

トレンドフォローで儲ける方法を 完全無料で公開します・・・

保田です。

検証くんを使って逆張り型の売買ルールで儲ける方法については、これまで公開してきましたが、順張りの売買ルールは一度も公開したことがありませんでした。

ただ、検証くんを使えば、儲かる順張りストラテジーはもちろん構築可能です。

今日はトレンドフォローで利益をあげる上で、かなり重要なノウハウを無料で公開します。

これは未だ日本では語られたことがない情報であり、どう安く見積もっても10万円以上の価値がある内容ですので・・・メモを取りながら、じっくりと読み進めるようにしてください。

トレンドフォローで儲けるための真髄は、以下の3点に集約されます。

- (1) 利はとことん伸ばし、損はすばやく切る
- (2) 相場全体が上昇トレンドに突入した可能性が高いと判断できる場合のみエントリー
- (3) 資金管理が最も重要。200万円以上の資金量と、幅広い分散は必須

具体的なストラテジー構築例①

利はとことん伸ばし、損はすばやく切る

それでは具体的に2000年1月～2007年11月、資金500万での検証結果を見ていきます。

まず、以下の【表1-1】および【表1-2】は、至極単純なブレイクアウトシステムを検証した結果です。

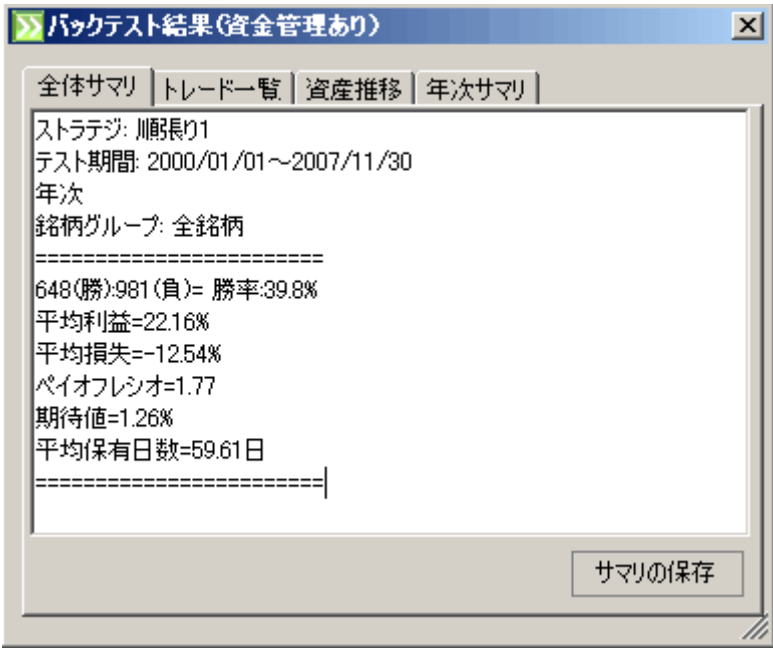
※1 ブレイクアウトシステムとは・・・

X日の高値更新で買い、X日の安値更新で売りというルール。

※2 パラメーターはあえて伏せます。売買ルールは、自分自身で検証してはじめて意味があると私たちは考えているからです。

検証くんを使用すれば、すぐに検証でき、最適なパラメーターがわかります。短い日数のブレイクアウトよりも、長い日数でのブレイクアウトの方が、機能しやすい傾向があります。

【表1-1】



全体サマリ	トレーダー一覧	資産推移	年次サマリ
ストラテジ: 川崎長01			
テスト期間: 2000/01/01~2007/11/30			
年次			
銘柄グループ: 全銘柄			
=====			
648(勝):981(負)= 勝率:39.8%			
平均利益=22.16%			
平均損失=-12.54%			
ペイオフレシオ=1.77			
期待値=1.26%			
平均保有日数=59.61日			
=====			
サマリの保存			

【表1-2】

年	資産	最大DD	勝率	期待値	年利
2000	3,913,863	28.3%	35.8%	-1.6%	-18.6%
2001	4,393,385	32.0%	34.4%	-0.8%	-1.1%
2002	2,094,031	58.1%	28.6%	-6.0%	-52.3%
2003	6,895,638	16.0%	49.0%	7.0%	81.1%
2004	5,214,197	15.8%	45.0%	2.7%	39.6%
2005	5,312,903	9.8%	58.6%	15.8%	126.2%
2006	2,223,045	58.4%	30.2%	-5.5%	-42.9%
2007	4,207,927	27.4%	35.7%	-1.9%	-15.8%

【表1-1】にあるとおり、1トレードあたりの期待値が+1.26%ですから、優位性がないわけではありません。

しかし、【表1-2】を見ると、最大ドローダウンは大きく、通年で-50%のヤラレを喫しているケースもあります。

X日の高値を更新したら買い、X日の安値を更新したら売り(イグジット)というルールだけでも、“利はとことん伸ばす”ことは可能です。

しかし、損をすばやく切ることは出来ていません。

そこで、損切りのルールを入れます。

パフォーマンスは大してアップしませんが、損切りを入れたことによって最大ドローダウンが軽減されていることがわかります。

裁量トレードを実践するトレンドフォロワーが、「利はとことん伸ばし、損はすばやく切れ」と言っているのが、あながち間違った考えではないことが、わかると思います。

この売買ルールは2000年以降の8年間で、年平均16.9%のリターンをあげているとはいえ、年間を通じての負け幅が、30%を超過している年もあり、実際の運用で使用するのには、厳しいといわざるを得ません。

年間を通じて大きく負けている年は、2002年、2006年、2007年であり、当たり前のことですが相場全体が下落傾向になった場合、トレンドフォロー型の戦略だと儲からない、つまり損失を被ることがわかります。

そこで、相場全体が上昇トレンドの場合にのみ仕掛けを行うという条件を考えます。

具体的なストラテジー構築例②

相場全体が上昇トレンドの場合のみエントリー

相場全体のトレンドを定義する上で、検証くんが搭載している資金管理条件にある突入タイミングの機能を使用します。

ブレイクアウトした銘柄が、日本株4000銘柄のうち、X銘柄以上になったら仕掛けるといった具合です。しかし、X銘柄以上という風に、サイン点等銘柄が固定●個以上という条件よりも、より強力な条件があります。

それは、サイン点灯数が過去●日の平均点灯数の●倍以上に達したら仕掛けを行うという条件です。

検証してみれば分かりますが、この条件を使用することによって、より上昇トレンドの初動を捉えることが出来るようになるケースが多いです。

【表3】は先ほどの損切りありのブレイクアウトシステムに、「120日平均点灯数の3倍以上」という条件を加えた検証結果です。

【表3】

年	資産	最大DD	勝率	期待値	年利
2000	4,077,427	18.6%	10.8%	-9.4%	-18.5%
2001	4,924,766	11.7%	34.5%	-0.3%	-1.5%
2002	4,941,599	13.9%	25.3%	-0.7%	-1.2%
2003	5,682,286	22.2%	37.9%	4.1%	25.5%
2004	5,564,692	2.2%	65.9%	5.3%	11.3%
2005	6,701,543	3.4%	70.5%	18.8%	119.9%
2006	4,535,867	9.3%	47.3%	-0.1%	0.6%
2007	5,423,970	8.9%	34.5%	2.2%	8.5%

ご覧の通り、上昇相場でのリターンを犠牲にすることなく、2006年や2007年の下落相場を回避することに成功しています。

これが突入タイミングを調整するインパクトです。
資金管理という概念がいかに重要か、わかってもらえると思います。

この戦略でも平均ドローダウンが11.3%、平均年利が18.1%ですから、実運用での使用を検討するに値します。

ただ、この全体相場が上昇トレンドという条件に加えて、個別銘柄ベースでも上昇トレンドにある、つまり強い銘柄だけにエントリーするという条件を加えると、【表4-1】のようなパフォーマンスを達成可能です。

【表4-1】

年	資産	最大DD	勝率	期待値	年利
2000	4,483,722	10.9%	5.3%	-10.4%	-10.3%
2001	4,799,300	16.2%	35.6%	-1.3%	-4.0%
2002	5,757,419	12.1%	40.6%	4.1%	15.1%
2003	4,826,887	13.3%	34.3%	1.7%	14.9%
2004	5,670,388	3.5%	60.8%	5.2%	13.4%
2005	6,750,636	3.6%	68.6%	19.6%	130.8%
2006	4,734,567	5.3%	47.8%	-0.4%	-0.5%
2007	5,082,296	7.3%	37.0%	0.5%	1.6%

上昇トレンドにある強い銘柄のみエントリーするという条件を加えることによって、ドローダウンは9%まで低下し、平均年利は20%を越える水準になりました。

具体的なストラテジー構築例③

資金管理が最も重要(200万以上、幅広い分散)

年利20%強、ドローダウン9%という【表4-1】のストラテジーは、資金500万、レバレッジ2倍、そして1ポジションあたり資金の20分の1という条件で検証された結果です。

では、資金200万、レバレッジ2倍、1ポジションあたり資金の5分の1で仕掛けという風に、資金管理条件を変化したらどうなるか？

【表4-2】を見てください。

【表4-2】

年	資産	最大DD	勝率	期待値	年利
2000	1,530,595	23.5%	0.0%	-12.0%	-23.5%
2001	1,719,660	17.6%	28.6%	-4.8%	-14.0%
2002	2,067,717	11.8%	28.6%	-0.1%	3.4%
2003	1,871,572	15.4%	31.1%	0.1%	-6.4%
2004	1,894,350	5.5%	46.7%	-2.1%	-5.3%
2005	2,428,924	7.5%	57.9%	14.3%	97.8%
2006	1,793,900	10.3%	40.9%	0.0%	-0.9%
2007	2,054,900	6.3%	38.5%	1.6%	2.7%

表にあるとおり、ドローダウンは12.2%へと増加しているにもかかわらず、平均年利は6.7%へ大幅に低下しました。

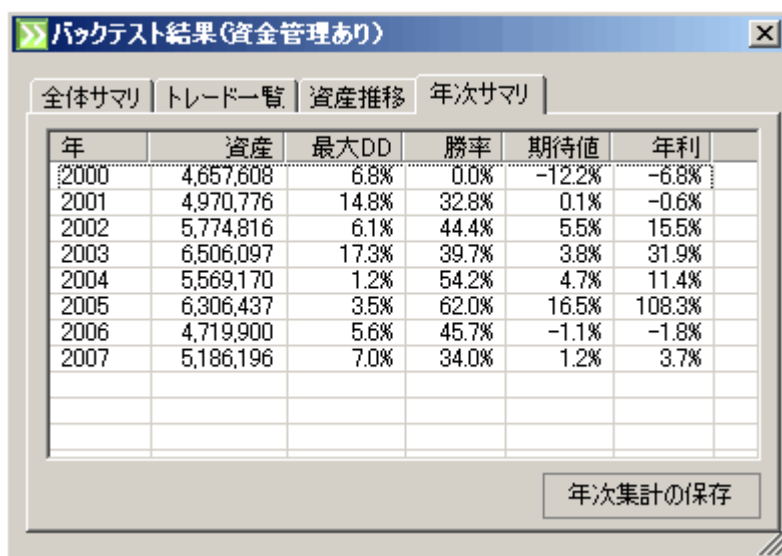
さきほどの突入タイミングに加えて、資金量や分散のさせ方が、トレンドフォローで儲ける上で、いかに重要か、お分かりいただけると思います。

最後に・・・

IITの自己資金ファンドで使用するメソッドを公開！

【表5】が今回構築したトレンドフォロー戦略の完成形です。

【表5】



年	資産	最大DD	勝率	期待値	年利
2000	4,657,808	6.8%	0.0%	-12.2%	-6.8%
2001	4,970,776	14.8%	32.8%	0.1%	-0.6%
2002	5,774,816	6.1%	44.4%	5.5%	15.5%
2003	6,506,097	17.3%	39.7%	3.8%	31.9%
2004	5,569,170	1.2%	54.2%	4.7%	11.4%
2005	6,306,437	3.5%	62.0%	16.5%	108.3%
2006	4,719,900	5.6%	45.7%	-1.1%	-1.8%
2007	5,186,196	7.0%	34.0%	1.2%	3.7%

ドローダウン7.8%、平均年利20%強という戦略です。

IITの自己資金ファンドは、基本的にこのトレンドフォロー型の戦略で平常時は運用しています。

そして、相場全体が大暴落した場合は、【表6】にあるようなカウンタータイプの戦略を使って、短期間で大きな利益をあげることが出来ます。

平均年利180%以上、ドローダウン4.6%という戦略です。

【表6】

年	資産	最大DD	勝率	期待値	年利
2000	34,536,370	6.3%	94.0%	10.1%	580.2%
2001	11,425,736	1.5%	88.8%	9.1%	117.0%
2002	7,971,348	2.6%	93.5%	10.7%	59.4%
2003	8,290,640	5.4%	93.1%	8.2%	65.8%
2004	9,889,432	4.4%	85.1%	6.7%	97.8%
2005	6,151,068	6.0%	81.6%	6.0%	23.0%
2006	23,250,049	4.6%	88.8%	7.5%	365.0%
2007	11,754,027	5.8%	84.7%	5.7%	135.1%

このレポートで紹介した順張りストラテジーと、表6にあるような逆張りストラテジーをみれば、なぜ私たちが軽々と年利100%以上の運用リターンをあげているのかが、理解いただけるはずです。

私は、このトレンドフォローレポートにおいても、また以前書いた逆張り型のストラテジーレポートでも、あいまいな話は一切していないはずです。

事実、私が書いた無料レポートを読み、実際に検証作業を自分の手で行ったトレーダーの多くが、8月以降の下落相場において、数十パーセントのリターンをあげているという事実があります。

このレポートを読んでも、「IITなんて信用できない。」、「●●先生の方が、儲かってそうだし、なんか凄そうだし…」と思うのならば、どうぞそちらに行ってください。

検証不可能なトレード法を偉そうに語るカリスマ、何の役にも立たないウンチクやら売買符を自慢げに語る自称一流トレーダー等…

ネット上にあふれかえっている、そういう情報を頼りに、トレードしてもらえればと思います。

ただ、私には強い確信があります。

それは、「日本株をトレードし、長期的に儲け続けるためには、検証くんを入手する以外に方法はない。」というものです。

私はこれまで100個以上の投資商材を企画したり、自分でも300以上の投資商材を目にしたりしながら、トレードを実践してきました。

そして、20代の若さで、数億円のキャッシュをつかみました。

その経験を経て断言します。

「相場で儲けるためには、繰り返せば繰り返すほど利益があがる有効な売買ルールを持つ。」

これしか、方法はないんです。

少なくともいえるのは、相場を予測し、それを当て続けることで利益をあげることなど不可能だということです。

有効な売買ルールを構築するためには、過去データを検証する以外に方法はありません。

エントリー条件、イグジット条件、それに資金管理条件を明確に定義し、幅広い銘柄で長い期間のバックテストを行う以外に方法はないのです。

そして、現在、資金管理を考慮できる日本株システムトレードソフトは検証くん以外に存在しないわけですから・・・

日本株のトレードで、5年、10年と、継続して利益をあげようと思ったら、検証くんを使用する以外に方法はないと思うのです。

検証くんを使って利益をあげているのは、私たちだけではありません。

ユーザーの多くが、2007年8月からの難しい相場環境下において、100万、200万と利益をあげているのです。

こういう話をすると、必ずこんな反論にあいます。

「システムトレードが有効だって？」

「馬鹿なことを言うな。それはあくまで過去データの検証結果であって、将来儲かるかどうかなんてわからないだろう・・・？」

ごもっともな意見です。

しかし、こんな意見に対して、アメリカにおける伝説のトレード集団タートルズの一人が、すばらしい見解を述べているので、紹介します・・・

相当数のトレーダーは、バックテストと呼ばれることもある過去のデータにもとづくテストを信じない。

過去のデータを使ってテストをしても、過去は繰り返すはずがないので無益だ、というのだ。

過去のデータにもとづくテストを信じない人たちへのわたしの質問は、こうだ。

ほかに方法があるのか？

過去の知識なしに、どうやって戦略と呼べるようなものにたどり着けるのか？

どのようにして、売買の時期を決めるのか？

当てずっぽうなのか？

あなたが得ることのできる情報は、これまでの市場行動しかない。

引用元:「タートル流投資の魔術」カーティス・フェイス著 徳間書店

結局どんなに優秀な裁量トレーダーとて、自分の経験や、過去の値動きから、利益になりやすいパターンを認識し、それに基づきトレードを行っているはずです。

例え裁量トレードを実践するのでも、これだけ高性能パソコンが安価に手に入る時代において、過去データの検証結果を見ないという選択をする理由が私にはわかりません。

でも10万円以上もするソフトなんだろう？

時に、こんなことも言われます。

たしかに、検証くんを入手するには、10万円以上のコストが必要です。

2007年7月に検証くんを公開して以来、その何倍もの金額を既に相場から回収したユーザーが多数いるとはいえ、普通の人にとっては、高い買い物であることは、私も知っています。

ただ、そのコストを嫌って、相場をやって、多額の金を失うことに比べれば、はっきりいって、タダみたいな金額なのです。

購入から2ヶ月やそこいらで、100万、200万と相場から利益をかすめとった既に検証くんを手にしたユーザーにとっては、タダみたいな金額なのです。

私の資産は、昨今の下落相場のおかげで、すでに3億5000万円を越えるところまで来ました。

今後も、運用を続けていくわけですから、年収1億円程度は、ほぼ間違いなく、私のもとに入ってくることと思います。

もう別に、何一つお金に困っていないので、これだけは、ハッキリ言います。

私は別に検証くんを、買って欲しいなんて、微塵も思っていません。

ただあなたが、本当に相場で利益を手にしたのであれば、自分自身の手で検証作業を行う以外に方法はありません。

そして、日本株全銘柄を対象に、資金管理を考慮した形で検証を行うためには、現時点で世界的に見て、検証くんを使用する以外に方法はないのです。

もし、決断できないのならば、投資はやめておくのが無難です。

相場で儲けようなどと考えず、労働の対価として、お金を得ていくことに注力してください。

具体的な検証の流れや、実際に機能する逆張り型の売買ルール、そして検証の際に絶対に気をつけなければいけないポイント等・・・

私は、全て無料レポートという形で公開しています。

無料ですので、あなたには一切リスクはありません。

もし、あなたが2007年の株式市場で利益を手にすることが出来ていないのであれば・・・

今すぐはこちらをクリックして、私の渾身のレポートを熟読するようにしてください。

<http://www.kensyokun.com/method.html>

最後までお読みいただき、ありがとうございました。

保田望

追伸

このレポートを無料だと思ってなめないでください。

日本株のトレンドフォローノウハウについて、このレポート以上に、利益に直結する情報を、私は見たことはありません。

特に、6ページから7ページにかけてと、9ページから11ページにかけては、かなり貴重なノウハウを書いていますので・・・

もしあなたが日本株のトレーディングで本当に儲けたいと少しでも思っているのならば、もう一度熟読するようにしてください。