

システムのトレード手法

ISP でお渡しするシステム(forex truck)のトレード手法について解説します。

用語解説

レート:

価格のこと。MT4 の右端やターミナルに表示されています。



注文番号 /	時間	取引種別	数量	通貨ペア	価格
	2023.06.27 12:10:05	sell	0.05	usdcad	1.31462
	2023.06.30 14:36:32	sell	0.13	usdcad	1.32636
	2023.07.06 15:18:16	sell	0.28	usdcad	1.33146
	2023.07.06 17:33:11	sell	0.39	usdcad	1.33636

ポジション:

持ち高のこと、建玉(たてぎょく)とも言います。買い注文を行った通貨を持ち越している状態、あるいは売り注文を行った通貨を持ち越している状態のこと。

ロングポジション:

買いポジション(buy)のこと。あるいはポジションを買い越している状態のこと。買いポジションを保有=価格が上昇すれば利益が発生し、価格が下落すれば損失が発生する。

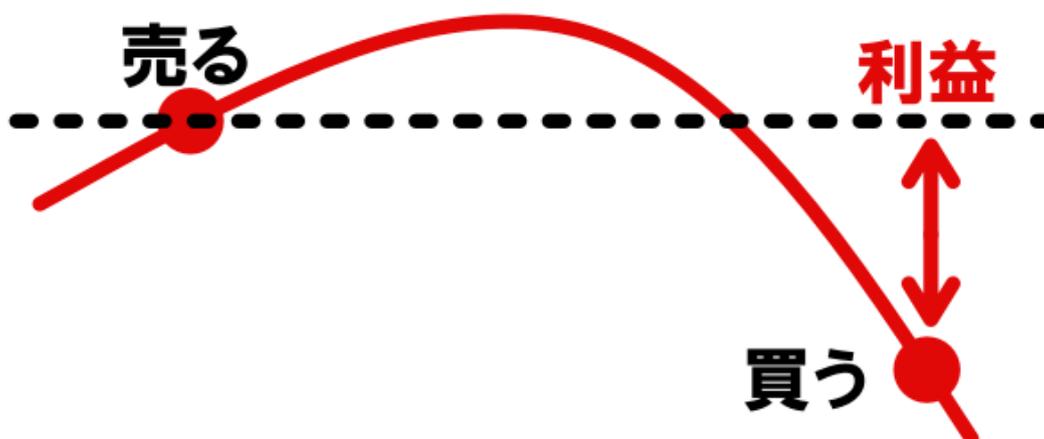
ロングポジション



ショートポジション:

売りポジション(sell)のこと。あるいはポジションを売り越している状態のこと。ショートポジションを保有＝価格が下落すれば利益が発生し、価格が上昇すれば損失が発生する。

ショートポジション



含み損:

ロングポジションを保有している状態で価格が下がり、未確定の損失が発生している状態。あるいはショートポジションを保有している状態で価格が上がり、未確定の損失が発生している状態。

含み益:

ロングポジションを保有している状態で価格が上がり、未確定の利益が発生している状態。あるいはショートポジションを保有している状態で価格が下がり、未確定の利益が発生している状態。

決済:

保有するポジションを解消し、取引を終了させること。決済した時点で損失・利益が確定する。

Lot:

取引数量のこと。証券会社によって異なるが、Tradeview の場合、1Lot=10 万通貨。

取引手法

forex truck はナンピン・マーチンゲールを採用しています。

ナンピン:

レートの逆行によりポジションが含み損になった際に、ポジションを追加して取得価格を平均化させる戦略。

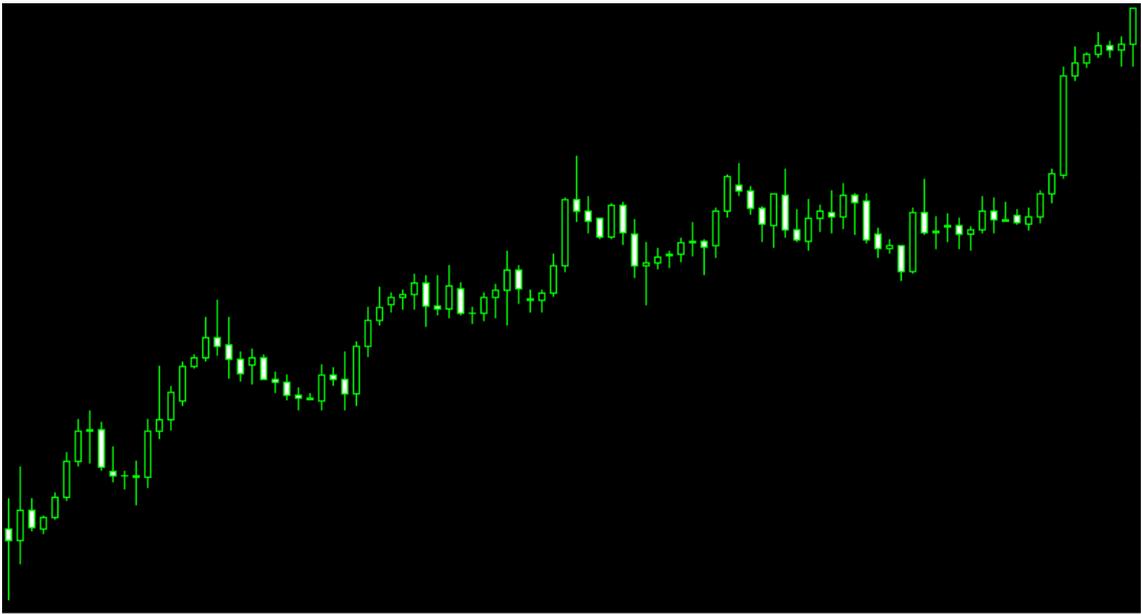
マーチンゲール:

ポジションが含み損になった際に Lot を2倍、4倍、8倍…と倍々にしていき、最終的にどこかで勝てば利益が残るという戦略。

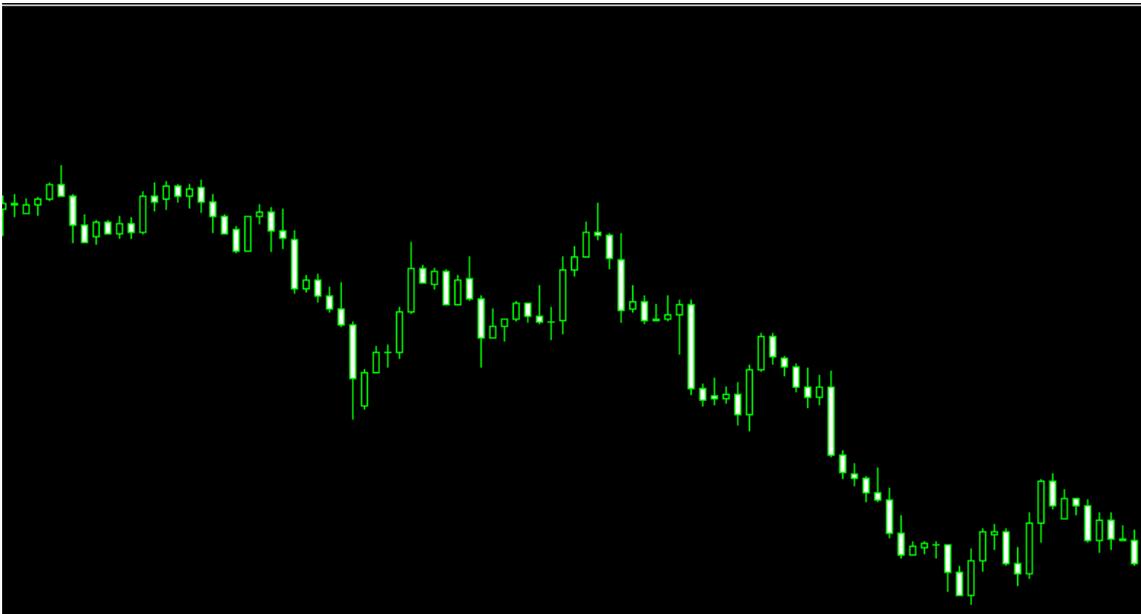
ポジションを保有してレートが思惑通りに動いて利益が乗ればそれでよし。もしレートが逆行して含み損が出たらポジションを追加して利益になるのを待つ戦略です。

相場は屈伸運動しながら動く

ナンピン・マーチンゲールは相場の特性を上手く利用した戦略だと考えます。価格は一直線に動かず、大小なり屈伸しながら動く習性があるからです。



価格が上昇していく際は要所要所で部分的な下げ(=屈伸運動)が発生しています。しやがまないと高くジャンプできないように、価格が上がるにはエネルギー蓄積が必要です。



価格が下落していく際も同様です。一直線には下がらず、要所要所で屈伸運動が発生しています。

直近の実際のトレードを見ていきましょう。



- ① 最初に売りポジションを持ったが、価格が上がって含み損が発生
- ② 売りポジション追加。その後、小さな屈伸運動が起きたが、利益確定ポイントまで少し足らず価格が再び上昇
- ③ 売りポジション追加
- ④ 売りポジション追加後、十分な屈伸運動が起こり、決済して利益確定。

要所要所でLotを増やして取得価格を平均化しているので、価格が①まで戻ってこなくても含み損が解消され、含み益に転じます。

MT4 のターミナル上では以下のように表示されます。

(※StartLot=0.05 の場合)

	時間	取引種別	数量	通貨ペア	価格		損益
①	2023.06.27 12:10:05	sell	0.05	usdcad	1.31462	}	-11 827 ×
②	2023.06.30 14:36:32	sell	0.13	usdcad	1.32636		-14 355 ×
③	2023.07.06 15:18:16	sell	0.28	usdcad	1.33146	}	-15 580 ×
④	2023.07.06 17:33:11	sell	0.39	usdcad	1.33636		-1 173 ×
							-43 855

屈伸運動が起きる前は4つの売りポジション(sell)を保有し、Lot(数量)もポジション毎に増やし(ナンピン・マーチンゲール)、含み損が発生しています。その後、屈伸運動が起きると・・・

	時間	取引種別	数量	通貨ペア	価格	損益
①	2023.06.27 12:10:05	sell	0.05	usdcad	1.31462	-8 451
②	2023.06.30 14:36:32	sell	0.13	usdcad	1.32636	-5 605
③	2023.07.06 15:18:16	sell	0.28	usdcad	1.33146	3 243
④	2023.07.06 17:33:11	sell	0.39	usdcad	1.33636	25 013
						13 280

含み損が解消され、一定額の含み益に転じた所で決済。利益確定です。

このように最初のポジションを保有(①)してレートが思惑と逆行した場合、要所で取引数を増やして(②③④)取得価格を平均化させ、屈伸運動で利確します

ポジション保有後、レートが思惑通りに動けばそれでよし。レートが逆行してもよし。価格がどちらに動いても対応できる戦略なのです。

「屈伸運動しながら動く」という相場の習性を利用することで、レートが逆行しても一定水準までカバーできます。

Lot 設定は絶対遵守

マッチングアプリの出会いがプロフィールで9割決まるなら、FXのシステムトレードは Lot 設定で9割決まると言っても過言ではありません。

Lot 設定を間違えると重大な損失に繋がります。

Lot の基本設定は「投資金:StartLot=10万:0.01」です。もしこれを間違えてしまったり、欲をかいて Lot を基本設定の10倍にするとどうなるでしょうか？

	時間	取引種別	数量	通貨ペア	価格	損益
①	2023.06.27 12:10:05	sell	0.05	usdcad	1.31462	-11 827 ×
②	2023.06.30 14:36:32	sell	0.13	usdcad	1.32636	-14 355 ×
③	2023.07.06 15:18:16	sell	0.28	usdcad	1.33146	-15 580 ×
④	2023.07.06 17:33:11	sell	0.39	usdcad	1.33636	-1 173 ×
						-43 855

上記画像の例で、Lot(数量)を10倍にすると含み損も10倍まで膨れ上がります。すると含み損が 438,550 円になります。

もし投資金 50 万に対して 43 万の含み損となると、下手すれば投資金の大半を失うリスクが出てきます。

FXでは強制ロスカットと呼ばれ、含み損が投資金の一定割合まで膨れ上がると、ポジションが強制的に決済されてしまう仕様なのです。

だからこそ、Lot 設定は慎重に、ゆっくり行うべきであり、リターンを増やしたいからと言って、安易に Lot を過剰に上げると大火傷します。リスクとリターンは比例します。

ウォーレン・バフェット

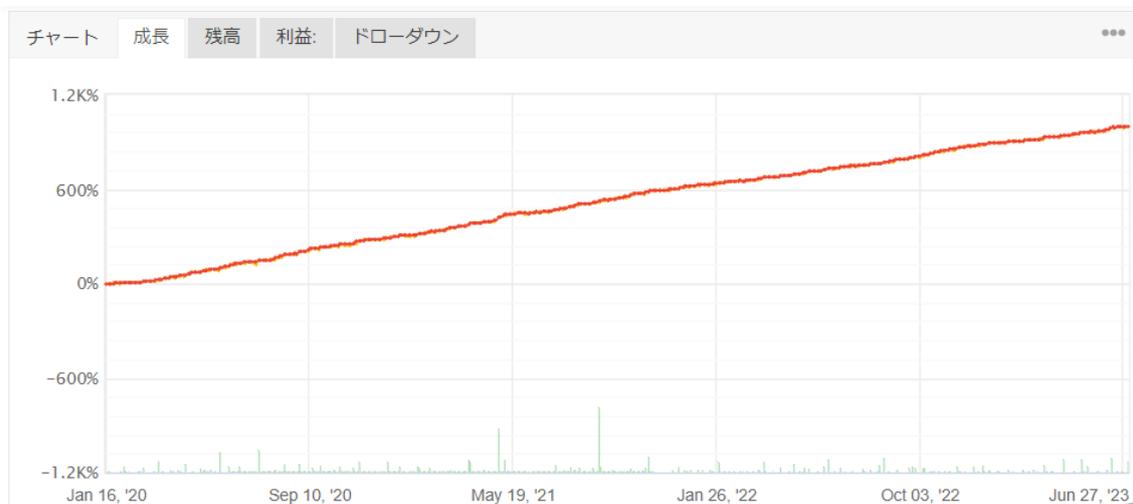
「ルールを決して忘れるな」

ブルース・コフナー

「欲の深いトレーダーは必ず失敗する」

勝てば官軍、負ければ賊軍

ナンピン・マーチンゲール戦略はトレーダーによって賛否別れますが、何だかんだ言って、forex truck はシステムを稼働して3年と7か月。月ベースで今まで一度も負けたことがない、という事実はあります。



俺も過去、ナンピン・マーチンゲール戦略ではない全く別のシステムをいくつか運用していたことがありますが、それらのシステムは数か月や半年も経たずロジックが通用しなくなり、やがて資金を減らすだけの金食い虫になっていきました。

誰が何と言おうが、投資は結果が全てであり、結果が出ているなら手段は何でもいいというのが個人的な考えです。

長く投資の世界にいるおかげか、年単位で長期的に生き残っているのは、ナンピン・マーチンゲール型のシステムであるという共通点も見えてきました。

もちろん、全てのナンピンマーチン型システムが良いというわけではなく、世の中には粗悪なシステムも多数存在します。

女性は女性でも、弄られるのが好きというタイプもいれば、褒められるのが好きというタイプもいて、女性を一括りにしてはいけないように、FXのシステムトレードも

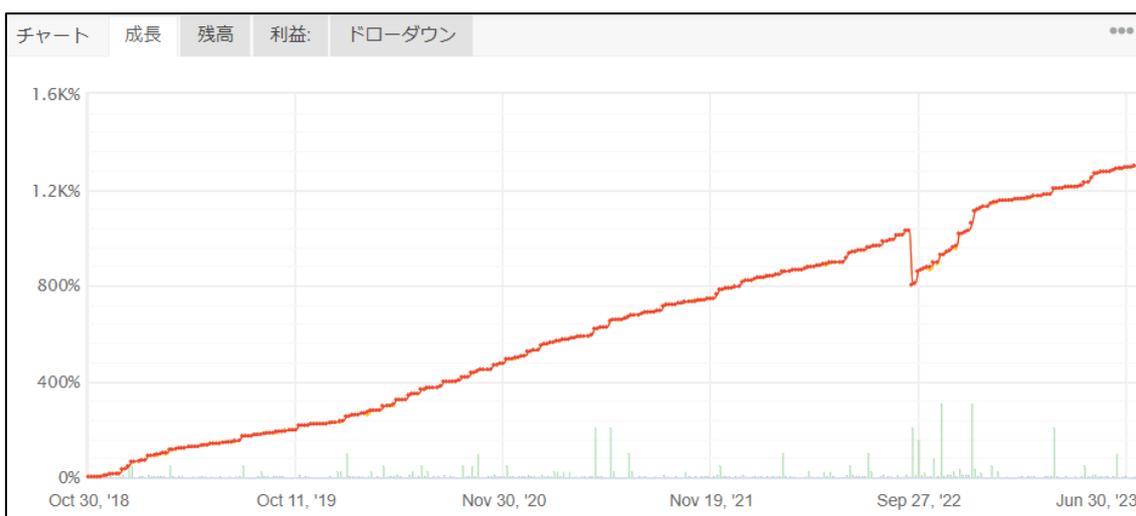
- ・長期的に生き残るシステム
- ・短命に終わるシステム

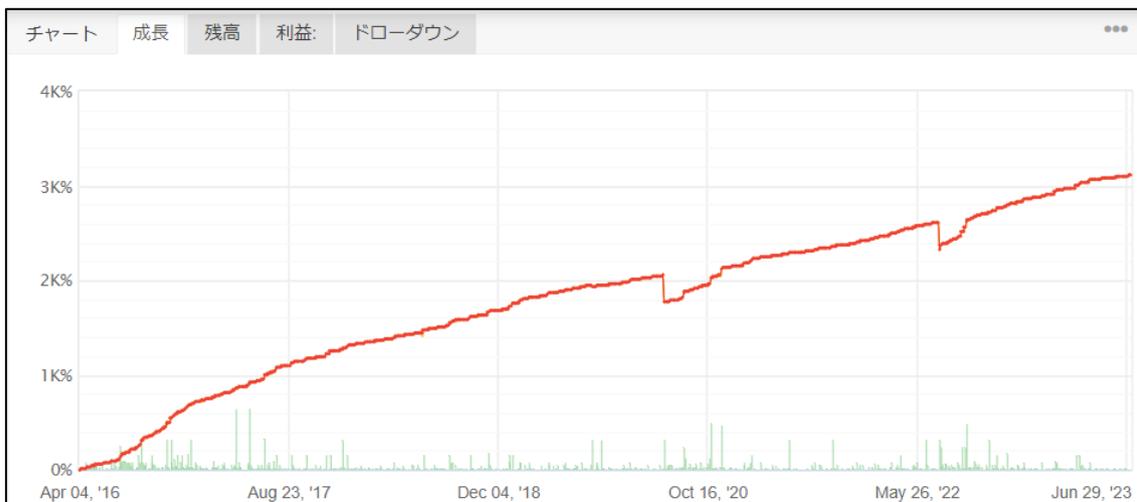
という風にカテゴリズできそうです。長期的に生き残っているシステムは本当に数少ないです。

「屈伸運動しながら動く」という相場の習性は FX に限らず、あらゆる金融商品に当て嵌まりますし、いつの時代も普遍的だと考えられるので、今後もナンピン・マーチンゲール型システムを永く愛用しようと思います。(※長期的に生き残るシステムに限る)

もし大きな損失が出たら？

こちら 2 点は forex truck とは別のナンピン・マーチンゲール型システムです。





ご覧のように所々グラフが大きく落ちている部分がありますが、これは大きな損失が出たことを意味します。

損失が甚大にならないよう、システム側で含み損のポジションを決済することもあります。いわゆる緊急時のセーフティ機能です。屈伸運動が不十分で価格がズルズル逆行していった際に起こり得ます。

大きな含み損が出てピンチを迎えた時は、損失を確定(=損切り)してでも生き残る事を最優先にします。資金ショートすると何もできなくなりますからね。

ジョージ・ソロス

「まずは生き残れ。儲けるのはそれからだ」

そして面白いことに、その後もシステムを稼働し続けていると、損失分を回復し、最高残高を記録しているのが分かります。生き残る事の重要性が分かるかと思います。

よく、損切り=悪と考える方もいますが、損切りこそセーフティ機能であり、損切りしなければ更に価格が逆行して、全資金が溶ける可能性もあるわけで、それこそギャンブルと変わりません。

投資に絶対はない以上、forex truck も今後大きな損失が出る可能性もゼロではありません。頭の片隅に入れておくといいでしょう。

もし、実際に大きな損失を体験すると

- ・システムが通用しなくなったのでは？
- ・怖いからシステムを停止しよう
- ・システムトレードはオワコンだな

など、様々なネガティブ心理状態になることが予想されますが、システムを稼働させたら何があっても放置。この態度を一貫させることです。

もし途中でシステムを辞めれば、その後得られた利益を取り逃すことになるでしょう。

大きな損失を受けても必要経費と捉え、システムを稼働させたら何があっても放置。雨が降っても風が吹いても放置です。なぜなら・・・

ジョージ・ソロス

「良い投資とは退屈なものだ」

フィデリティ社

**「一番成績が良かったのは
運用を忘れていた人」**