

2013年3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 (2013年2月)
人気ストラテジーTOP10のうち7割がプラス!
新ストラテジーが活躍! 圏外から5つのストラテジーがランクイン

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2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7割がプラス!
- ・ 対円通貨ストラテジーが7つランクイン、今後の相場動向に注意を。
- ・ 圏外からのランクインは5つ、新ストラテジーの活躍に注目が集まった1ヶ月。

■ 2月 人気ストラテジーランキング TOP10 (期間 2013年2月1日~2月28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 | 70.3% | +379.7 | +37,970 円 |
| 2 | 3 | ThirdBrainFx | CAD/JPY | 22.8% | -394.4 | -39,440 円 |
| 3 | 2 | Pminvestcapital | EUR/GBP | 22.2% | -231.5 | -32,484 円 |
| 4 | 8 | Home Runs | USD/JPY | 12.2% | +1,576.6 | +157,660 円 |
| 5 | 圏外 | ExoticFx | USD/JPY | 11.5% | +610.6 | +61,060 円 |
| 6 | 圏外 | Home Runs | EUR/JPY | 10.5% | +606.9 | +60,690 円 |
| 7 | 5 | QuickShift | EUR/JPY | 9.2% | +373.9 | +37,390 円 |
| 8 | 圏外 | Pip master | NZD/USD | 8.7% | +326.2 | +30,180 円 |
| 9 | 圏外 | ThirdBrainFx | NZD/JPY | 8.5% | -113.6 | -11,360 円 |
| 10 | 圏外 | Pminvestcapital | EUR/CHF | 7.4% | +175.7 | +17,370 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、2月28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。

2月の人気ランキングでは、TOP10のうち7つのストラテジーが利益をあげる結果となりました。

また、1月に続き圏外からのランクインが多く見られ、2月は新たに5つのストラテジーがTOP10入りを果たしています。対円通貨ペアのストラテジーが7つ占めていることから、今後の対円通貨ペアの動向に注意を払っていただくとともに、対象通貨ペアが異なるストラテジーを組み入れるなど、リスク管理の観点から、ある通貨に偏り過ぎたポートフォリオにならないよう注意する必要があるといえます。

※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

2月は日銀人事による金融緩和への思惑とイタリア総選挙を受けて乱高下

2013年2月の外国為替相場は、先月のマンスリーレポートでお伝えしたように、日銀人事による思惑から円安で推移し、米ドル円は一時、94.46（東京金融取引所「くりっく365」）まで上昇しました。

その後、イタリア総選挙の結果を受けて、対ユーロで円が買われ90.80まで急落しましたが、1月米新築住宅販売件数、2月米消費者信頼感指数が市場予想を上回る結果となったことや米株価の上昇などから92円台半ばまで値を戻しました。

ThirdBrainFx シリーズ3つがランクイン

こういった相場状況の中、2月の人気ランキングTOP10は大きく順位が入れ替わり、また、比較的好調な結果となりました。

2月で7ヶ月連続、人気ストラテジーランキング1位のタイトルを保持するThirdBrainFx（AUD/JPY）は、上値の重い展開であった豪ドル円相場の影響もあり、月中に3回のストップロスがあったものの、最終的にはそれを取り戻す利益を上げています。

対象通貨ペアAUD/JPYとは対象的に、ランキング2位に浮上したThirdBrainFx（CAD/JPY）と9位にランクインしたThirdBrainFx（NZD/JPY）は、相場の反転に乗り遅れ、2月は多くの取引がマイナスとなりました。1月までのトレンド相場が反転し、2月は値幅の大きいもみ合い相場となったことが一因であると考えられます。

以前にもお伝えいたしましたが、ThirdBrainFxは日足MACDを利用してトレンドを計るため、MACDがシグナルや0ラインと頻繁に交差するような横這いトレンド（トレンドレス）時や、トレンドの転換時にはドローダウンとなる可能性が高くなるため、ご利用される場合はご注意ください。

ルーキー「Pip master(NZD/USD)」が初登場！

8位にランクインしたPip master（NZD/USD）は、昨年未からお客様の注目が集まり、1月・2月のWebセミナー「ストラテジーマンスリーカンファレンス」でも取り上げた（分析した）ストラテジーです。

このストラテジーの大きな特徴は、概ね 200pips 程度でロスカットが行われ、小さな利益をコツコツと積み上げていくことだと思われます。

なかでも、Pip master の NZD/USD は、Pip master で主に取引されている他の通貨ペアに比べてボラティリティが小さいこともあり、他通貨ペアで生じている 200pips クラスの大きなドローダウンは生じておらず、過去の取引で最も大きい評価損が 191pips となっています。

前述のとおり、Pip master はコツコツ型のストラテジーであるため、対象としている通貨ペアのボラティリティが大きいと、大きなドローダウンが生じる可能性があります。そのため、利用時には対象通貨のボラティリティの変化に注意すべきだと考えております。

同じく、2月に初のランクインとなった Home Runs (EUR/JPY) は、1月に 3094.3pips の利益を獲得したため、選択するお客様が多くなったものと考えられます。2月半ばには、2000pips 近くのドローダウンを出しましたが、最終的にはこれを上回る利益を上げています。

このストラテジーの特徴は、「平均利益」が「平均損失」を上回っていること。また、過足や日足チャートでトレンドが確認できる際には利益をあげやすく、逆にトレンドレス（横這いトレンド）時や相場反転時にはドローダウンとなりやすいという特徴があります。

10位にランクインした Pminvestcapital(EUR/CHF)も、今回が初のランクインとなります。

イタリア総選挙後に、過去最大のドローダウンとなりましたが、月間の収益は最終的にプラスに転じました。Pminvestcapital(EUR/CHF)は、短期売買を得意としたコツコツ型のストラテジーであるため、建玉を長めに保有する（日を跨ぐ）場合は、大きな損失が出る前に手動で決済するののも一つの手だと思われます。

対円通貨とユーロの動きに注目

3月は、米国を中心に各国の経済指標が比較的良好な結果となっていることや、本邦金融政策への期待感から、対ドルでは引き続き円安方向での推移を予想しております。

特に、日銀正副総裁新体制のもと、4月3日から4日にかけて行われる日銀金融政策決定会合までは、「金融緩和」への思惑が継続するものと思われますが、リスクシナリオとして欧州債務問題の再燃などには注意が必要です。

なかでも、ユーロ/ドルについては、200日移動平均線の上側を推移しているものの、テクニカル的には下げトレンドが確認できております。

(日足の一目均衡表が三役逆転(2月15日:均衡表が逆転、2月20日:遅行スパンが逆転、3月1日:価格と雲が逆転)となっているため)

また、昨年末から主に対円通貨を中心に各通貨ペアのボラティリティが上昇しているため、ストラテジーの選択や見直しの際には、比較的、建玉を長期保有するトレンドフォロー型のものを中心に、余裕を持った資金管理を徹底して、ポートフォリオを組むことが大切だと思います。

(2013/3/6)

■ 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 3 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。