



225先物 & TOPIX先物 システムトレードの現状分析

```
NPPTS:LOOKBACK(NumericSimple),ANNUAL(NumericSimple);
Vars: HVol(0), Per(0);
If DataCompression<=2 then Per=1;
If DataCompression=3 then Per=7;
Vars: HVol:=Close/Close[1],LOOKBACK)*
SquareRoot(ANNUAL/Per);
HisVol:=Vol[1];
Vars: HVRatio(0), NR4(False), InBar(False);
HVRatio=(HisVol[100,250]/HisVol(100,250))*100;
NR4=Range=Lowest(Range,4);
InBar=H<H[1] and L>L[1];
If HVRatio<= 50 and (NR4 or InBar) then begin
Buy at High + (1*MinMove points) stop;
Sell at Low - (1*MinMove points) stop;
end;
```

West Village Investment 株式会社
取締役 岩本祐介





日経225先物の現状分析

当日終値－当日始値	2006		2007		2008		2009	
	回数	割合	回数	割合	回数	割合	回数	割合
-400円以下	1	0.41%	1	0.41%	3	1.23%	1	0.62%
-300円から-390円	9	3.67%	4	1.65%	8	3.29%	1	0.62%
-200円から-290円	12	4.90%	11	4.53%	19	7.82%	3	1.85%
-100円から-190円	37	15.10%	41	16.87%	32	13.17%	21	12.96%
-10円から-90円	59	24.08%	55	22.63%	61	25.10%	57	35.19%
10円から90円	60	24.49%	72	29.63%	40	16.46%	40	24.69%
100円から190円	32	13.06%	32	13.17%	48	19.75%	25	15.43%
200円から290円	20	8.16%	13	5.35%	17	7.00%	4	2.47%
300円から390円	1	0.41%	3	1.23%	3	1.23%	0	0.00%
400円以上	1	0.41%	1	0.41%	6	2.47%	0	0.00%

注) 2009年は8月31日まで。

(参考) 2006年から2009年8月31日までの日経225先物の水準

	高値	安値	終値の平均	年間のレンジ
2006	17,580	14,020	16,109	3,560
2007	18,320	14,660	17,004	3,660
2008	14,900	6,990	12,152	7,910
2009	10,770	7,010	8,998	3,760



日経225先物の現状分析

2006年	前場	後場	一日	前後場
平均値(終値-始値)	68.78	85.71	110.45	相関係数 0.15129
標準偏差	64.90	80.52	92.37	
2007年	前場	後場	一日	前後場
平均値(終値-始値)	59.18	65.51	102.84	相関係数 -0.05117
標準偏差	51.64	67.58	90.48	
2008年	前場	後場	一日	前後場
平均値(終値-始値)	79.84	94.53	135.06	相関係数 -0.02902
標準偏差	64.10	98.21	116.90	
2009年	前場	後場	一日	前後場
平均値(終値-始値)	61.48	59.81	84.07	相関係数 -0.05915
標準偏差	41.38	55.50	70.35	

合計ポイント(円) 2005年～2009年		
	前場(終値-始値)	後場(終値-始値)
月	1,780	(3,390)
火	600	(420)
水	(720)	(1,630)
木	2,060	1,850
金	(3,310)	2,280

注)2009年は8月31日まで。

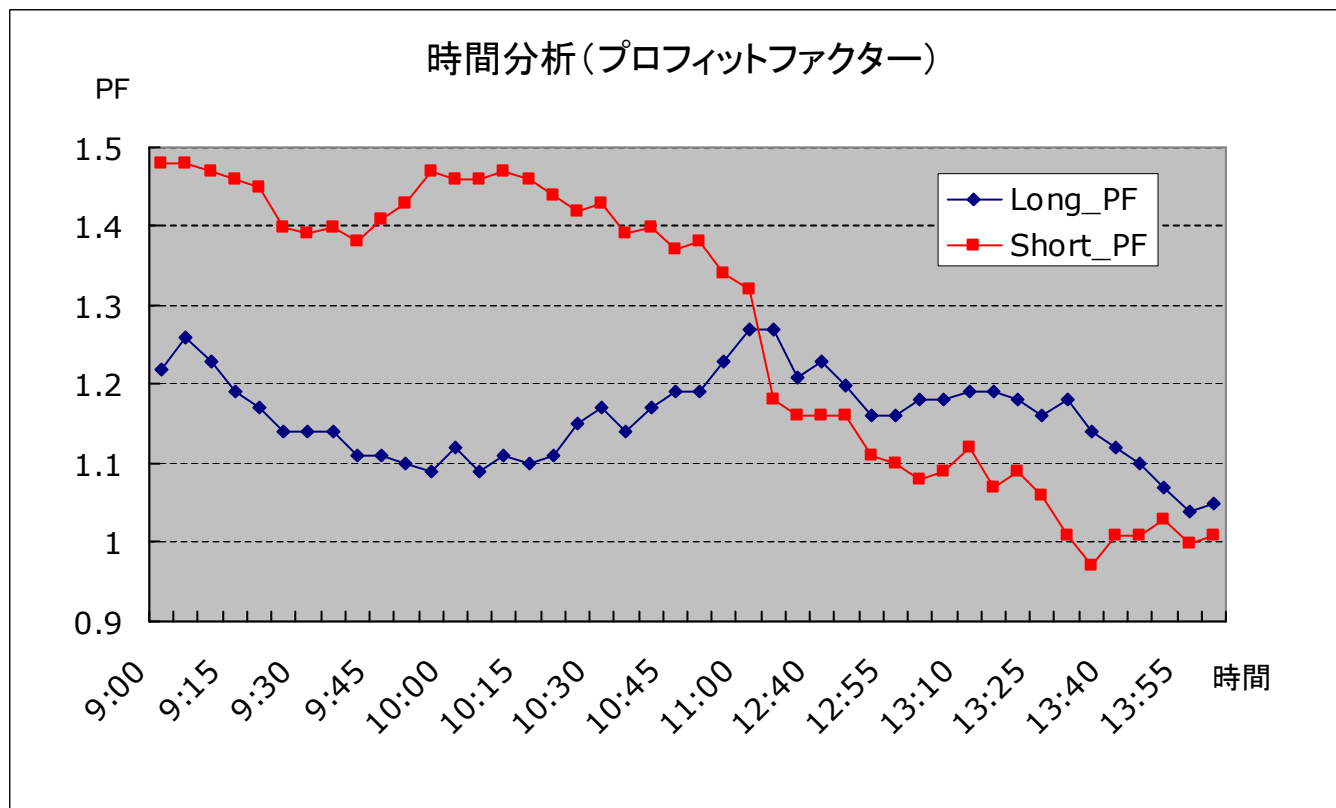


エントリーの時間検証

■ エントリー時間は、本当に寄付きが良いのか？

⇒ エントリー時間を9時から14時まで5分おきに検証(日経225先物)

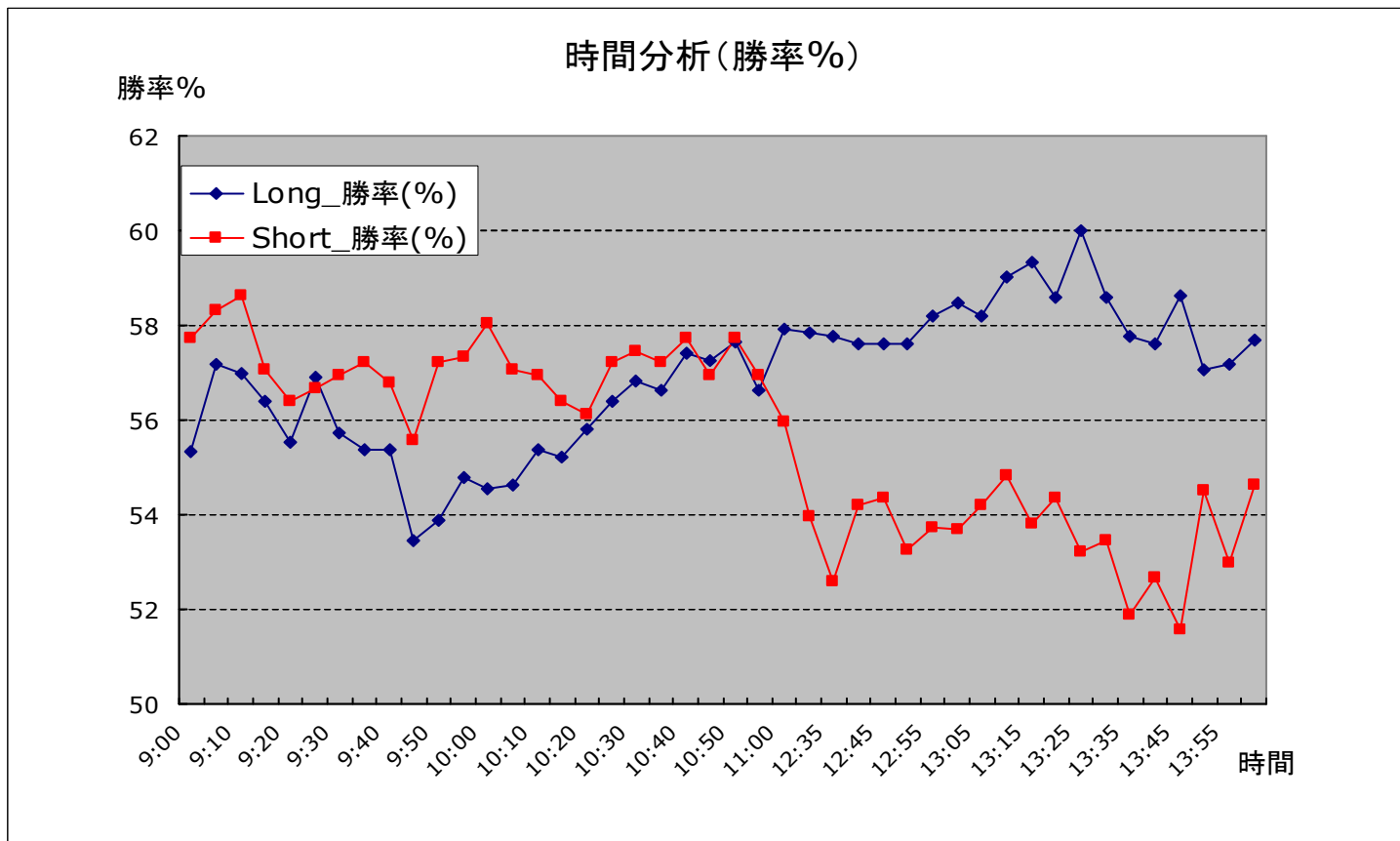
※ 売買手法はNYダウ逆張り(大引けで決済)





エントリーの時間検証

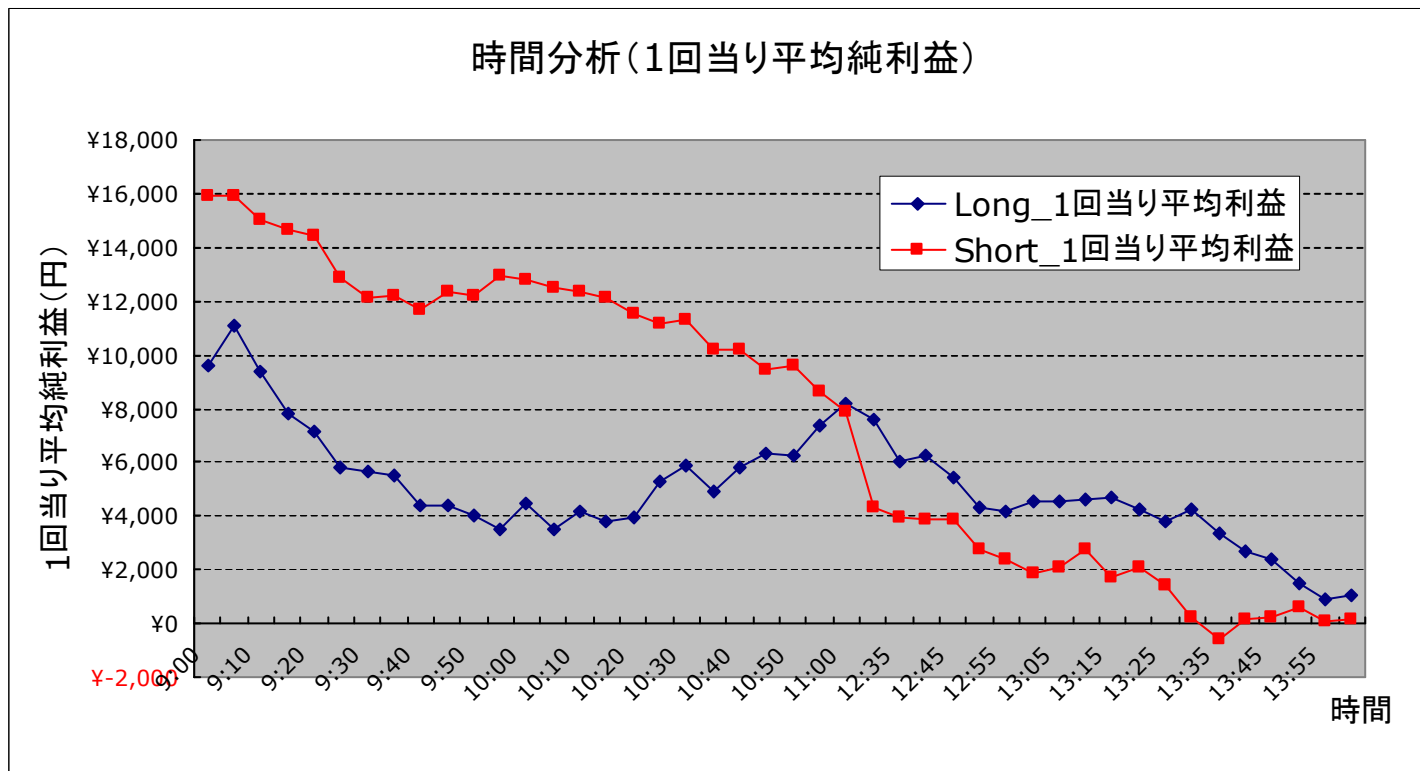
- エントリー時間は、本当に寄付きが良いのか？
⇒ エントリー時間を9時から14時まで5分おきに検証





エントリーの時間検証

- エントリー時間は、本当に寄付きが良いのか？
⇒ エントリー時間を9時から14時まで5分おきに検証

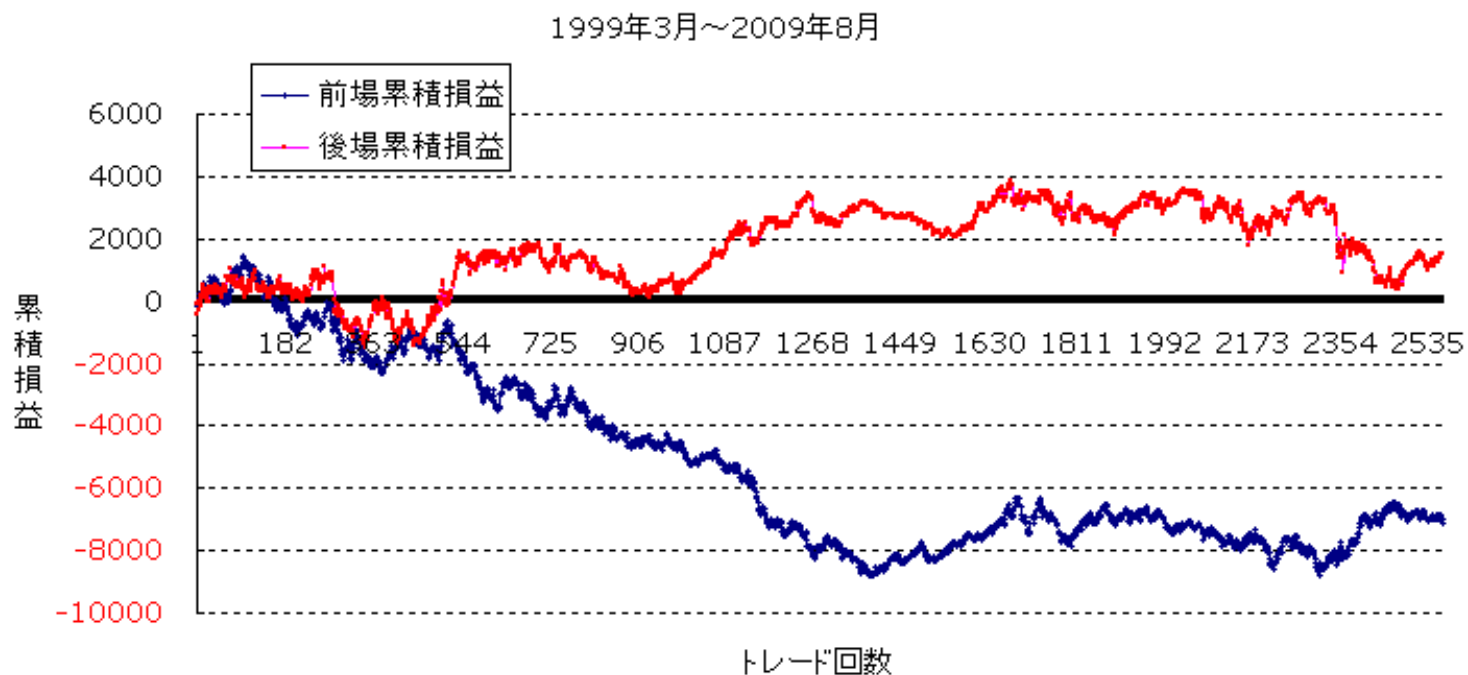




日経225先物の後場検証

■前場・後場の特徴

前場・後場の始値で買い、それぞれ前場・後場の引けで決済した場合の累積損益



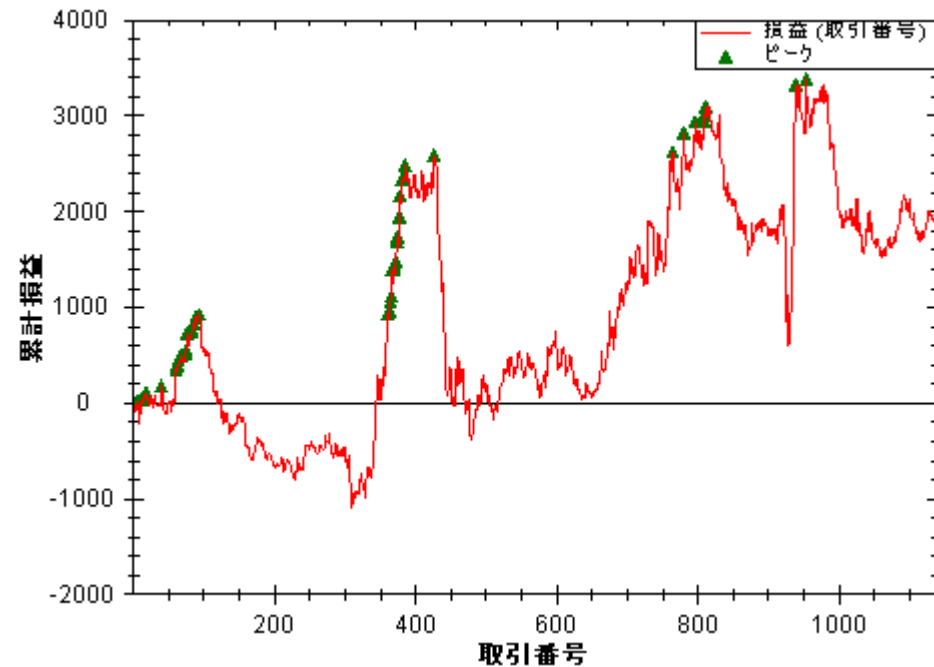


日経225先物の後場検証

■ 後場動向の検証

後場始値が前場終値よりも高いときロング、低いときショート

	買いトレード	売りトレード
累計損益	2050.00	(80.00)
総利益	19900.00	19890.00
総損失	(17850.00)	(19970.00)
プロフィット・ファクター	1.11	1.00



注) 2004年は1月1日～2009年10月14日まで。
エントリーは12時30分、エグジットは15時10分時点

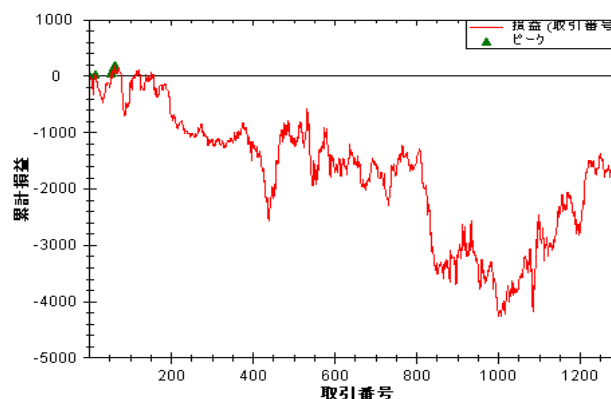


日経225先物の後場検証

■前場動向の検証

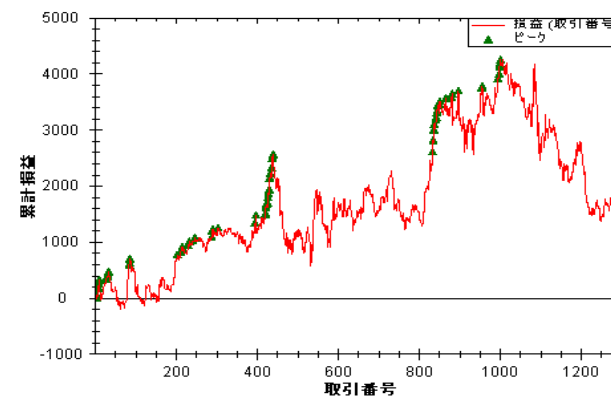
前場終値が前場始値よりも低いときロング、高いときショート

	買いトレード	売りトレード
累計損益	(2240.00)	700.00
総利益	21460.00	21500.00
総損失	(23700.00)	(20800.00)
プロフィット・ファクター	0.91	1.03



前場終値が前場始値よりも高いときロング、低いときショート

	買いトレード	売りトレード
累計損益	(700.00)	2240.00
総利益	20800.00	23700.00
総損失	(21500.00)	(21460.00)
プロフィット・ファクター	0.97	1.10



注) 2004年は1月1日～2009年10月14日まで。
 エントリーは12時30分、エグジットは15時10分時点

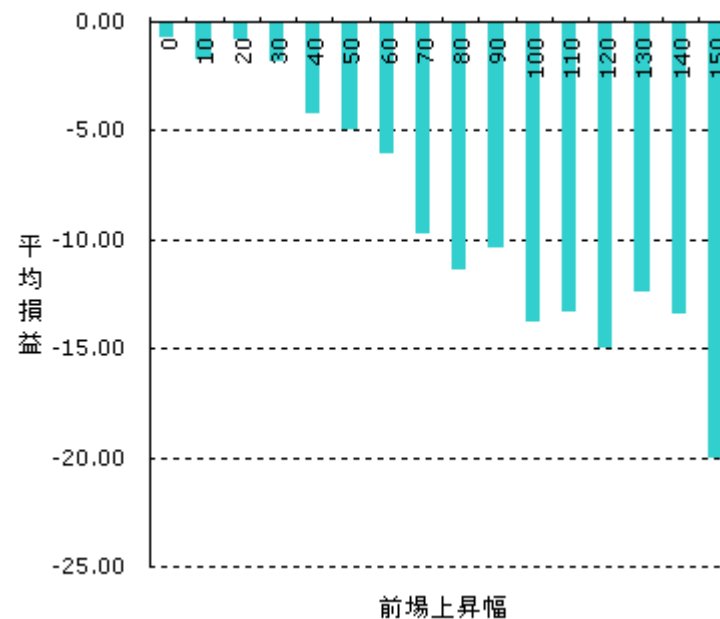


日経225先物の後場検証

■前場動向の検証

前場終値が前場始値よりも●円以上高いときロング

前場上昇幅	PF	日中最大DD	勝率	総トレード回数	平均損益
0	0.98	-3890	47.46	1321	-0.67
10	0.96	-3710	47.38	1182	-1.67
20	0.98	-3140	47.45	1039	-0.74
30	0.96	-3500	47.46	904	-1.70
40	0.90	-4580	46.99	781	-4.17
50	0.89	-4600	46.39	679	-4.83
60	0.87	-4470	46.14	596	-5.97
70	0.80	-5640	44.91	521	-9.69
80	0.78	-6050	44.76	458	-11.27
90	0.80	-4770	44.99	389	-10.31
100	0.74	-5050	43.64	330	-13.70
110	0.76	-4350	45.14	288	-13.26
120	0.74	-4080	44.17	240	-14.92
130	0.79	-3460	44.76	210	-12.29
140	0.79	-3200	44.31	167	-13.29
150	0.71	-3490	44.03	134	-19.93



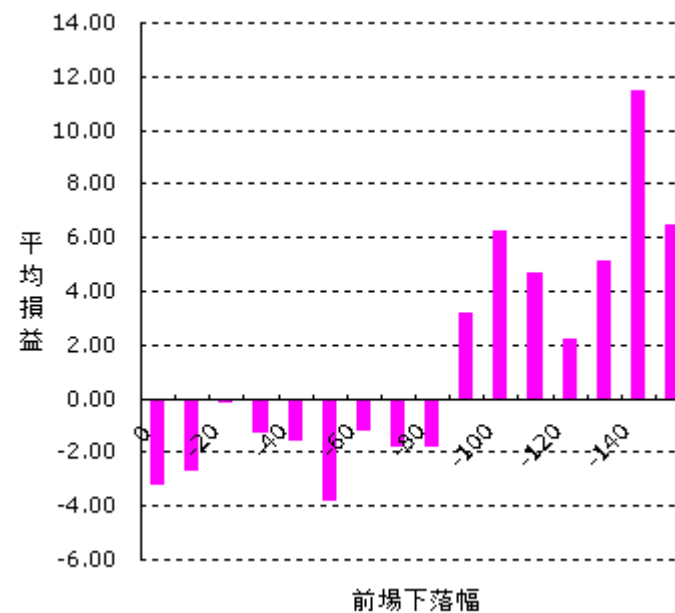


日経225先物の後場検証

■前場動向の検証

前場終値が前場始値よりも●円以上低いときショート

前場下落幅	PF	日中最大DD	勝率	総トレード回数	平均損益
0	0.92	-6620	45.10	1408	-3.15
-10	0.93	-6690	45.07	1269	-2.63
-20	1.00	-4480	46.52	1135	-0.12
-30	0.97	-3790	45.77	1005	-1.19
-40	0.96	-3420	44.96	883	-1.53
-50	0.91	-4700	43.53	765	-3.76
-60	0.97	-3270	44.89	666	-1.19
-70	0.96	-3650	44.85	573	-1.71
-80	0.96	-3220	44.87	497	-1.73
-90	1.08	-1930	46.37	427	3.19
-100	1.16	-1760	48.85	348	6.24
-110	1.11	-2040	49.83	287	4.70
-120	1.05	-2510	50.84	238	2.18
-130	1.12	-2040	50.26	191	5.13
-140	1.29	-1530	51.30	154	11.43
-150	1.16	-1590	50.00	126	6.43



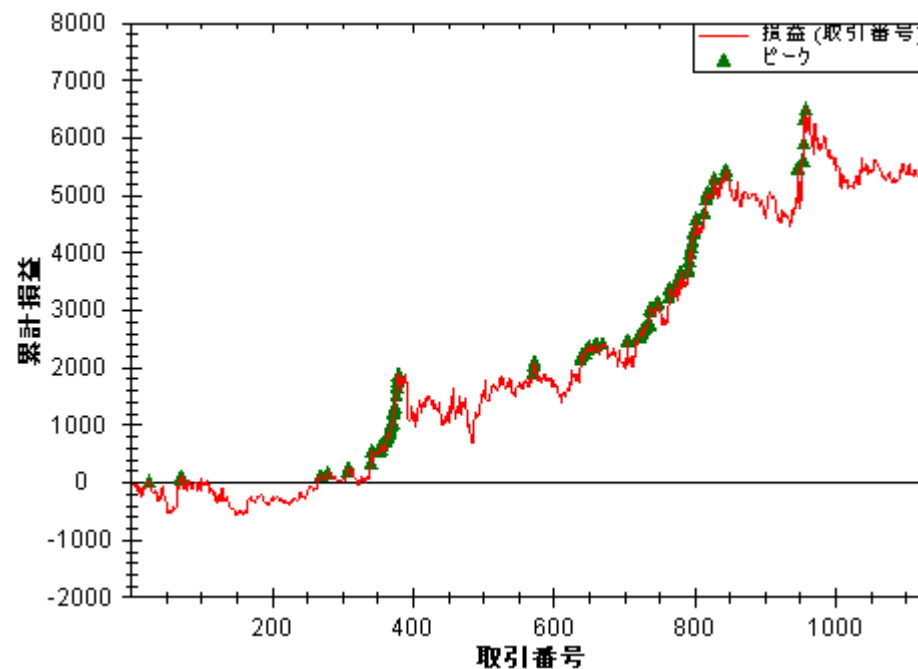


日経225先物の後場検証

■後場ブレイクアウト

前場レンジ(前場高値－前場安値)をブレイクアウトしてきた方向にトレード

	買いトレード	売りトレード
累計損益	1200.00	3770.00
総利益	17780.00	20720.00
総損失	(16580.00)	(16950.00)
プロフィット・ファクター	1.07	1.22
未確定損益	0.00	0.00
総トレード回数	553	587
勝率	46.65%	46.85%



注)2004年は1月1日～2009年10月14日まで。

エントリーは12時35分以降14時15分、エグジットは15時10分時点。

また、トレード回数は1日1回までとする。

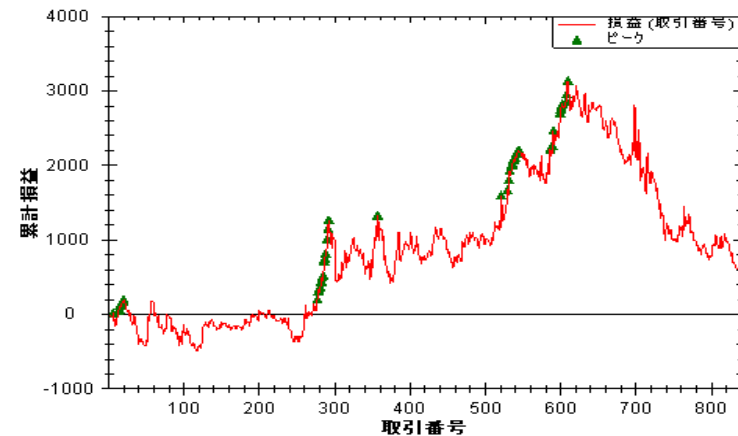


日経225先物の後場検証

■後場ブレイクアウト

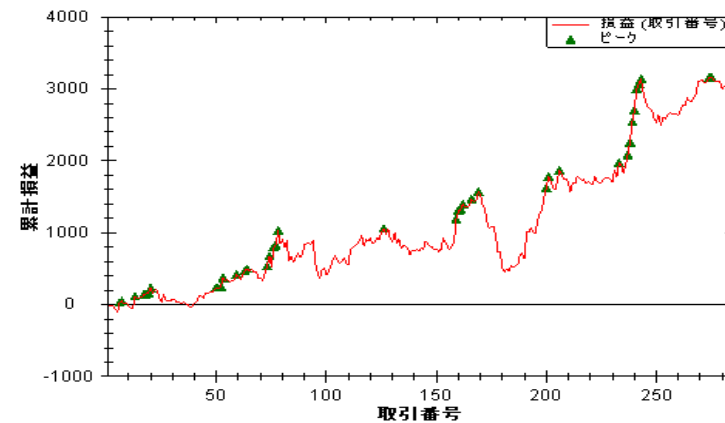
前場(前場終値－前場始値)上昇の場合ロング、前場下落の場合ショート

	買いトレード	売りトレード
累計損益	(1810.00)	2460.00
総利益	11620.00	15250.00
総損失	(13430.00)	(12790.00)
プロフィット・ファクター	0.87	1.19
未確定損益	0.00	0.00
総トレード回数	412	428
勝率	44.17%	46.03%



前場下落の場合ロング、前場上昇の場合ショート

	買いトレード	売りトレード
累計損益	1960.00	990.00
総利益	5240.00	5630.00
総損失	(3280.00)	(4640.00)
プロフィット・ファクター	1.60	1.21
未確定損益	0.00	0.00
総トレード回数	132	153
勝率	56.06%	47.06%



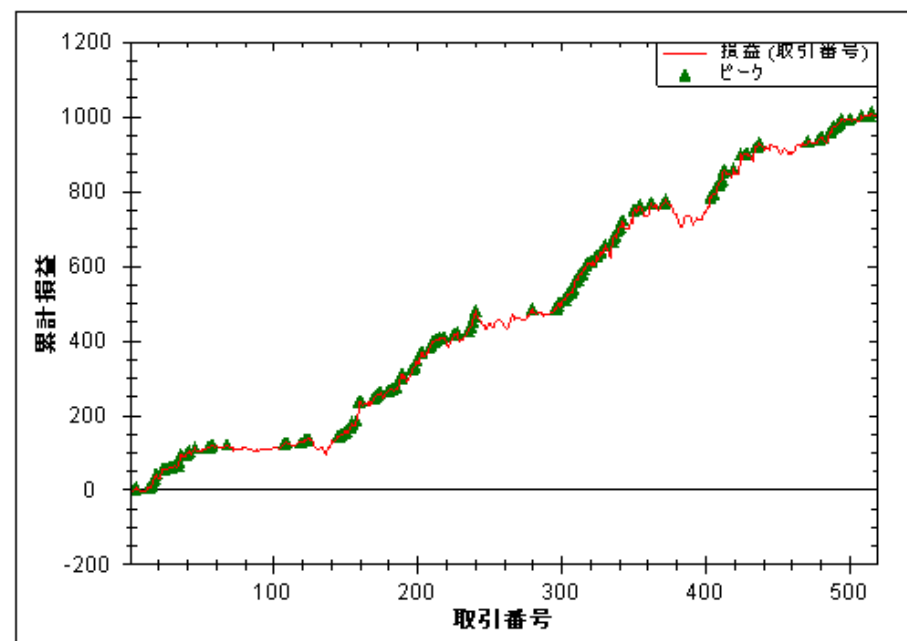


東大後場トレのパフォーマンス(TOPIX先物)

(データ期間は2004年3月1日から2009年8月31日)

※ ただし、手数料、スリッページは含まない。

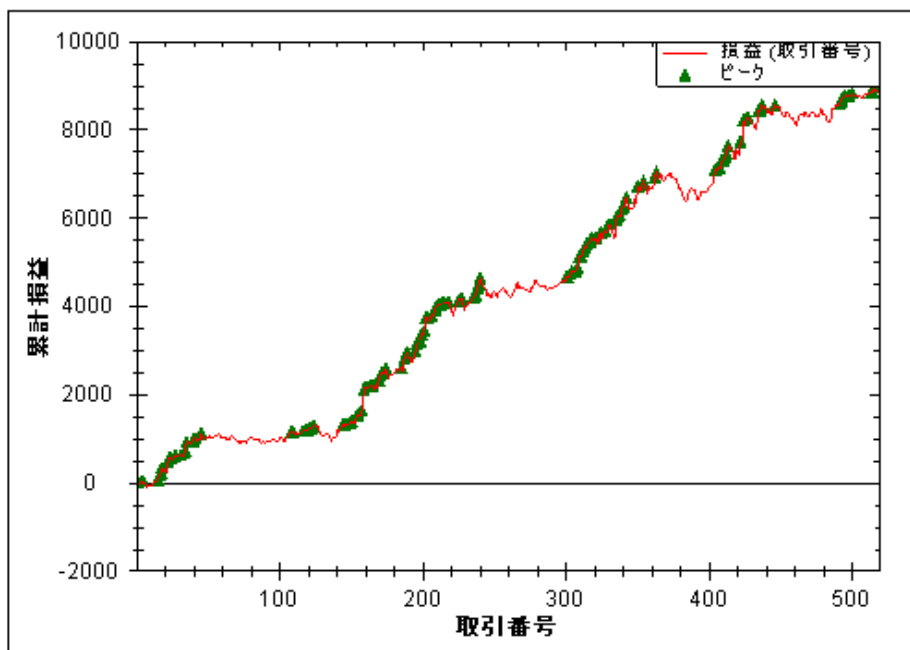
	すべてのトレード	買いトレード	売りトレード
累計損益	1009.00	372.50	636.50
総利益	2115.50	940.00	1175.50
総損失	(1106.50)	(567.50)	(539.00)
プロフィット・ファクター	1.91	1.66	2.18
最大日中ドロダウン	(81.00)	(58.50)	(49.50)
総トレード回数	519	232	287
勝率	59.54%	54.74%	63.41%
勝ちトレードの回数	309	127	182
負けトレードの回数	192	95	97
イーブントレードの回数	18	10	8
勝ち期間	8717	3586	5131
負け期間	4563	2242	2321
イーブン期間	517	287	230
平均損益	1.94	1.61	2.22
平均利益	6.85	7.40	6.46
平均損失	(5.76)	(5.97)	(5.56)
平均損益率	1.19	1.24	1.16





東大後場トレで225先物(ラージ)を取引した場合

	すべてのトレード	買いトレード	売りトレード
累計損益	8910.00	3200.00	5710.00
総利益	20350.00	9040.00	11310.00
総損失	(11440.00)	(5840.00)	(5600.00)
プロフィット・ファクター	1.78	1.55	2.02
最大日中ドロウダウン	(770.00)	(580.00)	(610.00)
総トレード回数	519	231	288
勝率	52.99%	49.35%	55.90%
勝ちトレードの回数	275	114	161
負けトレードの回数	196	97	99
イーブントレードの回数	48	20	28
勝ち期間	7974	3306	4668
負け期間	4554	2220	2334
イーブン期間	1199	514	685
平均損益	17.17	13.85	19.83
平均利益	74.00	79.30	70.25
平均損失	(58.37)	(60.21)	(56.57)
平均損益率	1.27	1.32	1.24





システム・ポートフォリオのデータ

	期待値	標準偏差	シャープレシオ
川崎長り職人	136	291	0.47
逆張り職人	177	293	0.60
東大マスター日経	187	315	0.59
STC	148	456	0.32
BigBlue2	73	350	0.21
225マイスター	227	446	0.51
アールズロード	202	411	0.49
Top IX	280	491	0.57
東大後場トレTOPIX	212	313	0.68

相関係数	川崎長り職人	逆張り職人	東大M日経	STC	BigBlue2	225マイスター	アールズロード	Top IX	東大後場トレTOPIX
川崎長り職人		(0.2415)	(0.0460)	0.0556	0.1980	(0.2059)	0.1708	0.5054	(0.1443)
逆張り職人			0.2610	0.3476	0.0418	0.5354	0.1746	0.0709	0.6072
東大マスター日経				0.2487	0.2238	0.5267	0.5344	0.0088	0.0752
STC					0.1857	0.3760	0.3489	(0.1288)	(0.0891)
BigBlue2						0.1489	0.3661	(0.0382)	(0.1622)
225マイスター							0.3389	(0.1648)	0.4410
アールズロード								0.0409	0.2335
Top IX									0.2034
東大後場トレTOPIX									



■■■■東大後場トレ公開セミナーの詳細■■■■

■セミナー概要

- セミナータイトル:「東大後場トレ」公開セミナー
- 開催日時:2009年11月14日(土) 午前9時~正午
- 会場:ビジョンセンター秋葉原 オークプラザ2F [会場までの地図はこちら](#)
- 価格:99,000円(税込)
- 募集定員:25名(予定)
- 配布物:「東大後場トレ」システムファイル(CD-ROM)、セミナー資料、設定マニュアル
- 主催:West Village Investment 株式会社

■セミナー内容

- 日経225先物市場、TOPIX先物市場の特徴と傾向の分析
- システムロジックの紹介
- システム開発のノウハウ ~ご自身のシステム開発にご活用頂けます~
- システム改良のノウハウ ~カスタマイズする方法を紹介します~

■セミナー特典

- ロジックの詳細や、システム開発・改良・ノウハウを細部に渡ってご紹介
- その場で質問やシステムのインストールが可能。すぐトレードができる状態に。
- トレードシグナル1ヵ月無料アカウント(自動発注は不可)を提供
- セミナー限定資料を配布

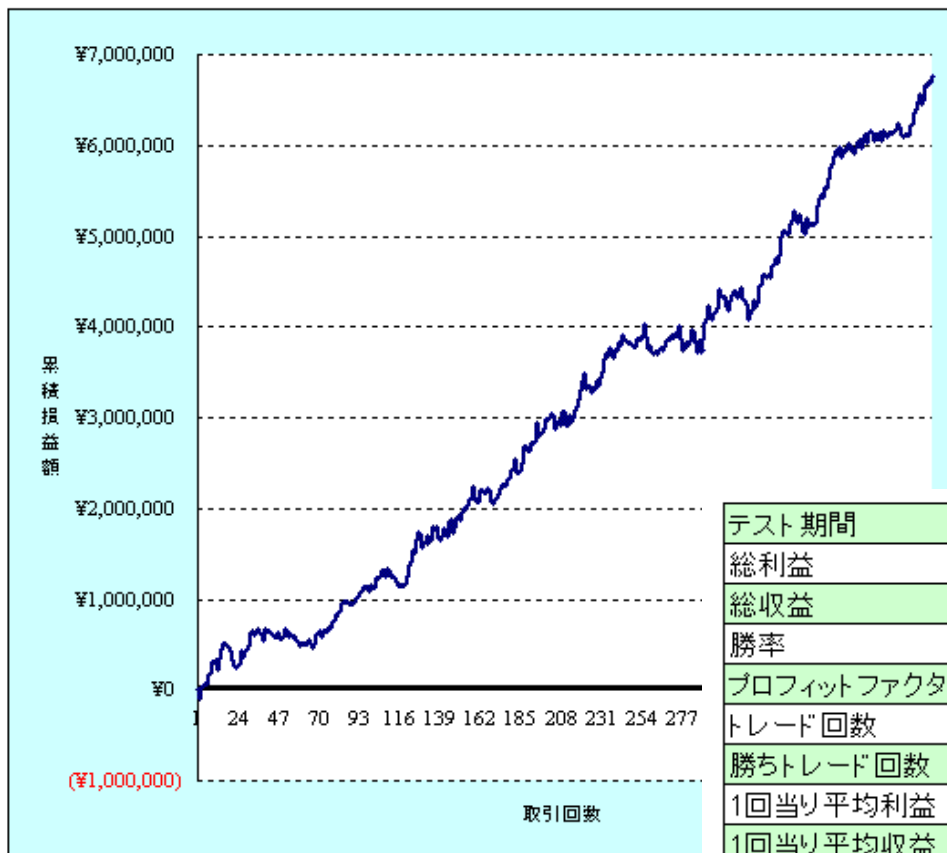
■セミナー特典その2!

★ 前場だけトレードの「前場トレ」をプレゼント!!

詳細:<http://www.wvi.jp/>



前場トレ225のパフォーマンス



テスト期間	2004年4月1日～2009年10月14日		
総利益	¥6,760,000		
総収益	¥13,870,000	総損失	(¥7,110,000)
勝率	57.28%		
プロフィットファクター	1.95		
トレード回数	240回	月平均トレード回数	7回/月
勝ちトレード回数	290回	負けトレード回数	145回
1回当り平均利益	¥16,130		
1回当り平均収益	¥57,790	1回当り平均損失	(¥49,030)
最大連勝回数	8回	最大連敗回数	6回
日中最大ドローダウン	(¥460,000)		

免責事項(ディスクレーマー)

- 本セミナーで示した手法は、その内容の正確さや完全さを保証するものではありません。
- 本セミナーで示した手法は、あくまでも参考情報であり、West Village Investment株式会社およびひまわり証券は、いかなる金融商品の売買を勧めるものではありません。
- 取引を行う際はリスクを熟知した上、完全なる自己責任において行ってください。
- West Village Investment株式会社およびひまわり証券は、本セミナーで示した手法の利用により生ずるいかなる損害の責任を負うものではありません。

免責事項(ディスクレーマー)

【仮説に基づいた運用成績に関する注意事項】

仮説に基づいた運用成績には限界があることをご承知おきください。仮説に基づいたトレーディングシステムの運用結果と、実際に売買を行った結果とその運用成績には大きな差異が生じる場合があります、仮説に基づいた運用成績通りになるわけではありません。仮説に基づいた運用成績は実際の取引で起こり得る色々なリスクを反映しておりません。例えば、評価損が発生しても許容でき耐えられるかどうか、あるいは損失を蒙ってもそのシステム通りに取引を続けていけるかなども実際の取引に大きな影響を及ぼします。この他にも、取引全般にわたってあるいは特定の売買プログラムを実行して行く上で色々な要因が作用します。これらのことが全て実際の取引結果に大きく影響を与えるため、仮説に基づいた運用成績では実際の取引結果を十分に予想できるものではありません。投資に関する最終的な決定は、ご自身の判断と責任の元で行い、すべての取引結果の責任は、すべて利用者自身に帰属することをご承知おきください。

【お取引における重要事項】

弊社でのお取引におけるお申し込みの際には、契約締結前交付書面、弊社ガイドブック、口座約款等の説明書を良くお読みいただき、仕組み、ルールや商品性を十分ご理解のうえ、お取引ください。お客様ご自身の判断と責任において行っていただきますようお願い申し上げます。詳しくはこちら

<http://sec.himawari-group.co.jp/company/policy/compliance/risk/>

免責事項(ディスクレーマー)

【現物株式、信用取引、株価指数先物取引、株価指数オプション取引における重要事項】

- 価格の変動等により損失が生じるおそれがあります。
- 信用取引、株価指数先物取引、株価指数オプション取引の場合、取引金額が保証金・証拠金の額に比べて大きいため、その損失は保証金・証拠金の額だけに限定されません。
- 現物株式、信用取引、株価指数先物取引、株価指数オプション取引の手数料においては弊社ホームページをご確認ください。
<http://sec.himawari-group.co.jp/stocks/commission-deposit/commission/>
- 信用取引の委託保証金は、売買代金の30%以上で、かつ30万円以上が必要です。
- 株価指数先物取引、株価指数オプション取引の必要証拠金においては弊社ホームページをご確認ください。

<http://sec.himawari-group.co.jp/option/commission-deposit/deposit/>

免責事項(ディスクレーマー)

【ひまわりtradesignalの注意事項】

- 「ひまわりtradesignal」(以下当ツールと言う)はシステムトレード(運用ルールに基づいてコンピューター・システムなどにより機械的に行う売買をいう)の手法を構築・検証することや、ご自身が設定した自動売買を行うことに利用できるツールです。
- 当ツールは、上記に示したツールとしての利用提供を目的としており、金融商品の投資勧誘を目的としたものではなく、又将来の運用利益を保証するものではありません。投資の最終決定は、ご自身の判断でお願いいたします。
- 当ツールは、ひまわり証券が正確性・確実性を期すように努めておりますが、完全性を保証するものではありません。
(また、予告なしに情報・内容を変更することがありますのでご注意ください。)
- 当ツールの利用によって生じた損害(パソコンやネットワークに生じた損害を含み、損害の種類を問わない)やその修理費用等に関して、ひまわり証券は一切の責任を負いませんのでご了承ください。

免責事項(ディスクレーム)

◆相場状況・分析等の投資情報、アナリストレポート又は関連する記載内容について

相場状況・分析等の投資情報、アナリストレポート又は、関連する記載内容は投資判断の参考となる情報の提供を目的としており、投資勧誘を目的としたものではありません。投資の最終決定は、ご自身の判断でお願いいたします。

相場状況・分析等の投資情報、アナリストレポート又は、関連する記載内容は、ひまわり証券が正確性、確実性を保証するものではありません。
(また、予告なしに変更することがありますのでご注意ください。)

相場状況・分析等の投資情報、アナリストレポート又は、関連する記載内容によって生じたいかなる損害についても、弊社は一切の責任を負いません。

当レポートはひまわり証券のセミナー用の資料であり、その転載使用は一切認めません。

◇詳しい情報やお問い合わせは (受付時間/平日8~18時)

フリーコール : 0120-86-9686 E-mail : stc @sec.himawari-group.co.jp

ひまわり証券株式会社 関東財務局長(金商)第150号(金融商品取引業)
社団法人金融先物取引業協会、日本証券業協会