

システムトレード基礎講座

新しいルールの発想する「2つの手順」

新しいルールの発想する「2つの手順」

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、新しいルールの発想する「2つの手順」です。では、中身に入りましょう。

どのようにして売買に役立つ「新しいアイデアを発想しているか」ということについて、解説していきたいと思います。はじめに売買ルールを考える前に、どのような目的で使うルールであるかを明確にしておく必要があります。例えば、月単位で安定的に利益をあげたいということであれば、売買回数の多いデイトレード型のルールでないと困難かと思えます。平日働いている方ですと、場中を見る必要のないスイングトレード型ということになるでしょう。デイトレード型なら分足（1分足、5分足など）での検証が必要となります。スイングトレード型であれば、通常の日足だけで検証が可能となります。本講座をご覧頂く方の中には、初心者が多いかと思えますので、ここでは一般的なスイングトレード型のルールを作る前提で話を進めたいと思います。

まず、最初に売買ルールを考えるときに、大まかにかまわないので「**どのようなタイプのルールを作るか？**」という**コンセプトが必要**です。市販のソフトなどを使って、検証を始める方が最初にやりたくなるのは、様々なテクニカル指標を組み合わせるバックテストを繰り返すことではないでしょうか。例えば「RSIとストキャスティクスを組み合わせたらどうなるか」などを考えます。

しかし、ソフトに用意されているテクニカル指標をがむしゃらに組み合わせることで良いルールを作るというのは、あまり賢い方とはいえません。なぜならば、数十種類ものテクニカル指標を組み合わせると、ほとんど無限に近い組み合わせが存在するため、作業量として現実的ではないからです。そこで、最初に必要なのが、「**どのような局面を狙ってトレードするのか？**」という**基本的なコンセプト**ということになります。例えば、以下のようなものが考えられます。

- ・短期間の急落を狙った逆張りなのか、
- ・トレンドに沿って売買を行う順張りなのか、
- ・あるいは特定のパターン（ローソク足の形など）を狙ってトレードするのか

このように大まかなもので、問題ありません。コンセプトがしっかりとしていれば、どのようなテクニカル指標を使うかということが自然と決まってきます。

逆張り系のルールを作るのであれば、「RSI」「移動平均からの乖離率」などが代表的です。順張り系のルールであれば「MACD」「ブレイクアウト」などでしょうか。

基本的なコンセプトが決まっていれば、使用するテクニカル指標は何でも良いともいえます。これまで「逆張り系の売買ルールを作るのに、どのテクニカル指標を使えばいいか？」というご質問を何度かいただいたことがあります。しかしながら、どれを使えばいいという答えがあるはずがありません。

よく考えていただければわかるかと思いますが、

例えば短期の逆張り型の売買ルールを作るために、

「 $\times\times$ 日移動平均からの乖離率が $-\times\times\%$ 」ということと、
「 $\times\times$ 日前からの株価の下落率が $-\times\times\%$ 」ということは

どちらもほとんど同じような意味を表しているわけです。テクニカル指標というものは、単に過去の株価を特定の目的のために加工しただけの道具に過ぎません。つまり、自分の目的に近いものであればどれを使ってもいいということになります。ただし、どれを使うかを選択するためには、テクニカル指標の大まかな意味くらいは知っておく必要はあります。では、ここで内容をまとめましょう。

売買ルールを作るための手順は、以下の通りになります。

■手順.1■

どのような局面を狙ったルールを作るかを明確にする
(短期 or 長期、順張り or 逆張りなど)



■手順.2■

どのテクニカル指標を使うかを選択する(複数の組み合わせも検討)

おそらく、これだけで売買ルールの発想方法を理解するのは難しいかと思います。

そこで、「売買ルールの構築に挑戦」の講座では、具体的に簡単なルールを作りながら、もう少し踏み込んだ解説を行っていきたいと思います。

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 新しいルールの発想する「2つの手順」

 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