

2013年1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 (2012 年 12 月)

人気ストラテジーTOP10のうちプラスは2割、2012年で最も苦戦した1ヶ月
— “豪ドル”絡みのストラテジーが上位を占める結果に —

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(2012年12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。)

【レポートサマリー】

- ・お客様に選ばれたストラテジーTOP10のうちプラスは僅か2割。2012年で最も苦戦した1ヶ月。
- ・豪ドルを対象にしたストラテジーがTOP10の7割を占める結果に。
- ・相場状況に応じて、ポジションサイズの調整やポートフォリオのメンテナンスを行いましょ。

■12月 人気ストラテジーランキング TOP10 (期間 2012年12月1日~12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	59.1%	-283.1	-28,310 円
2	4	ThirdBrainFx Jr	AUD/JPY	23.5%	-573.2	-57,320 円
3	3	Pinvestcapital	EUR/GBP	21.8%	+246.6	+34,761 円
4	2	Taiyo	AUD/JPY	19.9%	-607.2	-60,720 円
5	5	Sphynx	GBP/AUD	16.2%	-508.4	-45,825 円
6	6	Maloma	USD/CHF	12.3%	-220.5	-20,897 円
7	10	ThirdBrainFx	EUR/AUD	11.7%	-972.3	-87,638 円
8	7	Sultan11	EUR/USD	9.4%	-528.9	-45,877 円
9	9	Sphynx	EUR/AUD	8.3%	+159.3	+14,359 円
10	圏外	007Fx	EUR/AUD	8.1%	-212.3	-19,136 円

※損益 pips は取引画面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、12月31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。

2012年12月の人気ランキングは、TOP10のうちプラスは僅か2割、TOP10戦略の期間損益の合計は大きくマイナスとなり、2012年の人気ランキングTOP10で最も成績の悪い1ヶ月となりました。

圏外からのランクインは10位の007Fx EUR/AUD(11月人気ランキングは15位)のみと新たな戦略の活躍はTOP10においてほぼ見られず、人気戦略の低調さが目立つ結果となっています。復調の兆しが見える戦略があるものの、相場状況に応じたポートフォリオのメンテナンスができるよう引き続き戦略の動きを定期的にチェックしておきましょう。

※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戦略は、シストレ24に存在するごく一部の戦略です。

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、全ての戦略で利益が出ているわけではありません。

他の戦略の詳細や損益、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。

■戦略レポート | インヴァスト証券投資情報室 山口哲也

2012年12月の外国為替相場は、12月16日におこなわれた衆議院選挙で自民党が圧勝、安倍新内閣の発足、日銀のインフレ目標導入期待から引き続き円が売られる展開となりました。

米ドル/円は米国の財政の崖という課題が残る中、12月4日に81.72を付けた後、大晦日には86円70銭台まで上昇、ユーロ/円も12月末には1年5カ月振りとなる114.705まで上昇いたしました。

こういった相場状況の中、人気ランキング上位の売買結果は11月の好結果とは一転、10月以上に苦戦した結果となっております。特にトレンドフォロー型の代表格であるThirdBrainFx(AUD/JPY)をはじめ、ThirdBrainFx(EUR/AUD)やThirdBrainFx Jr(AUD/JPY)、コソコソ型のTaiyo(AUD/JPY)などの決済損失が目立っています。

ただ、ランキングで1位にランクインしたThirdBrainFx(AUD/JPY)のように先月半ば以降の建玉においては、決済損失を上回る評価益となっているものもあり、復調の兆しも感じられます。

ThirdBrainFxシリーズは、以前、ThirdBrainSA社へのインタビュー等でお伝えした通り、基本的には日足のMACDでトレンドを探り1時間足のストキャスティクス(ウィリアムズ%R)で売買タイミングを計る戦略となるため、日足チャートのトレンドに変化が確認できる場合やトレンドレスが確認できる場合には注意が必要です。

ランキングで7位のThirdBrainFx(EUR/AUD)は、ユーロ/豪ドル相場が1.2820から1.2160のレンジをブレイクするなどの、トレンドが確認できるようなタイミングを見極めて運用を開始したいところです。

また、2位のThirdBrainFx Jr(AUD/JPY)は、ThirdBrainFx(AUD/JPY)の改良版で、ThirdBrainFx(AUD/JPY)よりも利食いと損切りの値幅が小さく取引回数が多いという特徴がありますが、基本的なトレンドの把握は、ThirdBrainFx(AUD/JPY)と同様、日足でおこなう戦略のため、これらの特徴が逆にトレンドに乗りきれない原因となり、月間での期間損益がマイナスとなりました。

5位と9位にはSphynxがランクインしておりますが、これらもThirdBrainSA社が開発したCCI(コモディティ・チャンネル・インデックス=商品チャンネル指数)※というテクニカル指標を利用した戦略で、トレンドフォロー型の売買スタイルとなっております。

※CCIの基本的な利用方法としては、ある一定水準、例えば+100%を超える場合を買い、-100を下回る場合を売り、と判断するトレンドフォロー型の利用方法と、+100%を下回る場合を売り、-100を上回る場合を判断するカウンタートレンド型の利用方法があります。

期間損益は 5 位の Sphynx(GBP/AUD)はマイナス、9 位の Sphynx(EUR/AUD)はプラスと対照的で、チャート上きれいなトレンドを形成している 9 位の EUR/AUD に比べ、5 位の GBP/AUD はトレンドが急変するように推移したことが、原因だと考えられます。

全体的には、「AUD/JPY」、「EUR/AUD」を対象にしたストラテジーがそれぞれ 3 つランクインしており、豪ドルがらみのストラテジーの人気の高い結果となりました。

昨年末の豪ドルは、高格付け通貨という理由からリスク回避先として買われた経緯があり、夏場から 12 月にかけてのユーロ/豪ドル、ポンド/豪ドルの上昇は(ユーロやポンドの)買い戻しの動きにすぎないと考えられます。

そのため、一時的に落ち着いているユーロ圏債務問題や米財政の崖問題が再燃した場合には、リスク回避先として加速度的に買われやすい(12 月末頃からの豪ドル買いトレンドが継続する)と考えられ、逆に欧米動向が安定的であれば、再度、豪ドルが売られる展開も予想できるため、1 月以降の豪ドルは特に欧米の政治経済動向に注目しておく必要があると考えられます。

(2013/1/7)

■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」。バケッ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 500 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

設立 : 昭和 35(1960)年 8 月 10 日
上場市場名 : 大証 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のため、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1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の設定したシグナルにしたがって自動売買を行うことができる取引システムです。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。・ストラテジーの過去の運用実績は、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、過去の運用実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こと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)やその修理費用等に関して、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、ストラテジー提供者より当社が提供を受け、お客様に提供している商品であるため、ストラテジー提供者および当社が本サービスの提供を休止または廃止した場合には、ご利用が継続できなくなります。この場合、本サービスをご利用いただけなくなりますのでご注意ください。また、ストラテジー提供者または当社の判断により、利用されていない個々のストラテジーが削除されることがあります。