

2013年2月6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 (2013年1月)

人気ストラテジーTOP10のうち6割がプラス!

12月の不調から一転、トレンドフォロー型ストラテジーが活躍した1ヶ月

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(2013年1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6割プラス!
- ・12月の人気ランキングTOP10が大変動、圏外から4つのストラテジーが新たにランクイン。
- ・対円通貨、トレンドフォロー型のストラテジーが好調な結果に!

■ 1月 人気ストラテジーランキング TOP10 (期間 2013年1月1日~1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	64.2%	+2,065.1	+206,510 円
2	3	Pinvestcapital	EUR/GBP	25.3%	+165.2	+24,007 円
3	圏外	ThirdBrainFx	CAD/JPY	16.2%	+1,553.7	+155,370 円
4	2	ThirdBrainFx Jr	AUD/JPY	12.7%	-108.1	-10,810 円
5	圏外	QuickShift	EUR/JPY	11.5%	+8.1	+810 円
6	4	Taiyo	AUD/JPY	10.9%	-436.0	-43,600 円
7	5	Sphynx	GBP/AUD	10.4%	-756.0	-72,236 円
8	圏外	Home Runs	USD/JPY	8.9%	+1,776.5	+177,650 円
9	6	Maloma	USD/CHF	7.9%	-177.1	-17,832 円
10	圏外	WaveRider	EUR/USD	7.4%	+60.9	+5,582 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、1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。

2013年1月の人気ランキングTOP10は、TOP10圏外から新たに4つのストラテジーがランクインし、12月の人気TOP10が大きく入れ替わる結果となりました。ランキング上位のストラテジーが非常に良い成績を収めたことから12月の不調を取り戻した方も多かったのではないかと考えられます。

また、トレンドフォロー型ストラテジーが好調に転じた点やTOP10中6つが対円通貨を対象とするストラテジーであることなどを考慮すると、下記のストラテジーレポートにも記載されているとおり今後のトレンドの転換点や本邦の主要イベント時にはストラテジーの動きに特に注意を払う必要があるといえそうです。

※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ありません。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

1月も引き続き金融緩和により円安で推移

2013年1月の外国為替相場は、米国の「財政の崖」への応急処置や欧州債務危機の緊張緩和による安心感、また、日本の強力な金融緩和への期待感により、昨年末からの円売り基調が継続いたしました。

米ドル/円は1月22日の日銀金融政策決定会合後に88.06まで下げる場面もありましたが、1月31日には2010年6月以来2年7カ月ぶりとなる91.70まで上昇、ユーロ/円も2010年5月以来、2年8カ月ぶりとなる124.49まで上昇いたしました。

対円通貨ペア、トレンドフォロー型のストラテジーが好調な結果に

こういった相場状況の中、1月の人気ランキングTOP10には、6つの対円通貨を対象とするストラテジーがランキングし、トレンドフォロー型のストラテジーを中心に全体的に好調なパフォーマンスとなりました。

昨年の8月から6カ月連続で人気ストラテジーランキング1位を維持しているThirdBrainFx (AUD/JPY) は昨年12月半ばから調子が回復しトレンドフォロー型のストラテジーとしては、非常に高い8割を超す勝率となりました。

また、圏外から3位にランクインしたThirdBrainFx (CAD/JPY) も、昨年8月からの14連勝後1月半ばに連勝記録をストップさせてしまいましたが、その後の取引では利益を出すなど好成績を残しており、取引回数はThirdBrainFx (AUD/JPY) よりも少ないものの、今後、注目されるストラテジーとなりそうです。

ランキング2位にはコツコツ型で人気の高いPinvestcapital(EUR/GBP)が12月からワンランクアップで、先月に引き続き1月も利益を出しております。

Pinvestcapital(EUR/GBP)は、昨年7月に人気ストラテジーランキングの9位にランクインして以来、7カ月連続でトップ10入りを果たしており、そのうち月間の損益がマイナスとなったのは、11月のみとなっております。

ダークホースが登場！ QuickShift (EUR/JPY)

ランキング 5 位の QuickShift (EUR/JPY) は取引回数の非常に少ないトレンドフォロー型ストラテジーで人気ストラテジーランキング TOP10 には、初のランクインとなります。このストラテジーの特徴は「損切りは早く利食いは遅め」で「平均利益」は「平均損失」を上回っています。

また、最大ポジション数量が「1」ということも大きな利点でありポートフォリオに組み込みやすいストラテジーの一つです。

一方デメリットは、ポジションの保有期間が非常に長いため実際にポジションを持つまでに時間がかかること、また、損失幅も大きめとなるため、リスク許容度を大きめに想定し長期的な運用を心掛けることが大切です。

8 位にランクインした HomeRuns (USD/JPY) は、昨年 6 月に稼働を開始（実際の取引開始は 7 月 10 日）した比較的新しいストラテジーとなります。

HomeRuns の USD/JPY 以外の通貨ペアで検証をした場合、勝率は概ね 50% から 60% 前後となっており、比較的「平均利益」は「平均損失」よりも大きい傾向があり、トレンドフォロー型のストラテジーであると考えられます。

実際に HomeRuns (USD/JPY) 自体もトレンドが確認できる際に、利益をあげることが多く、逆にレンジ相場や相場の反転時にはドローダウンとなる事が多いため、HomeRuns (USD/JPY) を運用中は、相場のトレンドに注意が必要です。

日銀の人事と海外イベントに注目

1 月は上述のとおり、円がらみの通貨ペアでトレンドフォロー型のストラテジーを中心に利益を出す結果となりました。

米ドル/円相場はテクニカル的には一昨年 10 月につけた 77.55 を底値に長期上昇トレンドに入ったと考えられますが、今後の注目されるイベントとして、本邦では任期満了に伴い新人事となる新しい日銀総裁の思惑、海外では 2 月 15 日、16 日に開催される G20、また、2 月 24 日に予定されているイタリアの総選挙ではユーロ圏債務問題の再燃も考えられるため、これらの主要イベントに注意が必要です。（2013/2/5）

■ 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」。バッ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「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

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：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2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が設定したシグナルにしたがって自動売買を行う取引システムです。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における実際の運用成績は、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、過去の運用成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場合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)やその修理費用などに関して、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、ストラテジープロバイダー(ストラテジー提供者)の判断により、ストラテジーが予告なく削除・変更される場合があります。・本サービスは、ストラテジープロバイダー(ストラテジー提供者)が決済シグナルを当社の取引時間外に発信した場合、取引開始後に約定するため、シグナル発信時の価格と約定価格が大きく乖離する可能性があります。この場合、お客様の証拠金状況によっては、ロスカットされるおそれがあることや、お預かりした証拠金を上回る損失が発生するおそれがあります。・本サービスは、設定された最大保有ポジション数以上の建玉を保有する可能性があります。この場合、お客様の証拠金状況によっては、ロスカットされるおそれがあることや、お預かりした証拠金を上回る損失が発生するおそれがあります。・本サービスは、同一ストラテジーの売買シグナルでも約定時間および約定価格が異なる場合があります。