

2012年8月3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7月)

初快挙達成！人気ストラテジーTOP10 が好成績を収める結果に！

— レンジ相場で実力発揮！コツコツ型ストラテジーが活躍 —

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7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】

- ・初の快挙達成！お客様に選ばれたストラテジーTop10 全ての期間損益が 0 以上という結果に
- ・コツコツ型ストラテジーが実力を発揮！レンジ相場に強いストラテジーが好成績を収めた一ヶ月
- ・過去 2 ヶ月連続 No.1 の「ThirdBrainFx (AUD/JPY)」、取引せずにランクインした理由とは！？

■7月 人気ストラテジーランキング TOP10 (期間 2012年7月1日～7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	圏外	JFX	NZD/USD	22.4%	+605.1	+47,283 円
2	3	JFX	USD/CHF	21.5%	+488.2	+39,071 円
3	2	Maloma	USD/CHF	20.9%	+330.2	+26,426 円
4	1	ThirdBrainFx	AUD/JPY	19.8%	±0.0	±0 円
5	圏外	RikiTikiTavi FX	USD/JPY	18.4%	+317.9	+31,790 円
6	圏外	JFX	AUD/USD	15.6%	+794.6	+62,090 円
7	10	Sphynx	GBP/AUD	15.0%	+1,617.0	+132,675 円
8	圏外	Taiyo	AUD/JPY	13.7%	+171.1	+17,110 円
9	圏外	Pinvestcapital	EUR/GBP	11.9%	+336.5	+41,211 円
10	圏外	Glimspy	CHF/JPY	11.4%	+654.7	+65,470 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、7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。

7月の人気ランキングでは、TOP10にランクインしたストラテジーで期間損益の合計が損失となったものは一つもなく、シストレ24のサービス開始以来初の快挙を達成いたしました。

先月のランキングでは、人気TOP10のうちThirdBrainFx(AUD/JPY)が突出した成績を上げた印象がありましたが、7月はTOP10ストラテジーが全体的に好成績を残しました。

なお、過去2ヶ月に渡り人気No.1であったThirdBrainFx(AUD/JPY)は、ランキング第4位となり、期間損益が±0となっています。これは、7月中にThirdBrainFx(AUD/JPY)がシグナルを配信しておらず、決済をしていないことを意味しています。しかし、先月から持ち越しているポジションが存在していたことから、多くのお客様がポジションを手動決済※し、利益確定した(6月末の建値80.50前後、7月末の豪ドル円の終値82.03と評価益が出ているため)と想定されることから第4位にランクインする結果となりました。
※既に保有しているポジションは、取引画面からご自身で成行決済を行うことができます。

7月は、取引所FX「くりっく365」の建玉比率※を見ると月初から月末まで一貫して対円通貨ペアでは円売りポジションの占める割合が多い(対円通貨の買いポジションを持っている方が多い)状況でしたが、相場が円高に傾いたことから、裁量取引で対円通貨ペアを取引されていた方は身動きが取り難く、苦しい一ヶ月になったのではないかと考えられます。一方、シストレ24では、このような状況下でも人気ランキング上位のストラテジーが好成績を収めたことから、損益がプラスに転じたお客様が多かったのではないかと考えられます。

※インヴァスト証券「くりっく365」主要通貨の建玉数量売買比率より算出

また、7月は、値動きの乏しいレンジ相場が続き、ThirdBrainFxのようなトレンドを捉えて取引をするスイング系ストラテジーの動きが目立たなかった一方、レンジ相場に強いコツコツ型ストラテジーが実力を発揮した月でもありました。コツコツ型の中には、大きな評価損を抱えるストラテジーも存在していますが、最近の傾向として平均損失が低く、最大ドローダウンが比較的小さいものは、リスクが比較的低く中長期運用に向いていると考えられ、人気が高まってきているようです。

■Myシストレ24 収益率ランキング【過去1ヶ月】 (期間 2012年8月1日時点)

7月21日にリリースされた「Myシストレ24」は、Myページからご利用いただけるシストレ24オリジナルの運用支援ツールです。「Myシストレ24」では、様々なランキングを簡単な操作で確認することができます。今回は、「Myシストレ24」より異なる特徴を持つストラテジータイプ別ランキングをご紹介しますが、ご自身が理想とするポートフォリオ作成のために「Myシストレ24」のストラテジー検索機能をご活用ください。

【総合収益率ランキング】 ※取引単位を1万通貨(=10k)としています

RANK	ストラテジー名	通貨ペア	収益率	損益(1万通貨円換算)	推奨証拠金
1	007Fx	EUR/AUD	+66.13%	+214,898円	325,000円
2	FxThunder	EUR/AUD	+55.15%	+107,542円	195,000円
3	SniperFX	NZD/JPY	+44.58%	+23,180円	52,000円
4	FxThunder	NZD/CHF	+43.52%	+48,306円	111,000円
5	WindChaser	CAD/JPY	+42.63%	+27,280円	64,000円

【コツコツ型ストラテジー 収益率ランキング】 ※取引単位を1万通貨(=10k)としています

6ヶ月の収益率ランキングに掲載されている全ストラテジーの取引回数と平均利益の平均に対して①取引回数が120%以上 ②平均利益が100%未満のストラテジーです。

RANK	ストラテジー名	通貨ペア	収益率	損益(1万通貨円換算)	推奨証拠金
1	Wind Chaser	AUD/JPY	+36.69%	+38,520 円	105,000 円
2	London Call2	NZD/JPY	+32.28%	+70,350 円	218,000 円
3	Glimspy	CHF/JPY	+31.18%	+65,470 円	210,000 円
4	Glimspy	EUR/JPY	+26.38%	+80,430 円	305,000 円
5	RikiTiki Tavi FX	USD/JPY	+24.27%	+31,790 円	131,000 円

【一発型ストラテジー 収益率ランキング】 ※取引単位を1万通貨(=10k)としています

6ヶ月の収益率ランキングに掲載されている全ストラテジーの取引回数と平均利益の平均に対して①取引回数が100%未満②平均利益が120%以上のストラテジーです。

RANK	ストラテジー名	通貨ペア	収益率	損益(1万通貨円換算)	推奨証拠金
1	007Fx	EUR/AUD	+66.13%	+214,898 円	325,000 円
2	FxThunder	EUR/AUD	+55.15%	+107,542 円	195,000 円
3	FxThunder	NZD/CHF	+43.52%	+48,306 円	111,000 円
4	ThirdBrainFx	EUR/AUD	+41.25%	+203,751 円	494,000 円
5	Sphynx	EUR/AUD	+40.30%	+157,555 円	391,000 円

※上記ランキングの項目について

・収益率とは

推奨証拠金に対する損益の比率が収益率です。推奨証拠金は、過去12ヶ月の最大ドローダウンを基に算出しているため、最大ドローダウンが大きい場合、推奨証拠金が高めに設定されることになります。つまり、最大ドローダウンの大きいストラテジーは、収益率が低く算出されるため順位は低い傾向になるといえます。

ストラテジーの稼働日数が少ない、または取引回数が非常に少ない場合などは、データの信頼性が低く、今後の収益率が大きく変動する可能性がありますのでご注意ください。

・推奨証拠金とは

必要証拠金に、各ストラテジーの過去12ヶ月の最大ドローダウンの2倍を加えた金額です。

推奨証拠金は、ストラテジーを運用するためにどのくらいの資金があることが望ましいかを示した証拠金額の目安となり、余裕を持って運用していただくために推奨している証拠金額です。

※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ございません。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

7月の月間収益率ランキングで1位に輝いた「007Fx(EUR/AUD)」は、T-Scoreがまだついていないストラテジーでストラテジーカードにも記載されているとおり、ThirdBrainFxのパラメータやストップ値幅などを調整したものとなっています。

したがって、基本的には「ThirdBrainFx(EUR/AUD)」同様、日足のMACDを利用してトレンドを確認し1時間足のストキャスティクスで建玉をするストラテジーとなりますが、「ThirdBrainFx(EUR/AUD)」よりMACDのパラメータは小さめになっているように見受けられ、比較的損切りが早い「平均損失の値幅」は「ThirdBrainFx(EUR/AUD)」より小さめですが、その分勝率は低くなっています。

また7月の月間収益率ランキング2位の「Fxthunder(EUR/AUD)」も利用しているテクニカル指標や売買状況などから、おそらくThirdBrainFxの亜種だと思われます。

実際に過去90日間での「007Fx(EUR/AUD)」「Fxthunder(EUR/AUD)」「ThirdBrainFx(EUR/AUD)」それぞれの収益曲線は似たような動きとなっておりますので、リスク分散効果を期待してポートフォリオを組む場合にこの3つのストラテジーの組み合わせはあまりお勧めできません。

ただ、これら3つはプロフィットファクターや勝率、平均利益や平均損失などの成績から判断して非常によくできているストラテジーであると考えており、特にトレンドが明確な銘柄においては、その威力を発揮するものと思われます。

そのため、これらのストラテジーをポートフォリオに組み込む場合は、売買のタイミングや勝率、最大ポジション数量の違いなど、それぞれの特徴を理解してご利用いただければと思っています。

なお、7月の人気ストラテジーで上位1位から3位までにランクインしているJFXやMalomaは先月のストラテジーレポートで解説いたしましたように、高い勝率で小さな利益を積み上げていくタイプになり、弱点は損切りが遅いことが挙げられます。

そのため、平均利益を大きく超えるような損失が生じる場合には、お客様ご自身で手動決済いただくのも大きなドローダウンを防ぐ方法の1つかも知れません。(2012/8/2)

■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。

【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

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 8 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。