

システムトレード基礎講座

まとめ

まとめ

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、本講座の「まとめ」です。では、中身に入りましょう。

これまでに吸収した講座内容をふまえて、本日の「まとめ」をご覧ください。システムトレードとは、「あるパターンが現れたときに売買していれば利益になる」という実績を根拠として行なう投資手法です。そして、システムトレードの最大の魅力は、ある売買手法を実践して損失を出してしまう前にバックテストを行なうことで、過去にそれが有効だったのかどうかを検証できることでした。

しかし、システムトレードというのは、過去の統計からほんの少しでも優位性のある方法を見つけ、その方法を数多く繰り返すことで、少しずつ利益を積み上げていくというのが基本的な考え方です。よって、バックテストの結果、長期的に利益の出る方法でも、短期的には「勝ったり負けたり」の繰り返しとなります。

そこで、短期的に負けが続いてもトレードを継続できるようにするために、資金管理が重要になってきます。講座内に登場した例を挙げると「運用資金 100 万円で 5 銘柄」と「運用資金 1000 万円で 50 銘柄」では、結果が大きく変化していました。

システムトレードでは、個別銘柄を対象に行なう場合、200 万円程度が必要です。これからシステムトレードを始めるという方には、少々リスクが高いかもしれませんが、本講座では、株の話が中心でしたが、そのような方には「日経 225 先物 mini」がお勧めです。「日経 225 先物 mini」であれば 30 万円程度の少額からシステムトレードを始めることができます。また、上昇相場でも下落相場でもそれなりに安定した成績を収めることが可能なため、これから始める方の取り掛かりとしてお勧めできる商品です。

最後は、講座内では取り上げませんでしたが、「**売買ルールの調整**」についてお話します。**売買ルールの見直しは「ちょっと成績が悪いからシステムを見直そう」というものではありません。**できる限りドローダウンの小さい売買ルールを探そうとしても、ドローダウンの少ない売買ルールというのは利回りも小さいのが普通です。最終的には自分の許容できるドローダウンと利回りの大きさをバランスをとることになりますから、過去の最大ドローダウンを更新したときなど、「過去になかった出来事が発生したら」**売買ルールを見直すタイミング**と言えるでしょう。

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 まとめ

 **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