

【ファーストステップFX】

Part1 一流トレーダーへの 道を進む為に

第4章

システムトレードを作る

株式会社チャートマスター

❖はじめに

【推奨環境】

このレポート上に書かれている URL はクリック出来ます。出来ない場合は最新の AdobeReader をダウンロードして下さい。(無料)

<http://www.adobe.co.jp/products/acrobat/readstep2.html>

【著作権について】

このレポートは著作権法で保護されている著作物です。

下記の点にご注意戴きご利用下さい。

このレポートの著作権は作成者に属します。

著作権者の許可なく、このレポートの全部又は一部をいかなる手段においても複製、転載、流用、転売等する事を禁じます。

このレポートの開封をもって下記の事項に同意したものとみなします。

このレポートは秘匿性が高いものである為、著作権者の許可なく、この商材の全部又は一部を如何なる手段においても複製、転載、流用、転売等する事を禁じます。

著作権等違反の行為を行なった時、その他不法行為に該当する行為を行なった時は、関係法規に基づき損害賠償請求を行なう等、民事・刑事を問わず法的手段による解決を行なう場合があります。

このレポートに書かれた情報は、作成時点での著者の見解等です。著者は事前許可を得ずに誤りの訂正、情報の最新化、見解の変更等を行なう権利を有します。

このレポートの作成には万全を期しておりますが、万一誤り、不正確な情報等がありましても、著者・パートナー等の業務提携者は、一切の責任を負わない事をご了承願います。

このレポートを利用する事により生じた如何なる結果につきましても、著者・パートナー等の業務提携者は、一切の責任を負わない事をご了承願います。

【ファーストステップFX】Part1第4章システムトレードを作る

目次

※目次の見出しをクリックすると、その見出しのページに移動します。

❖ 第4章：(1) ——システムトレードって何だ？——	4
❖ 第4章：(2) ——何故システムトレードが必要なのか？——	5
❖ 第4章：(3) ——システムは自分で作らなければならない——	9
❖ 第4章：(4) ——システム＝「エントリー＋決済」——	11
①いつエントリーをするか	12
②いつ決済をするのか	13
❖ 第4章：(5) ——具体的なシステムの例——	14
■例1 ローソク足と20SMA（単純移動平均線）を利用したシステム	15
■例2 10SMAと20SMAを利用したシステム	16
■例3 前のローソク足の高値、安値を利用したシステム	17
❖ 第4章：(6) ——決済には2つの種類がある——	18
❖ 第4章：(7) ——マネーマネジメントの重要性——	19
❖ 第4章：(8) ——改めてシステムを考えると——	21
❖ 第4章：(9) ☆★☆第4章のまとめ☆★☆	23

❖第4章：(1) ——システムトレードって何だ？——

ここでは、投資の世界に触れたばかりの初心者の方が疑問に思う、「システムトレードって？」という所を説明したいと思います。

システムトレード (SystemTrade) とは、投資を行なう際に裁量 (感情・感覚) を排除し、一定売買ルールに従って売買を行なう方法。非裁量トレードの事を言います。

ちょっと難しいですが簡単に説明すると、トレード (投資をする事) の中における基本行動の一部、あるいは、“すべてを機械的” な手法で行なうという事になります。

つまり、「**決められた時に決められたようにトレードをする**」という事こそが、システムトレードと言う事も出来ます。

そして、このシステムトレードを用いる投資家の事を我々は「システムトレーダー」と呼びます。このシステムトレーダーという考え方は、投資でお金儲けをする為には、非常に重要なポイントになって来ます。

[▲目次へ戻る▲](#)

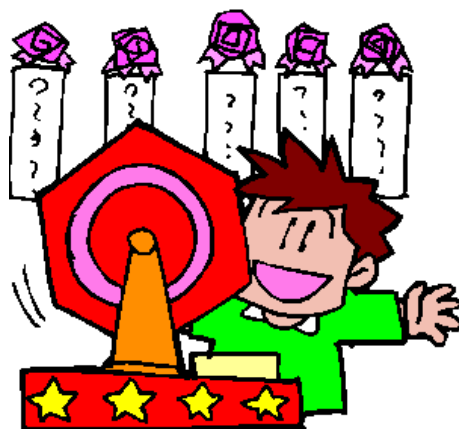
❖ 第4章：(2) ——何故システムトレードが必要なのか？——

それでは何故、そこまでシステムトレードが必要なのでしょう？
先ず一つ質問をさせて下さい。

「あなたは、今までトレードで勝てていましたか？」

恐らく、勝てていなかったかと思います。嘘だと思うのでしたら、自分の今の口座残高をご覧下さい。一目瞭然だと思えます。そもそも相場とは、負ける人がいるから、勝つ人がいるのです。それが、相場というゲームのルールなのです。

では、相場で負ける人とはどういう人なのでしょう？皆さんに、2つ問題を出したいと思います。先ずあなたはこの2択、どちらを選びますか？ちょっとだけ考えてみて下さい。



A : 100%の確率で1億円が当たる宝くじ

B : 50%の確率で3億円が当たる宝くじ

少し考えてみましょう！

さて、皆さんはどちらを選ばれましたでしょうか？

実は皆さんのほとんどがAを選んでしまいます。

というのも、わざわざお金が手に入らない可能性があるものを選んでまで3億円を狙わなくても、1億円あれば十分だと考えるからです。

しかし、トレードをする上での正しい判断はそうではないのです。

それでは、次の問題はどのように考えますか？

A : 100%の確率で1億円を損してしまう宝くじ

B : 50%の確率で3億円を損してしまう宝くじ

どうでしょうか。今度はBを選ぶ人が増えたのではないのでしょうか？

実は、このBという選択肢も、トレードをする上では正しくないのです。このように、人は思った以上に合理的ではない選択をしてしまいます。

これは一体、何故でしょうか？そもそも人間は心理的に、「利益を得るより、同額の損失を被る恐怖を回避する」

また、「利益が大きくなる程、満足度が減り、損失が大きくなる程、苦痛も減る」という傾向があります。

これは、「10億円の利益による満足度は、2億円の利益による満足度の5倍にはならないし、10億円の損失による苦痛は、2億円の損失による苦痛の5倍にはならない」という事を意味しています。

上の場合では、確実に取れる1億円を失いたくないが為に、自然にAを選んでしまうのです。1億円を損失とみなしてしまうのです。

これをトレードに当てはめて考えると、

- ・利益が出た時に利益が増えていく満足度よりも、利益を失う事を恐れる傾向がある
- ・損失を小さい段階で確定する事より、損失が膨らんでも、なくなるまで待つ傾向がある

つまり、「利益は小さく、損は大きく」となってしまう訳です。

その為、自分が上がると思って買った通貨ペア程、「多少下がっても上がるだろう」こんな思い込みがかり易くなります。その結果、トレンドが変わって下がり出しても損切りが出来なくなってしまいます。

その後の人間の行動はどうなっていくと思いますか？



実は負ければ負ける程、トレードに使う資金量が増え、一気に取り返そうとして、どんどんギャンブルになって行ってしまうのです。

そうです。ほとんどの人は、負けるべくして負けているのです。では、トレードで勝っている人はどういう人でしょうか。

そもそもトレードで勝てない理由は、自分の思い込みでトレードをしているからに他なりません。

【ファーストステップFX】Part1第4章システムトレードを作る

では、その思い込みを外したトレードとは…

トレードの際には感情に左右されず、ただ売買サインに従ってトレードする事。

つまり「**システムトレードをする**」という事です。

このシステムトレードを、一流の個人投資家は勿論、ファンドや機関投資家は有効なものとして認知し、広く取り入れているのは最近では良く知られた事実です。

ここまで読んで頂いて、思い当たる所がある方は、結構、いらっしゃると思います。

負けている人のほとんどが、トレードに対してのルールがありません。こうなったらこうしよう…というルールがないのです。個人の思い込みで勝ち続けられる程、相場というものは甘いものではありません。

人間一人の資産等、簡単に奪い去ってしまう程、相場は恐ろしいものだという事を良く知っておいて欲しいのです。それは、プロトレーダーでもよくある事です。

折角、トレードをするのなら、勝たなければトレードをする意味がありません。トレードをする多くの人が、自分は大丈夫だと思い込んで相場の世界に入っていきます。

けれど、負けるんです。

それが、現実なのです。

それならば負けない為に、勝つ為に、真剣にシステムトレードについて考える必要があるのです。

[▲目次へ戻る▲](#)

❖ 第4章：(3) ——システムは自分で作らなければならない——

システムは、最後はあくまで自分で作る必要があります。
それは一体、何故だと思えますか？

ここで二人の人間を紹介します。一人は、バリバリのビジネスマン。毎日、忙しく、とてもとてもチャートに張り付いてトレードをする事が出来ません。

もう一人は仕事を辞め、トレード一本で生活しようとしている、所謂、ニート。とにかく時間は有り余り、いつどんなタイミングでもトレードをする事が出来ます。

さて、そんな二人に、一つの同じトレーディングシステムを教えたとします。

そのトレードとは15分足を使ったトレードです。つまり短期トレードになります。儲かるシステムという事で、教えられたその二人は一生懸命にルールを覚え、トレードを始める事にしました。

しかし、自ずと限界を感じてしまう人間がいました。そう、バリバリのビジネスマンです。

というのも、15分とはかなりの短期トレード。毎日、忙しく仕事をこなしているビジネスマンにとっては、15分足を使ったトレードはかなりの負荷が掛かってしまいます。

確かにその通りにやり続ければ儲かるシステムなのですが、ビジネスマンの方はどうしても続ける事が出来ません。睡眠時間を削り、トレードをしてしまうと、それ自体が自分の健康状態を悪くしてしまいます。

教えられたトレード手法のままでは、とてもトレードを続ける事が出来ないのです。では、どうしたら良いのでしょうか？自分にとって合わないシステムトレードは、続けていてもただ辛いだけです。投資は楽に儲ける事が一つのカギになって来ます。

【ファーストステップFX】Part1第4章システムトレードを作る

そうであれば、そのルールを基にして、自分がトレードし易いやり方に改造して行く必要があるのです。無理をして続けても、いつか必ず危険な状態になります。

そうではなくて、**自分に合うシステムでトレードをする事が大切です。**
それがシステムを自分で作らなければいけない理由になって来ます。

[▲目次へ戻る▲](#)

❖ 第4章：(4) ——システム＝「エントリー＋決済」——

「トレーディングシステムを作りましょう」

こう言うと難しく聞こえてしまいますが、実はもっとずっとシンプルです。
必要なのは、次の2点だけです。

- ①いつエントリーするか
- ②いつ決済するか

これだけで、俗に言うシステムトレードが出来上がってしまいます。
それぞれをもう少し掘り下げて行きましょう。

[▲目次へ戻る▲](#)

①いつエントリーをするか

今日、初めて波に乗るといふ新米サーファーがいたとします。

サーフィンで楽しいと思う瞬間は波に乗れた時です。ですから、彼はまだ初めてですが、どうかそんな波に乗れるように頑張ろうと決意します。

けれど、ここで問題が一つ。

波は寄せては返し、寄せては返しを繰り返しています。その波の動きを見ていてこう思います。「ところで、いつ波に乗ったら良いのだろう？」それは右も左も分からない訳ですから、とにかく適当に乗ってみようと考えます。



でも、波に乗りに来ている訳ですから、波がなければいけません。そこで、こう考えます。

「そうか、波が出来始めの時に乗れば良いのか！」

波を見ていると、寄せては返し、返しては寄せるという動きに、何かリズムがありそうだと感じます。

「そうか、分かったぞ！こう、波がグググッてなっている時に乗れば良いんだ！」

言うは易し、行なうは難しとは良く言ったもので、それで初心者が簡単に乗れるようなモノでもないのですが、そもそもの考え方は一緒です。

相場という波が出来そうなポイントを、特定の客観的事実を持った上で、エントリーして行く必要があります。

[▲目次へ戻る▲](#)

②いつ決済をするのか

波に乗ると言う事は、いつか必ず波から降りる時があります。

波がある時だったり、時間が許す限りはずっと波乗りを続けて行きます。
しかし、そんな波もいつかは必ずなくなります。



そうでなくても、波乗りを続けていると、そのうち体力がなくなって来ます。ですので、自分は一体いつ波乗りを止めるべきか、それを波に乗る前に予め決めておく必要があります。

相場も同じで、エントリーをする前に一体いつになったら、

相場から降りるのかを考えておく必要があります。

[▲目次へ戻る▲](#)

❖ 第4章：(5) ——具体的なシステムの例——

波に例えてエントリーと決済の話をしてきましたが、今度は具体的にルールを添えて考えてみましょう。あくまでシステムトレードの考え方の例であって、チャートマスターが推奨しているものではなく、この通りにやれば勝てるというものではありません。

[▲目次へ戻る▲](#)

■例1 ローソク足と20SMA（単純移動平均線）を利用したシステム

A. いつエントリーするか？

ローソク足が20SMAを上回ったら買い。または、ローソク足が20SMAを下回ったら売り。

B. いつ決済するか？

買いポジションを持っていたら、ローソク足が20MAを下回ったら決済。または、売りポジションを持っていたら、ローソク足が20MAを上回ったら決済。

[▲目次へ戻る▲](#)

■例 2 1 0 SMA と 2 0 SMA を利用したシステム

A. いつエントリーするか？

10SMA が 20SMA を上回ったら買い。または、10SMA が 20SMA を下回ったら売り。

B. いつ決済するか？

買いポジションを持っていたら、10SMA が 20SMA を下回ったら決済。または、売りポジションを持っていたら、10SMA が 20SMA を上回ったら決済。

[▲目次へ戻る▲](#)

■例3 前のローソク足の高値、安値を利用したシステム

A. いつエントリーするか？

前のローソク足の高値を上回ったら買い。または、前のローソク足の安値を下回ったら売り。

B. いつ決済するか？

買いポジションを持っていたら、前のローソク足の安値を下回ったら決済。または、売りポジションを持っていたら、前のローソク足の高値を上回ったら決済。

3つの例を出しましたが、このように、いつエントリーをするのか、いつ決済するのかをルール付けする事で、これをひっくり返してシステムと考える事が出来ます。

[▲目次へ戻る▲](#)

❖ 第4章：(6) ——決済には2つの種類がある——

決済を簡単に言うと、ポジションを閉じる時、その全てを決済と考える事が出来ます。

ですが、そんな決済を二つに分割する事が出来ます。一つはリミット、一つはストップです。それぞれを説明してきましょう。

○リミットについて

リミットはターゲットポイントと言う事も出来ます。これはどういう事かと言うと、「この位置に相場が到達したら、利益確定の決済をする」という事です。

投資をするという事は、当然、利益を上げなければいけません。逆に言えば、出来る限り損をしないようにしなければいけません。

○ストップについて

投資はリスク商品です。利益を得る事を狙うという事は、それに応じて少なからず危険性があります。

しかし、致命的な資産のドローダウンにより、マーケットからの強制退場を喰らいさえしなければ、チャンスは無数にある、という事です。だからストップは重要なのです。

「この位置に相場が到達したら、損失確定の決済をする」

結局の所、ロスカットを正しくマスター出来れば、後はエントリーするだけなので、後は自然に儲かるのですが（少し単純に言い過ぎですが、量が質を凌駕する瞬間は確かに存在し、そこまで生き残る事が出来れば、必ずそれは経験出来ます。）、ここまで到達する前に大抵、致命的な資産のドローダウンによる強制退場をする事になるので、そうならないようにきちんとロスカット（損切り）を身に付ける必要が出て来るのですね。

[▲目次へ戻る▲](#)

❖第4章：(7) ——マネーマネジメントの重要性——

持っているお金を限界まで使う事は非常に危険です。

財布の中には1万円が入っていたとします。そんな折、街に遊びに行った所、お店に売っていたバッグがとても欲しくなりました。ところが、値段を見ると、1万円します。

そこで、あなたはどうしますか？手元にあるお金を全て使って、バッグを買ってしまいますか？



うん、買ってしまおう！と思われた方もいるでしょう。では、こう考えてみては如何でしょうか？今月、あと10日を1万円で過ごさなければならない。その状態で、今、目の前に1万円のバッグがありました。

この状態で、バッグは買いますか？「う～ん、そりゃ流石に買わないよ…」こう思われるでしょうね。何を言わんとしているか分かりますか？

ここで言いたい事は、**自分が持っているお金をコントロールする事が大切です**よという事です。これを専門用語で、「マネーマネジメント」をしっかりとしましょう！という事が出来るのです。

ところが、世のトレーダーの多くは、このお金のコントロールについて、あまり深く考えていない人が数多く存在します。トレードをする際に、目一杯の取引量でトレードをしてしまうのです。

これでは、いつでも破産してくれと言っているようなものです。
マネーマネジメントとはつまり、リスクをコントロールすると言う事。

【ファーストステップFX】Part1第4章システムトレードを作る

投資はそもそもリスク商品ですから、必ずと言って良い程、損が出ます。そんな損が出た時、自分にとって許容出来る範囲である事が重要になって来ます。

例えば、100万円持っていて、1回トレードをしてみたら、10万円の損失を出してしまった。この金額は、自分にとって許容出来るでしょうか？人によって出来ると言う事も出来ますし、出来ないと言う事も出来ます。

ここでのポイントは、**資金リスクを一定にする事**です。

100万円持っていた時の10万円の損と、10万円を持っていた時の10万円の損は、それぞれリスクの度合いが違ふと考える事が出来ます。100万円の方は、元金の10%の減少です。ところが10万円の方は、元金の100%の減少になります。

どちらがリスクが高いかが一目瞭然ですね。

では逆に、100万円持っていた時の10万円の損と、1,000万円持っていた時の10万円の損は、逆に1,000万円の方はリスクが低過ぎる可能性が出て来ます。

100万円の方は10%の減少ですが、1,000万円の方は1%の減少でしかないのです。資金リスクを一定にするという事は、投資に掛けるお金のリスクを一定にする事です。

つまり、損失額を一定のパーセントにする事で、常に一定のリスクパーセントで投資に挑む事が出来るという訳です。

投資はパーセントで考える必要があります。幾ら良いトレーディングシステムが出来たとしても、このマネーマネジメントがしっかりと出来ていなければ、いつか必ず破産をしてしまうのが投資の世界です。

投資で大切な事は、先ず生き残る事です。

その為出来る事は、トレードにおけるリスクの掛け方を一定にし、適度なリスクで続けて行く事が大切です。

[▲目次へ戻る▲](#)

❖第4章：(8) ——改めてシステムを考えると——

改めてシステムを考えてみましょう。システムを作る上で2つのポイントがあります。

①そのシステムで勝てる事（資産が増える事）

勝率が高くて9割の勝率があったとしても、1回の負けで勝ち分が吹っ飛ぶようでは意味がありません。勝率よりも、利益率で見て下さい。

②そのシステムが自分に合っている事（資産が増える事）

投資の目的は何でしたっけ？「稼ぐ事」これに集約されます。

多くの人が、システムを難しく考え過ぎています。
手法に走り過ぎると、足元をすくわれます。

多くの勝っている投資家と会うと分かりますが、それほど難しい手法を利用していません。
へっ？、と思うくらい簡単な、誰でも知っているテクニカル分析でトレードをしています。

ただ同じようにやって、誰でもその手法で稼げるかという別話です。
間違いなく言えるのは、それがその人に合った確かな手法を利用しているのです。

理想を言えば、自分でオリジナルの、どこにもないシステムを構築して、実際にシステムトレードするのが良いのかも知れません。

しかし、一から何もかもを自分で作るのは多分、無理でしょう。最初は、色々なシステムを見たり、実際にやったりして、試して行くのです。

色々なシステムを見て行くうちに、「このシステムトレードはこうアレンジして、ちょっとこう改良したら上手く行くかも？」といったアイデアが出て来るようになって来ます。

【ファーストステップFX】Part1第4章システムトレードを作る

何でもかんでも他人任せでは自立したトレーダーには程遠いです。いつか自分で作ってやるけど、今は他の人たちのアイデアを借りてやろうといった考えでいて下さい。

すでに多く広まっているシステムトレード、トレード手法でも、ほんの一つ自分のアイデア、フィルターを追加しただけで、自分のオリジナルなのですから。とっても簡単ですね。

ただ他人の作ったもの、どこかで聞いたものをそのまま疑いもせず利用するのだけは止めて欲しいのです。それであれが悪い、これが悪いというのも筋が違います。

自分の人生なのですから、他人のせいにするのを止めて、他人から学びとって下さい。たかが投資、たかがFXなのかも知れませんが、投資はあなたの人生にも成り得ます。




あなたの人生ですから、他人任せで良い訳がありません。あなたの人生は、最終的には自分で作り上げて行って欲しいと思います。自分で自分の行動を取れる人間、それが投資家なんだと考えています。

[▲目次へ戻る▲](#)

❖第4章：(9) ☆★☆☆第4章のまとめ☆☆☆

- ・システムトレードを作る事が大切！
- ・システムトレードは最終的に自分で作らなければイケナイ！
- ・システムは「エントリー+決済」で成り立っている。
- ・決済方法にはリミットとストップがある。
- ・システムのキモとなるマネーマネジメントを覚えておく事。

[▲目次へ戻る▲](#)



**Part1 一流トレーダーへの道を進む為に
第4章 システムトレードを作る
株式会社チャートマスター**