

2012年6月7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5月)

選ばれたストラテジーTOP10のうち5割がプラスに！
選択比率 No.1 は、ThirdBrainFx (AUD/JPY)！No.2 から浮上し首位に。

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5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】

- ・人気ストラテジーTop10のうち、5割の損益が期間中プラスに。
- ・お客様に選ばれたストラテジーNo.1 は、ThirdBrainFx (AUD/JPY)。No.2 から浮上し首位に！
- ・通貨分散の動きも。通貨ペアの異なる4種類のストラテジーが新たにランクイン！

■5月 人気ストラテジーランキング TOP10 (期間 2012年5月1日～5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 | 2 | ThirdBrainFx | AUD/JPY | 47.0% | +2,237.5 | +223,750 円 |
| 2 | 1 | LaTesla Imparion | USD/CHF | 39.4% | -104.4 | -8,417 円 |
| 3 | 3 | Maloma | USD/CHF | 35.7% | +692.9 | +55,862 円 |
| 4 | 4 | LJH111 | AUD/USD | 33.3% | -135.3 | -10,597 円 |
| 5 | 5 | LJH111 | USD/CHF | 23.2% | -697.2 | -56,208 円 |
| 6 | 圏外 | Pip Daddy | USD/JPY | 17.0% | +767.7 | +76,770 円 |
| 7 | 7 | Uptick | EUR/USD | 13.5% | -830.6 | -65,053 円 |
| 8 | 圏外 | Maloma | EUR/USD | 10.4% | +1,408.0 | +110,275 円 |
| 9 | 圏外 | LJH111 | NZD/USD | 10.3% | -111.3 | -8,717 円 |
| 10 | 圏外 | AdaptiveSystem | GBP/USD | 8.1% | +213.1 | +16,690 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、実際に取引した人数となります。

※損益円換算は、5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。

5月の人気ストラテジーランキングは、3月、4月とランキング2位をキープしてきた ThirdBrainFx (AUD/JPY) が初の No.1 を獲得しました。初めて TOP10 入りを果たした 2月(10位)から4ヶ月連続で TOP10 圏内を維持しているため、お客様の選択比率は2月(9.0%)の約5倍となる47.0%までに増加しています。

新たなストラテジーを組み入れる動きも見られており、今月は、4種類のストラテジーが初のランクインを果たしました。新たにランクインしたストラテジーは、先月の最大 PIPS ランキング No.1 となった Pip Daddy (USD/JPY) を筆頭に、通貨ペア USD/CHF が常に上位にランクインしている Maloma (EUR/USD)、先月のランキングで3通貨ペアがランクインを果たし注目を集めた LJH111 (NZD/USD)、さらに AdaptiveSystem (GBP/USD) と通貨ペアの異なる4種類のストラテジーがランクインしました。通貨を分散し、リスクを軽減させる動きともいえます。

■ストラテジータイプ別 損益ランキング [過去30日間] (期間 2012年6月1日時点)

人気ストラテジーランキングでも新たなストラテジーを組み入れる動きが見られていたように、シストレ24は複数のストラテジーでポートフォリオを作成することでリスクを分散し、中長期的な視野で利益を得ることを目標とする“ミドルリスク・ミドルリターン”の投資手法をお勧めしています。実際にシストレ24でお取引しているお客様一人当たりのストラテジー選択数は、平均3種類以上となりますので、異なる3つのタイプのストラテジーランキングをご紹介します。

【コツコツ型 ストラテジー】 (取引回数30回以上から抽出)

取引回数が多く、短い期間(平均保有期間、2日以内)で小さな利益を積み上げるストラテジーです。

| RANK | ストラテジー名 | 通貨ペア | 期間損益 pips | 1万通貨円換算 | 勝率 | 取引回数 |
|------|------------|---------|-----------------|-----------|--------|------|
| 1 | Glimspy | EUR/JPY | +1,678.7 | +167,870円 | 82.4% | 34 |
| 2 | vp-novafx | CHF/JPY | +1,662.9 | +166,290円 | 76.5% | 34 |
| 3 | Maloma | EUR/USD | +1,408.0 | +110,275円 | 100.0% | 31 |
| 4 | Zeno | GBP/JPY | +1,388.0 | +138,800円 | 92.7% | 41 |
| 5 | Dynamic FX | NZD/USD | +1,299.0 | +101,738円 | 74.8% | 123 |

【バランス型 ストラテジー】 (取引回数15回から30回で抽出)

コツコツ型より、やや長い期間(平均保有期間、5日程度)で取引を行っています。

| RANK | ストラテジー名 | 通貨ペア | 期間損益 pips | 1万通貨円換算 | 勝率 | 取引回数 |
|------|----------------|---------|----------------|-----------|--------|------|
| 1 | Sphynx | EUR/JPY | +2374.6 | +237,460円 | 100.0% | 15 |
| 2 | Sphynx | CHF/JPY | +2284.8 | +228,480円 | 100.0% | 15 |
| 3 | Sphynx | EUR/USD | +2279.6 | +178,538円 | 100.0% | 15 |
| 4 | BreakoutMaster | EUR/JPY | +1173.6 | +117,360円 | 54.6% | 22 |
| 5 | MHFX01 | EUR/AUD | +655.7 | +49,977円 | 71.4% | 21 |

【ホームラン型 ストラテジー】（取引回数 15 回未満から抽出）

相場動向とそのストラテジーの戦略がマッチすると一回の取引で大きな利益を上げる傾向があります。しかし、損失が発生する場合、大きな損を生じる可能性が高いため注意が必要です。

| RANK | ストラテジー名 | 通貨ペア | 期間損益 pips | 1万通貨円換算 | 勝率 | 取引回数 |
|------|--------------|---------|-----------------|------------|--------|------|
| 1 | ThirdBrainFx | EUR/JPY | +3,085.5 | +308,550 円 | 100.0% | 11 |
| 2 | ThirdBrainFx | AUD/USD | +3,066.7 | +240,184 円 | 100.0% | 11 |
| 3 | ThirdBrainFx | CHF/JPY | +2,810.9 | +281,090 円 | 100.0% | 10 |
| 4 | ThirdBrainFx | AUD/JPY | +2,237.5 | +223,750 円 | 100.0% | 8 |
| 5 | ThirdBrainFx | CAD/JPY | +2,227.9 | +222,790 円 | 100.0% | 8 |

バランスの良いポートフォリオを作成するためには、ストラテジーの通貨分散や異なるタイプのストラテジー選択(ストラテジータイプ分散)をすることが重要です。相関性の高いストラテジー同士を選択することはハイリスクとなりますのでご注意ください。また、ストラテジータイプに限らず、ストラテジーの調子は相場により日々変化しますので、ストラテジーチェックを欠かさず行うことも重要な運用ポイントです。

■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

5月は多くのクロス円通貨がユーロ圏債務問題により下降トレンドでの推移となり、特に、当該通貨であるユーロよりも豪ドルやNZドル、南アランド等の下落率が大きめとなりました。

5月の人気ストラテジーで1位に輝いた「ThirdBrainFX(AUD/JPY)」は、長めの足でトレンドを判断し、短めの足ではオシレータを利用して売買判断をおこなっているように見受けられます。

- ・取引ツール上のストラテジーカードの内容と売買履歴から判断すると、ThirdBrainFX(AUD/JPY)は、日足などを用いてMACDでトレンドを判断し、上昇トレンドの場合は、1時間足のストキャスティクスが売られすぎの時に買い建玉し買われすぎの時に転売、逆に、下降トレンドの場合は、1時間足のストキャスティクスが買われすぎの時に売り建玉し、売られすぎの時に買い戻すストラテジーのように見受けられます。

したがって、「ThirdBrainFX(AUD/JPY)」を運用されていらっしゃる方は、豪ドル円がレンジ相場となる場合には注意が必要です。(2012/6/4)

【搭載ストラテジーに関する情報は、当社ホームページ「シストレ24攻略」からご覧いただけます】

シストレ24攻略 (URL <http://www.invast.jp/st24mr/advantage/>)

- ・ストラテジー収益率ランキングをはじめとした「シストレ24」に関する最新情報を掲載しています。
 - ・ストラテジーの探し方やポートフォリオの組み方など、より具体的な運用ポイントをご覧になれます。
- 自分なりのストラテジー検索方法を見つけ出し、定期的にポートフォリオを見直しましょう。

【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

■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「Mirror Trader」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。

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： 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の提供を目的にしたもので、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。●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、その内容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 24 年 6 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。