD/JPY 60分足	1枚

合成トラックレコード

期間損益	6115 pips
勝率	55.08%
PF (損益率)	1.78
最大 ドローダウン	-515 pips (円換算：約-51,450円)
RRR	11.89

合計損益曲線



直近12カ月のトラックレコードから売買システムの組み合わせを検証した結果、CT ヴァル CAD/JPY 60分足、波動キャプチャー EUR/AUD 60分足、TF ヴァル USD/JPY 60分足の組み合わせが最も収益が期待できる組み合わせでした。

通貨は CAD、JPY、EUR、AUD、USD に分散されています。また、戦略は順張りタイプの波動キャプチャー、TF ヴァル、逆張りタイプの CT ヴァルに分散されています。

このポートフォリオの特徴は、通貨ペアや戦略を分散するだけでなく、狙いに行く価格変動の時間枠まで上手く分散している点でしょう。

CT ヴァルとTF ヴァルは、取引頻度は高め(1週間あたり約2回)で、短い時間枠の値動きを捕えることを目指しています。さらにこれに加え、トレンドが出たらどこまでも利益を伸ばす波動キャプチャーを組み合わせています。これにより様々な相場に対して順応性が高いポートフォリオになっています。

【アルゴトレード365とは】

「アルゴトレード365」は、株式会社オスピスが東京金融取引所の「くりっく365」専用に関開発した選択型のFX自動売買ツールです。厳選された合計 1,152 通りの売買システム(平成 25 年 7 月 9 日現在)から、お好みの売買システムを選ぶだけの簡単操作で、誰でもシステムトレードを始めることが可能です。

過去の損益パフォーマンスや勝率などの各種ランキングや、お好みの売買システムを見つけ出す検索・比較機能、何百万通りの複数売買モデルの組み合わせの中から、統計的に優位性の高い組み合わせをセレクトする「ポートフォリオ機能」などを搭載しており、システムトレードに精通している投資家はもちろん、「システムトレード初心者」の方も安心してご利用いただけます。

【システムトレードとは】

株式や外国為替などの金融市場の取引において、あらかじめ決めた一定の売買ルールに従い、機械的、継続的に取引する投資の手法を指します。

各売買システムに表示されている「期間損益」「勝率」等の数値は、過去の結果に基づいて算出したものであり、将来の結果を保証するものではありません。また、売買システムリリース以前の数値は、過去のくりっく365の為替レートを使用して売買システムを稼働させた場合のシミュレーション結果です。

岡三オンライン証券は、今後とも価値あるサービスの提供に努めてまいります。

以上

■ 岡三オンラインFX（取引所外国為替証拠金取引）に関する留意事項

<リスク> 取引所外国為替証拠金取引は預託した証拠金の額を超える取引ができるため、対象通貨の為替相場の変動により損益が大きく変動し、投資元本（証拠金）を上回る損失を被る場合があります。外貨間取引は、決済対象通貨の対円相場の変動により決済時の損益額が増減する可能性があります。対象通貨の金利変動等によりスワップポイントの受取額が増減する可能性があります。対象通貨の金利水準が逆転した場合、スワップポイントの受取から支払に転じる可能性があります。為替相場の急変時等に取引を行うことができず、不測の損害が発生する可能性があります。システム、通信回線等の障害により発注、執行等ができず機会利益が失われる可能性があります。

<証拠金> 個人のお客様の発注証拠金（必要証拠金）は、取引所が定める証拠金基準額に選択レバレッジコースに応じた所要額を加えた額とします。法人のお客様の発注証拠金（必要証拠金）は、取引所が定める証拠金基準額とします。発注証拠金に対して、1取引単位（1万又は10万通貨）の取引が可能です。発注証拠金・取引単位は通貨ごとに異なります。Webサイトで最新のものをご確認ください。

<手数料等（表示は税込）> 通常コースの取引手数料は1取引単位あたり100円（取引枚数により段階的減額あり）です。1倍コースでは1取引単位あたり1,050円です。スプレッドは、通貨ごとに異なり、為替相場によって変動します。Webサイトで最新のものをご確認ください。

お取引の最終決定は、契約締結前交付書面、目論見書等およびWebサイト上の説明事項等をよくお読みいただき、ご自身の判断と責任で行ってください。

商号等: 岡三オンライン証券株式会社 金融商品取引業者/関東財務局長(金商)第52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