

システムトレード基礎講座

「勝率37.1%」のブレイクアウト

「勝率 37.1%」のブレイクアウト

証券アナリストで、システムトレードに関するセミナー講師を担当しています、フェアトレード株式会社の西村剛（にしむらつよし）です。本講座では、ご覧頂いた皆さまが基礎から「システムトレード」を理解できるように、やさしい言葉とやさしい表現で解説していきます。ぜひ、最後までお付き合い頂ければと思います。今回のテーマは「勝率 37.1%のブレイクアウト」です。では、中身に入りましょう。

「バックテストに必要なもの」の講座では、ご自身でバックテスト（検証）を行う方法について、いくつかの選択肢をご紹介しました。それをご覧になって、ご自身で実際に「バックテストをしてみたい!」と思った方が多くいらっしゃるのではないのでしょうか。一方で、ちょっと自分ではそこまでやる気になれないと思った方もいらっしゃるかと思います。もちろん、最終的にはご自身でバックテストを行っていただければベストです。しかし、すべての方がそういう目標を持っているわけではないかと思います。

例えば、「バックテストのやり方」よりも「具体的な売買ルール」に、ご興味がある方が多いのではないかと思います。実際に、そのようなご意見を常々頂戴致します。そこで、今回は簡単な売買戦略のバックテストを行い、その結果を皆さんにご覧頂きたいと思います。そして、それを通じて、システムトレードの理解を深めていこうと考えています。

今回は、日本でも有数のシステムトレーダーとの呼び声の高い「斉藤正章」氏に売買ルールにご紹介していただきます。では、こちらか斉藤正章氏にバトンタッチします。

はじめまして、斉藤正章です。今回は、この場をお借りして、私も実際に使用している「売買ルール」についてご紹介致します。今回ご紹介する売買ルールは、「**チャンネルブレイクアウト（高値更新）**」というシンプルな戦略です。この売買ルールは私自身も実際の売買に利用しているメイソンの戦略の1つです。（※私自身が使用している実際の売買ルールは、これに多少の改良を行ったものです）

「**XX日間の高値を更新したら買い**」というようにシンプルなルールであるにも関わらず、使い次第では非常に利用価値の高い戦略なのです。早速、この戦略についてご説明しましょう。

通常、株は「下落したら買い」というイメージを持っている方もいらっしゃるかもしれません。しかし、この戦略は「**過去XX日間の高値（終値で一番高い価格）を高値更新したら買い**」というように、株価が上がったら買いという反対のものです。つまり「**順張りタイプ**」の戦略です。

当然、買い（仕掛け）のルールだけではなく、売る（決済）ときにもルールがありますが、売りのルールも同様に、「**過去XX日間の安値（終値で一番安い価格）を安値更新したら売り**」というように、買いのルールを逆にしたものです。

よって、これらを一言でまとめると株価がある程度上昇したら買い、ある程度下落したら売るというように、現在のトレンドに沿って売買する方法ということになるわけです。

具体的な売買ルールは以下のようになります。

[買いルール]

- ・過去 40 日間の高値（終値で一番高い価格）を更新

[売りルール]

- ・過去 20 日間の安値（終値で一番安い価格）を更新

※売買は翌日の寄付き（始値）で行う

買いか、売りか、にかかわらず、売買を行うのはすべて翌日の寄付き（始値）になりますので、毎日夕方以降に一度だけ株価を確認するだけで OK です。会社員の方などは、仕事が終わって夕方以降に株価を確認し、上記の条件になっていれば、翌日に発注されるように注文を出せば良いです。場中に張り付いてデイトレードなどをする必要は全くありません。

そして、

上記のルールを約 9 年間のデータでバックテストした結果が下記になります。

[検証結果] （テスト期間：2000/1/1～2008/5/16）

勝率：37.1%

平均損益率：+0.89%

平均保有日数：49.94%

いかがでしょうか？チャンネルブレイクアウト戦略を検証した結果、「**勝率は約 37%、平均損益は 0.89%**」とあまり芳しくない結果となりました。

今回の検証結果は、初心者の方にもバックテストの魅力を知っていただくことが目的ですので、お見せする項目（勝率や平均損益率など）は最小限に絞っています。

今回注目していただきたいのは、「**平均損益率**」という項目だけです。この平均損益率をひとことと説明すると、「**1 回の売買をすることで何%儲かるか**」という意味になります。つまり、この平均損益率がわずかでもプラスであれば、「**売買を繰り返せば繰り返すほど儲かるルール**」ということになるのです。

上記の検証結果では、平均損益率が+0.89%ですから、「1回の売買をすることに0.89%儲かるルール」（投資額が100万円なら8,900円儲かる）ということになるわけです。しかし、残念ながらこれは売買手数料等を含んでいない金額ですので、このまま使ってもそれほど儲かるとはいえません。

ただし、今回のバックテストで重要なのは、システムトレードを使うと、

少なくとも過去にどのくらい儲かった（損した）ルールなのかを簡単に知ることができる

ということです。

通常、ご自身の裁量で売買を行っている方などは、自分のやっている方法が長期的に正しいのかを判断するのが非常に難しいものがあります。しかし、システムトレードにおいては、上記のように明確な数字で表現できる売買ルールであれば、簡単に有効性を検証することができるのです。

今回のバックテストにより、システムトレードの可能性について少しでも理解を深めていただければ、私としてはとても喜ばしいことです。

他のテーマの講座では、もう少し深く解説していますので是非ご覧下さい。

斉藤正章

斉藤正章氏の、売買ルールの解説はいかがでしたでしょうか？さらに細かい内容や、他の売買ルールは

【自分で検証できるシステムトレーダーになろう！斉藤正章のシステムトレードアカデミー】でも公開しています。<http://www.fairtrade.co.jp/saitomasaaki/academy/>
ご興味のある方は、ぜひとも上記 URL をご覧下さいますようお願い致します。

フェアトレード株式会社

西村 剛

<著者プロフィール>



西村 剛 (にしむら つよし) 日本証券アナリスト検定会員

1997年国際投信委託株式会社(国際投信投資顧問株式会社)入社。国内株式中小型株アナリスト兼ファンドマネージャーとして株式運用に携わる。年間200社程度の企業調査を行い、株式ファンドを運用。2005年独立し投資教育事業を行うフェアトレード株式会社設立 代表取締役就任。2009年初心者でもプロのトレーダーと同じ運用が出来るソフトウェア「システムトレードの達人」をリリース。

システムトレードでの運用を行う傍ら、日本経済新聞、ヤフーファイナンス、オールアバウト、ネットマネーなどのマスメディアで執筆を行う。現在もヤフーファイナンスにて「株式戦略マル秘レポート」を連載中。また、大阪証券取引所主催セミナーや名古屋証券取引所主催セミナーで講師も勤める。すでに2000名以上が購読する無料メールセミナー講師も行う。

著書：実戦 空売りトレード (明日香出版社)、大証FX入門 (明日香出版社)

本レポートについて、ご質問・ご不明な点などございましたら、下記サポートセンターまでご連絡下さいますようお願い致します。

「システムトレードの達人」サポートセンター

電 話： 03-6280-4580

E-mail： support@sys-tatsu.com

受付時間：10:00～19:00（土日祝日を除く）

システムトレード基礎講座 「勝率37.1%のブレイクアウト」

 フェアトレード株式会社

2011年2月17日発行

発行人 西村 剛（にしむら つよし）

発行所 東京都中央区八丁堀4-11-3 金谷ビル3F

Email: info@fairtrade.co.jp

TEL: 03-3555-3260