# 株式 サヤ取り実践セミナー

2017年1月21日

#### 【内容】

- ■市況解説
- ■弊社取引実績
- ■実践さや取り達人
- ■注意事項



## 格言

待つは仁 向かうは勇 利乗せは智の徳

# 日経平均(1年)



(c)Ouants Research Inc.

# 日経平均(1ケ月)

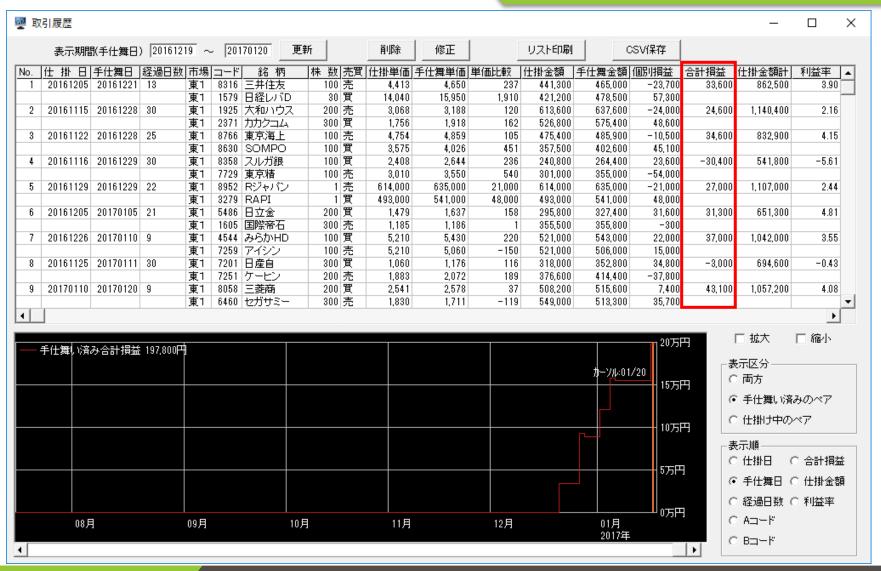


(c)Ouants Research Inc.

# 達人売買ルール

- 相関・勝数の大きいペア
- **> サヤの動きが良いペア**
- ▶ 最大かい離で仕掛ける
- ▶ 利食い:予定利益+80%
- > 損切り:予定利益-80%
- > 手仕舞い期限:30日

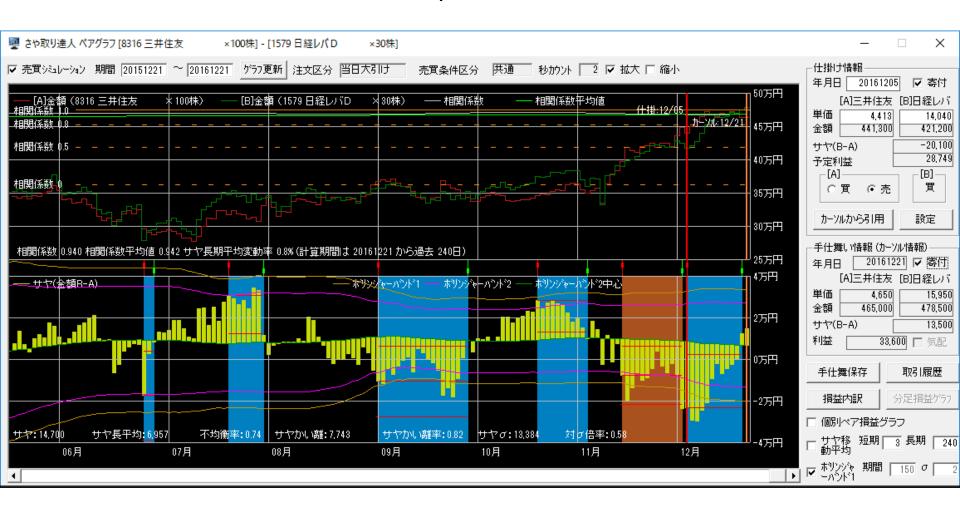
## 取引履歴(手仕舞い)



### 8316三井住友×1579日経レバ

損益+33,600円

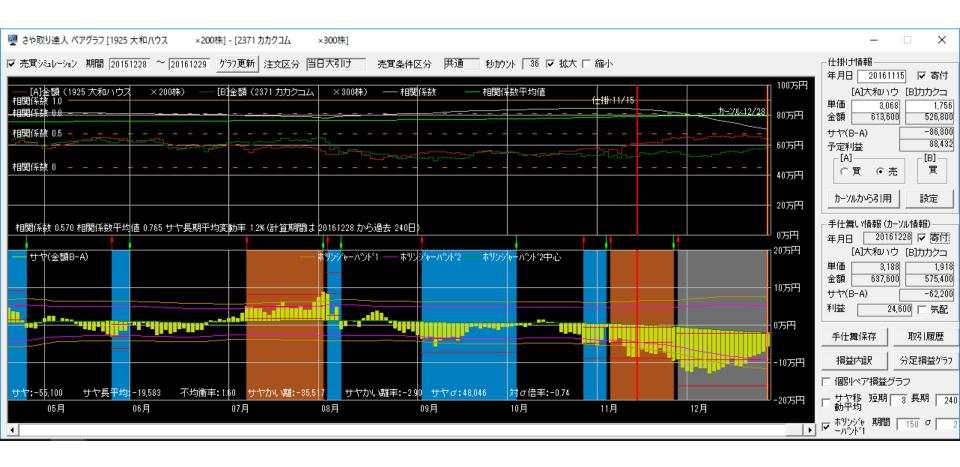
仕掛け時の相関係数0.940 サヤかい離32,697円(3.75%) 対σ倍率2.77 7勝1敗



### 1925大和ハウ×2371カカクコ

損益+24,600円

仕掛け時の相関係数0.871 サヤかい離85,588円(7.53%) 対σ倍率2.77 9勝1敗



#### 8766東京海上×8630SOMPO

損益+34,600円

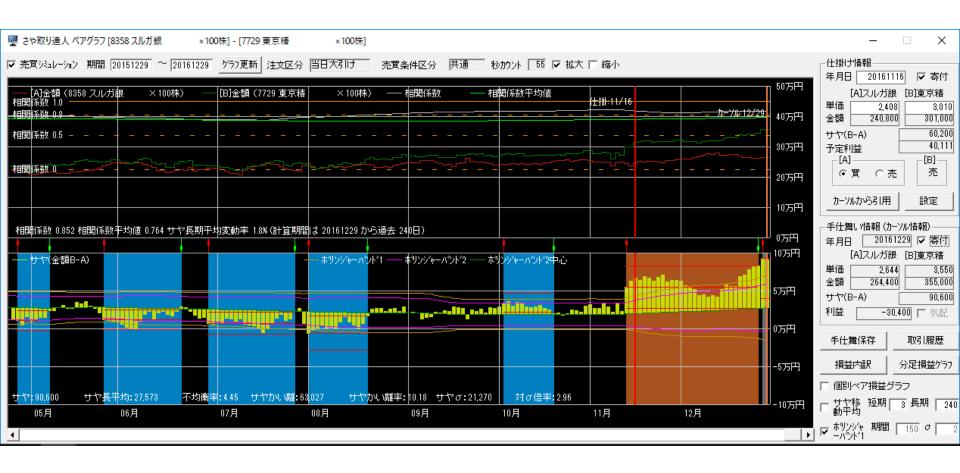
仕掛け時の相関係数0.958 サヤかい離46,011円(5.52%) 対σ倍率4.28 7勝1敗



### 8358スルガ銀×7729東京精密

損益-30,400円

仕掛け時の相関係数0.866 サヤかい離43,171円(8.04%)対σ倍率3.91 8勝0敗



#### 8592Rジャパン×3279RAPI

損益+27,000円

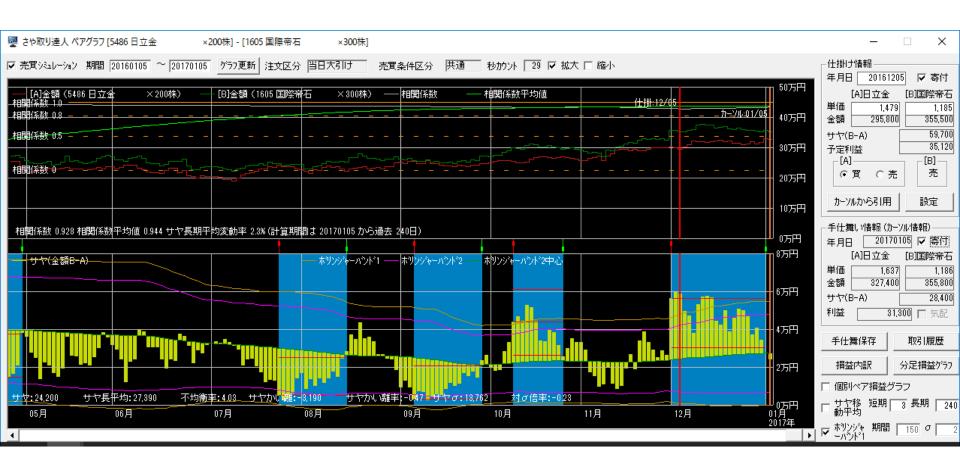
仕掛け時の相関係数0.907 サヤかい離38,597円(3.49%) 対σ倍率2.77 8勝2敗



### 5486日立金×1605国際帝石

損益+31,300円

仕掛け時の相関係数0.906 サヤかい離35,077円(5.34%) 対σ倍率3.06 7勝1敗



### 4544みらかH×7259アイシン

損益+37,000円

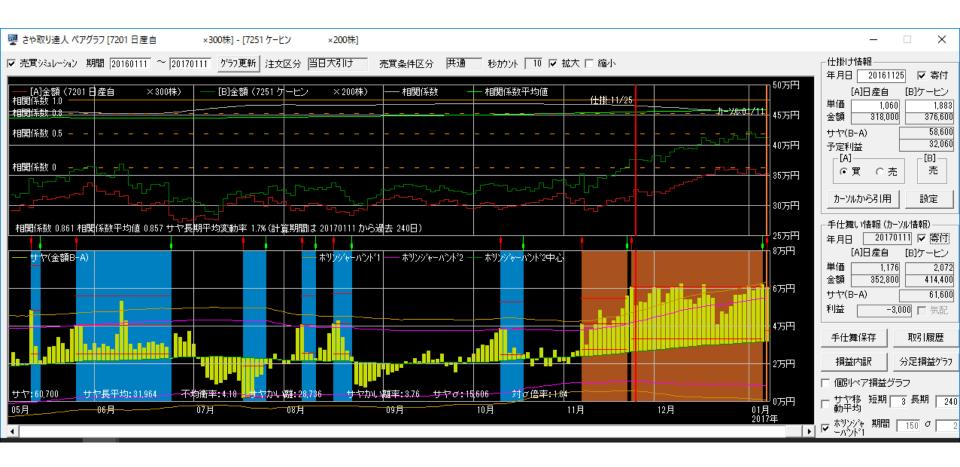
仕掛け時の相関係数0.814 サヤかい離47,987円(4.59%) 対σ倍率2.62 8勝0敗



### 7201日産自×7251ケーヒン

損益-3,000円

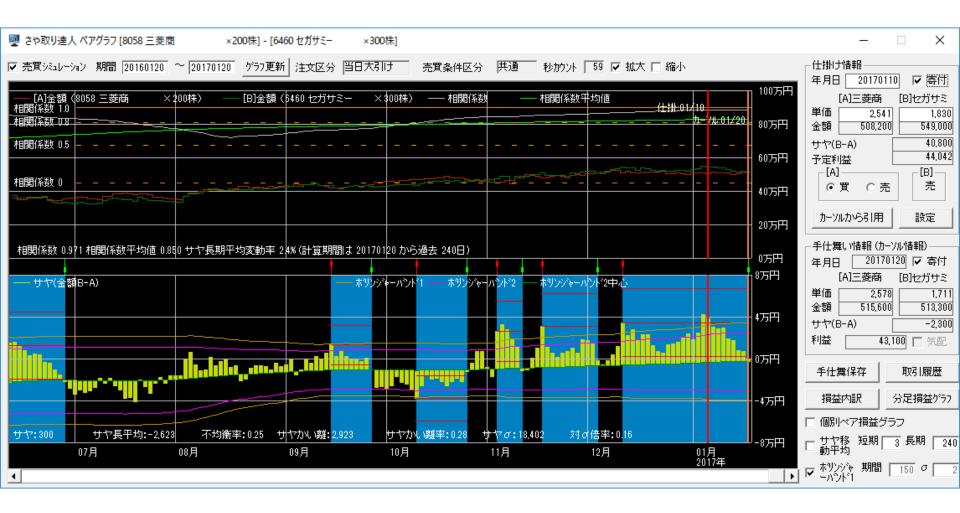
仕掛け時の相関係数0.918 サヤかい離34,486円(4.98%) 対σ倍率3.32 8勝1敗



### 8058三菱商×6460セガサミ

損益+43,100円

仕掛け時の相関係数0.966 サヤかい離45,613円(4.30%) 対σ倍率2.61 7勝0敗

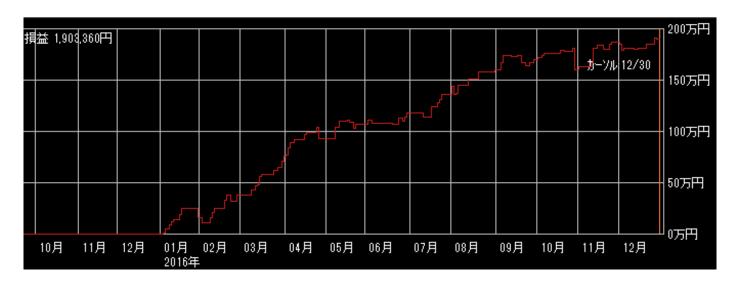


# 2016年運用実績

| 2016 | 損益                       | 損益率               | 勝敗     | 勝率    | 日数    |
|------|--------------------------|-------------------|--------|-------|-------|
| 1月   | 249,900円                 | 8.33%             | 9勝1敗   | 90.0% | 24.5日 |
| 2月   | 132,660円                 | 4.42%             | 8勝4敗   | 66.7% | 17.1日 |
| 3月   | 324,220円                 | 10.81%            | 11勝1敗  | 91.7% | 20.7日 |
| 4月   | 224,500円                 | 7.48%             | 8勝2敗   | 80.0% | 17.8日 |
| 5月   | 138,180円                 | 4.61%             | 7勝4敗   | 63.6% | 21.7日 |
| 6月   | 106,300円                 | 3.54%             | 9勝4敗   | 69.2% | 19.8日 |
| 7月   | 181,500円                 | 6.05%             | 5勝1敗   | 83.3% | 12.7日 |
| 8月   | 222,200円                 | 7.41%             | 7勝4敗   | 63.6% | 20.0日 |
| 9月   | 122,000円                 | 4.07%             | 9勝4敗   | 69.2% | 22.9日 |
| 10月  | -97,700円                 | -3.26%            | 8勝3敗   | 72.7% | 20.3日 |
| 11月  | 267,000円                 | 8.90%             | 10勝2敗  | 83.3% | 14.4日 |
| 12月  | 32,600円                  | 1.09%             | 6勝4敗   | 60.0% | 22.8日 |
| 合計   | 1,903,360円<br>(158,613円) | 63.45%<br>(5.29%) | 97勝34敗 | 74.0% | 19.6日 |

# 損益内訳

| 勝数   | 負数 | 利益         | 損          | 損益         |
|------|----|------------|------------|------------|
| 97   | 34 | 3,243,460円 | 1,340,100円 | 1,903,360円 |
| 平均利益 |    | 33,438円    | 勝率         | 75.2%      |
| 平均損  |    | 39,415円    | PF/POR     | 2.42/0.85  |
| 平均損益 | ŧ  | 14,529円    | 時給         | 47,584円    |



## 取引履歴(仕掛け中)



# ペア選定

相関係数と勝数が大きく、 サヤの動きが良いペアを選 定して下さい。

サヤ取りで一番重要なのは、 サヤに一定の開閉リズムが あることです。

# サヤの形

- ▶サヤの山と谷が規則的に多く存在 している
- ▶サヤの山と谷が揃っている
- ▶サヤ長期移動平均線を中心に上下 変動している
- ▶ボリンジャーバンドの間隔が一定 している
- ▶サヤ長期移動平均線が一定している

## 仕掛けのコツ

過去のサヤかい離を、超えた位が絶好 のタイミングです。

サヤチャートからサヤの動き(開閉周期と変動幅)を 読み取り、過去のサヤかい 離水準を考慮して、仕掛けのタイミングを計ってくだ さい。

# 手仕舞いルール

資金量・方針・性格等を考慮して 自己ルールを確立してください。

- ・利食いは予定利益の+50%~ +100%の範囲。
- ・損切りは予定利益の-50%~ -100%の範囲。
- ・手仕舞い期限は15日~40日の範囲。

どんなに素晴らしい投資法でも、「投資の掟」を守らなければ、うまく機能しません。

>売買ルールを守る

メンタルコンロールをする

>資金管理に心がける

"仕掛けは少し遅めに、手仕舞いは少し 早めに"

- 仕掛けが早く、損切りができ ないと負けパターンになります。
- 仕掛けチャンスは沢山あります ので余裕資金を持ち、エント リーのタイミングを待って焦ら ず取り組んでください。

## ルーティンワーク

毎日サヤチャートを チェックして、トレー ドセンス(感覚)を磨 いてください。