

さや取り達人実践セミナー

2016年10月22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



日経平均(1年)

日足



(c)Quants Research Inc.

日経平均(1ヶ月)

日足



(c)Quants Research Inc.

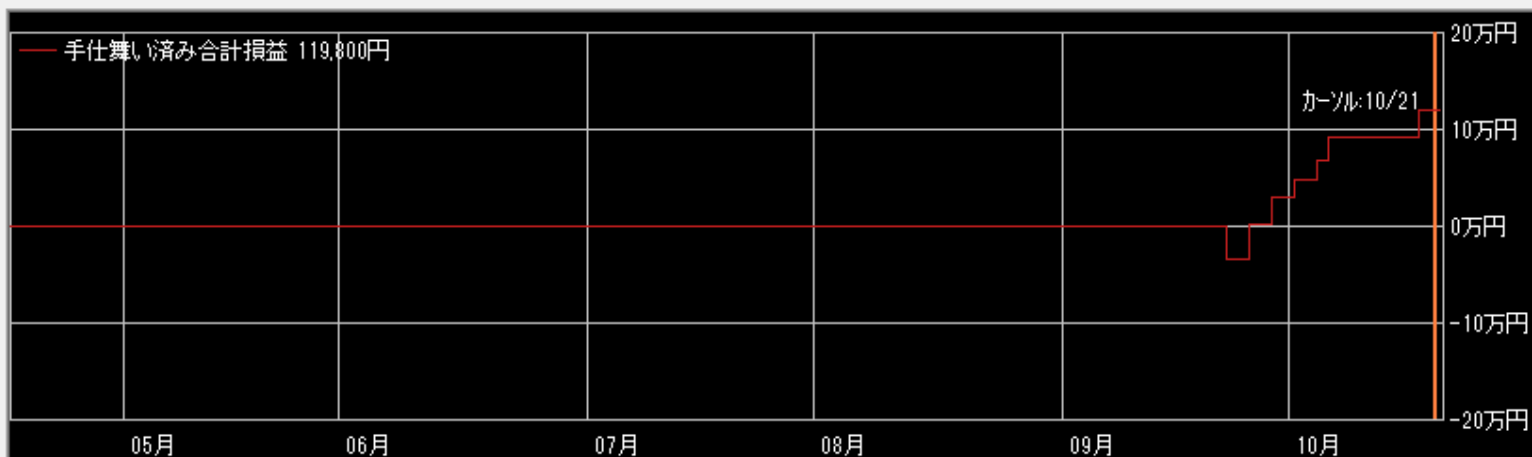
運用実績 (資金300万円 単利運用 寄成注文)

※手数料は考慮していません

取引履歴

表示期間(手仕舞日) 20160926 ~ 20161021 更新 削除 修正 リスト印刷 CSV保存

No.	仕掛日	手仕舞日	経過日数	市場	コード	銘柄	株数	売買	仕掛単価	手仕舞単価	単価比較	仕掛金額	手仕舞金額	個別損益	合計損益	仕掛金額計	利益率
1	20160812	20160926	30	東1	6305	日立建機	300	売	1,865	1,992	127	559,500	597,600	-38,100	-34,700	945,500	-3.67
				東1	6481	THK	200	買	1,930	1,947	17	386,000	389,400	3,400			
2	20160908	20160928	13	東1	8954	Rオリクス	3	売	182,500	179,000	-3,500	547,500	537,000	10,500	37,100	1,083,300	3.42
				東1	3269	RADR	2	買	267,900	281,200	13,300	535,800	562,400	26,600			
3	20160916	20160930	9	東1	8955	Rプライム	1	売	461,000	451,500	-9,500	461,000	451,500	9,500	27,200	980,000	2.78
				東1	3295	Rヒュリック	3	買	173,000	178,900	5,900	519,000	536,700	17,700			
4	20160907	20161004	18	東1	8358	スルガ銀	100	売	2,512	2,411	-101	251,200	241,100	10,100	19,300	435,400	4.43
				東1	5929	三和HD	200	買	921	967	46	184,200	193,400	9,200			
5	20160909	20161006	18	東1	8382	中国銀	200	売	1,267	1,280	13	253,400	256,000	-2,600	19,200	449,400	4.27
				東1	6395	タダノ	200	買	980	1,089	109	196,000	217,800	21,800			
6	20161003	20161007	5	東1	7205	日野自	300	買	1,086	1,100	14	325,800	330,000	4,200	24,600	643,200	3.82
				東1	8905	イオンモール	200	売	1,587	1,485	-102	317,400	297,000	20,400			
7	20160906	20161020	30	東1	7004	日立造	500	買	526	515	-11	263,000	257,500	-5,500	-16,700	522,900	-3.19
				東1	7278	エクセディ	100	売	2,599	2,711	112	259,900	271,100	-11,200			
8	20160929	20161020	15	東1	5703	日軽金HD	2,300	買	212	228	16	487,600	524,400	36,800	43,800	990,600	4.42
				東1	6856	堀場製	100	売	5,030	4,960	-70	503,000	496,000	7,000			



拡大 縮小

表示区分

- 両方
- 手仕舞い済みのペア
- 仕掛け中のペア

表示順

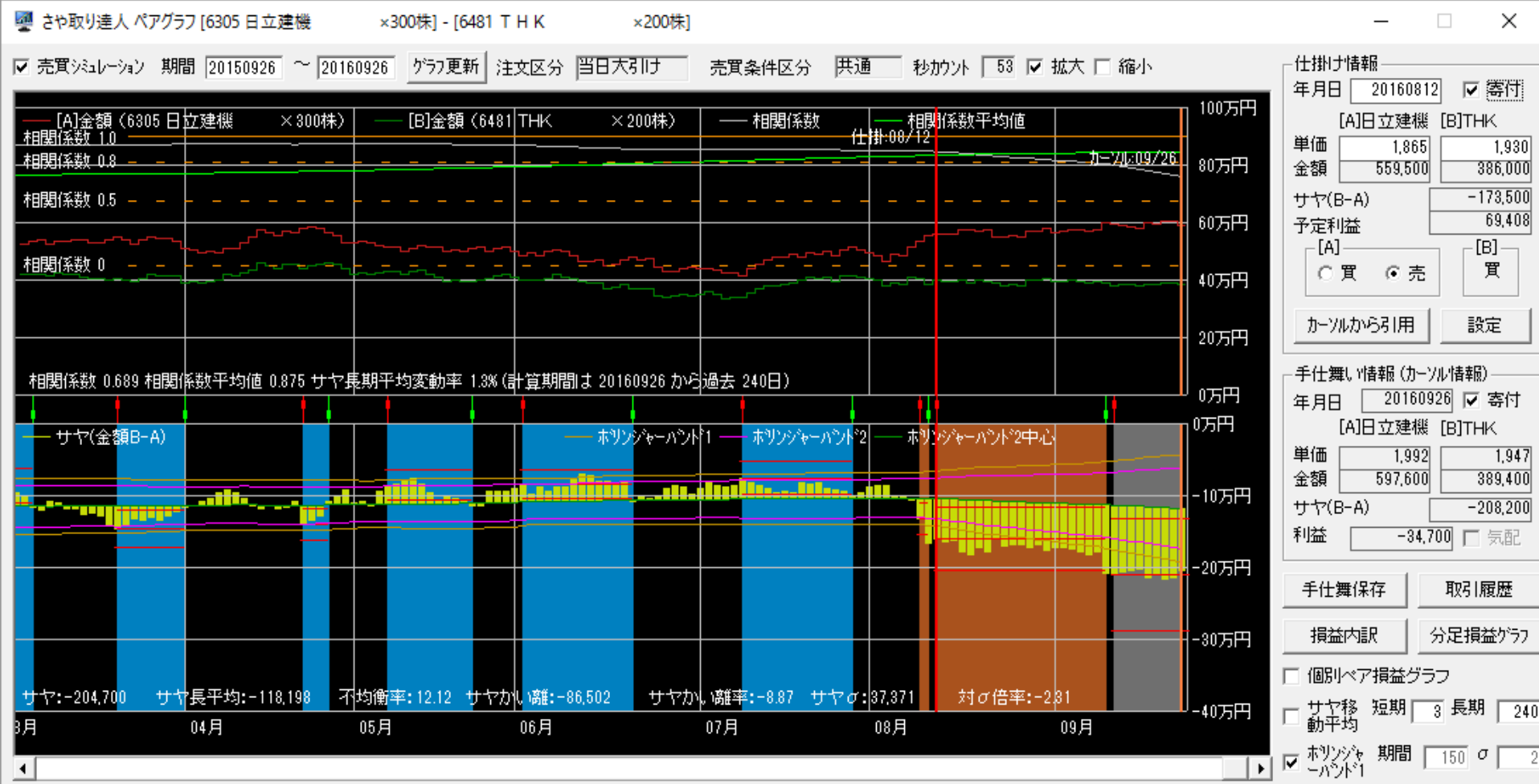
- 仕掛日
- 合計損益
- 手仕舞日
- 仕掛金額
- 経過日数
- 利益率
- Aコード
- Bコード

自己売買ルール

- 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

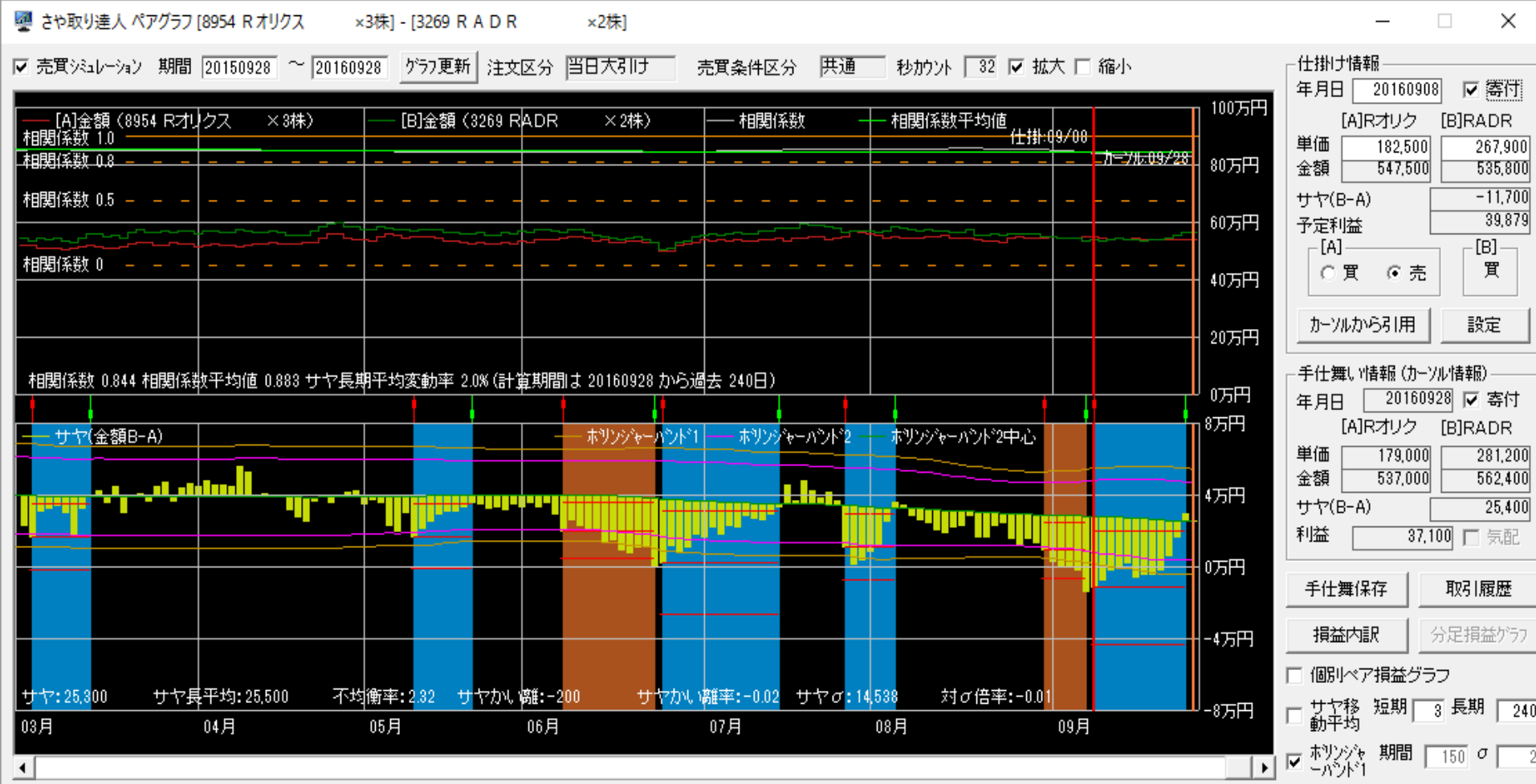
6305 日立建機 × 6481 THK

仕掛け時の相関係数:0.885 対σ倍率:3.38 12勝1敗



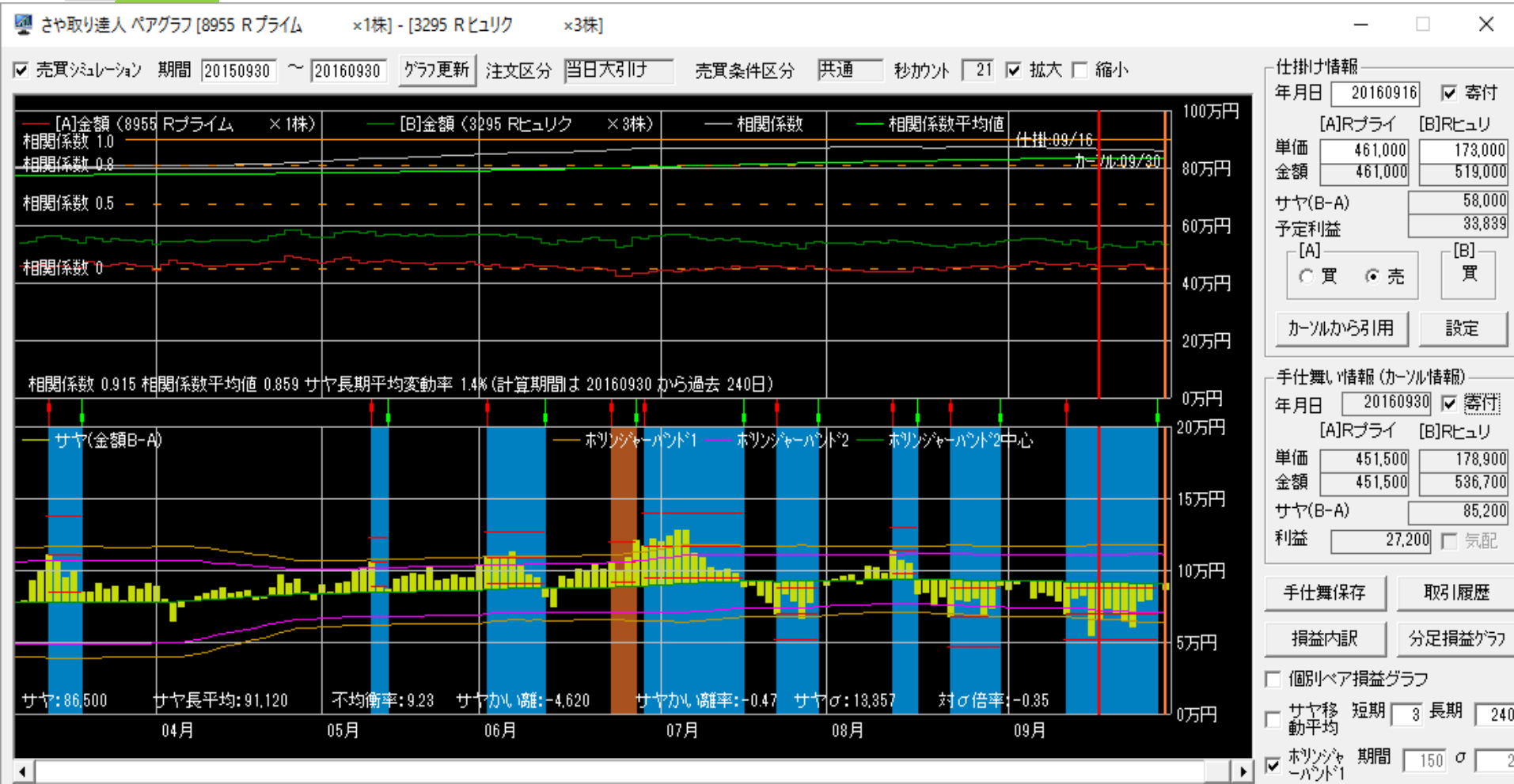
8954 Rオリクス × 3269 RADR

仕掛け時の相関係数:0.874 対σ倍率:3.20 8勝2敗



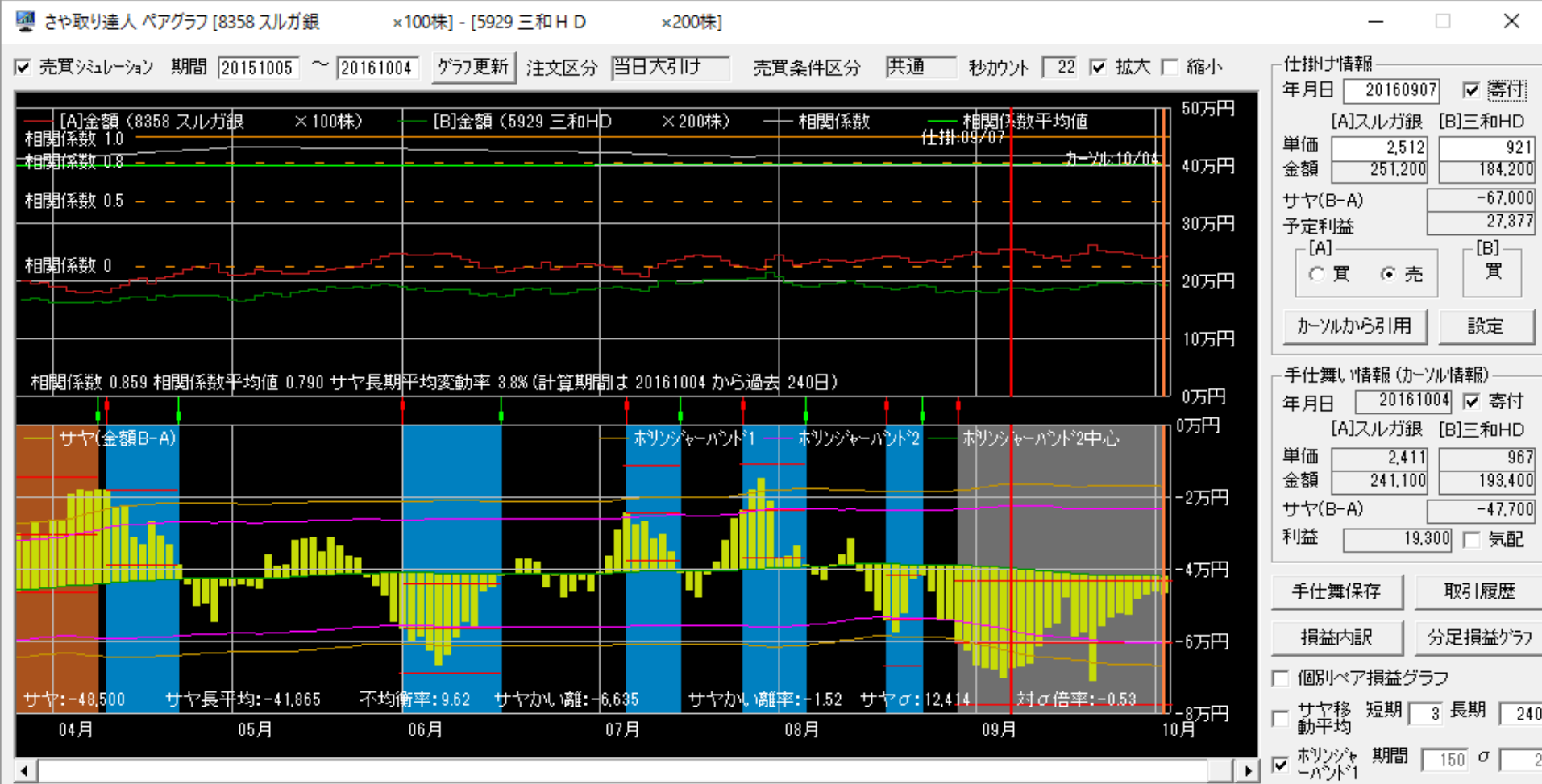
8965 Rプライム × 3295 Rヒュリック

仕掛け時の相関係数:0.921 対σ倍率:2.85 10勝1敗



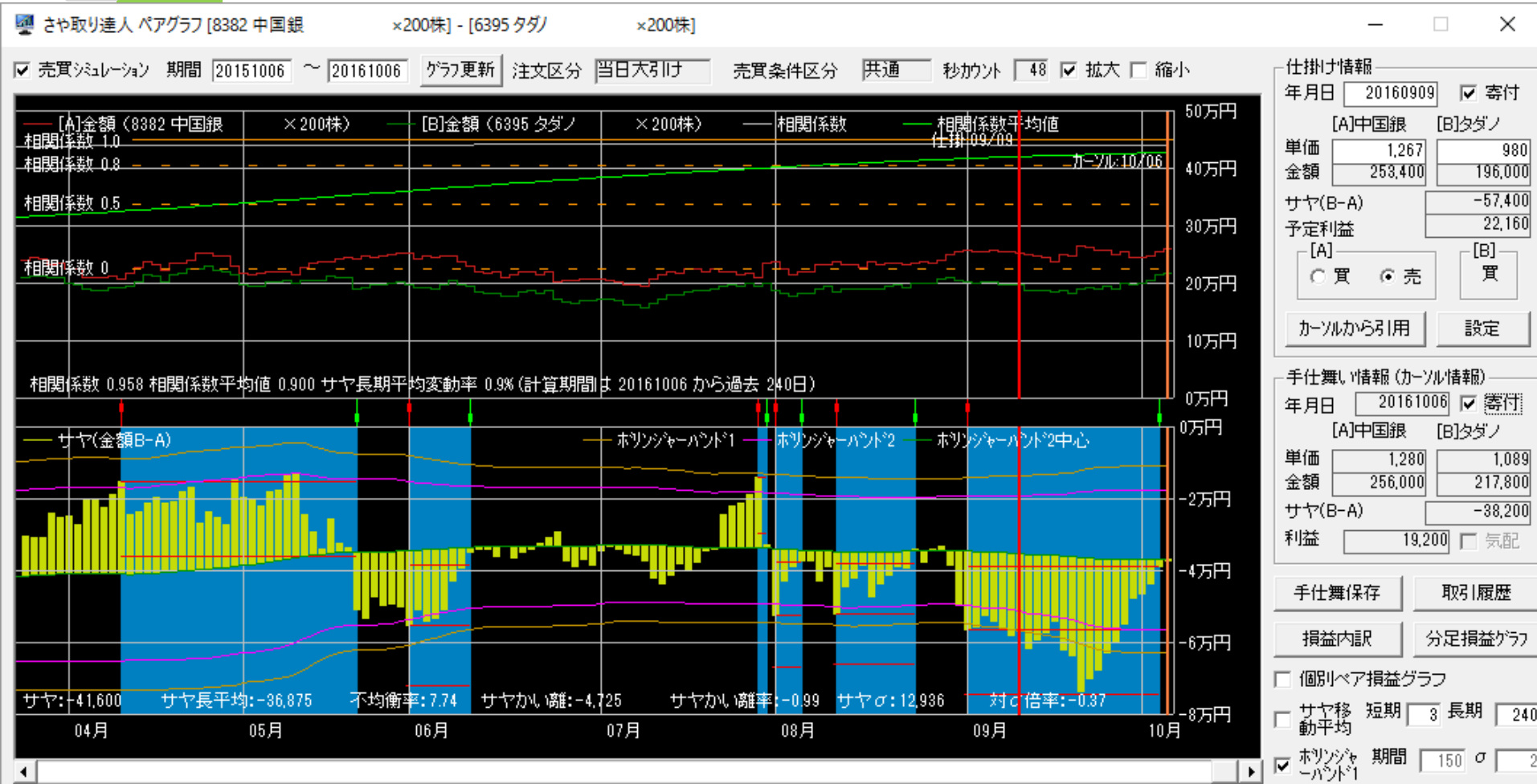
8358 スルガ銀 × 5929 三和HD

仕掛け時の相関係数:0.854 対σ倍率:2.66 9勝1敗



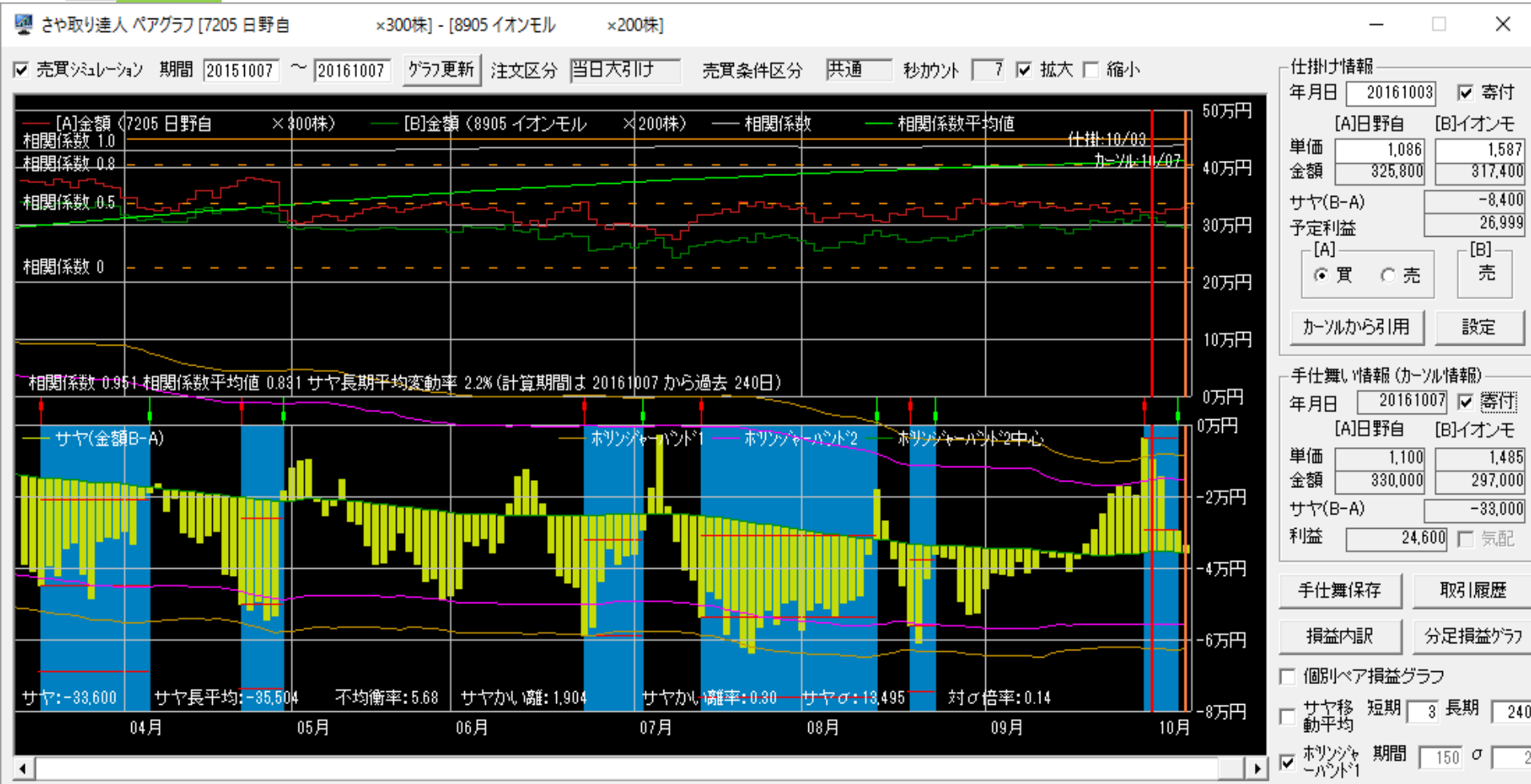
8382 中国銀 × 6395 タダノ

仕掛け時の相関係数:0.960 対σ倍率:2.18 7勝0敗



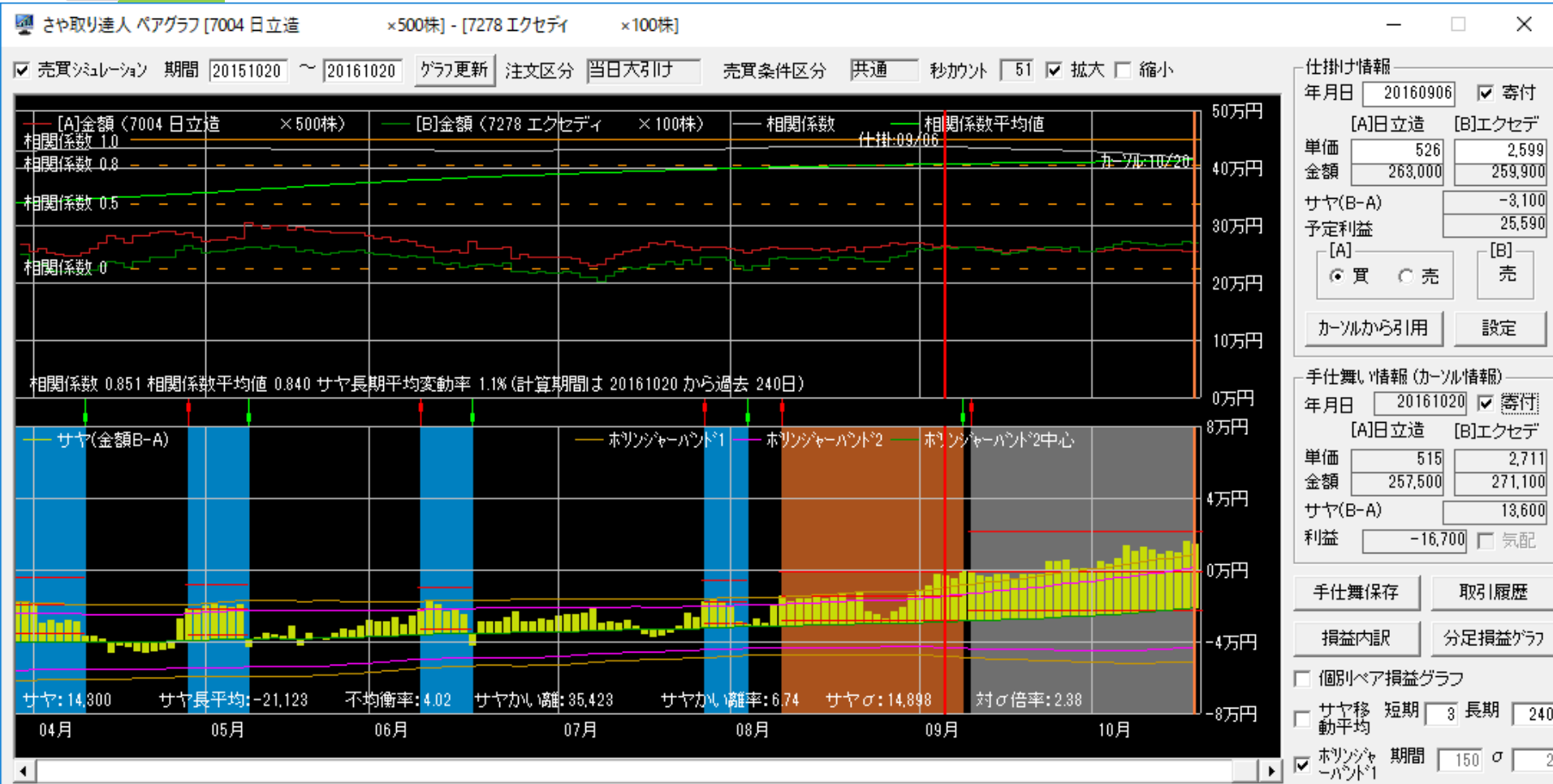
7205 日野自 × 8905 イオンモ

仕掛け時の相関係数:0.948 対σ倍率:2.38 9勝0敗



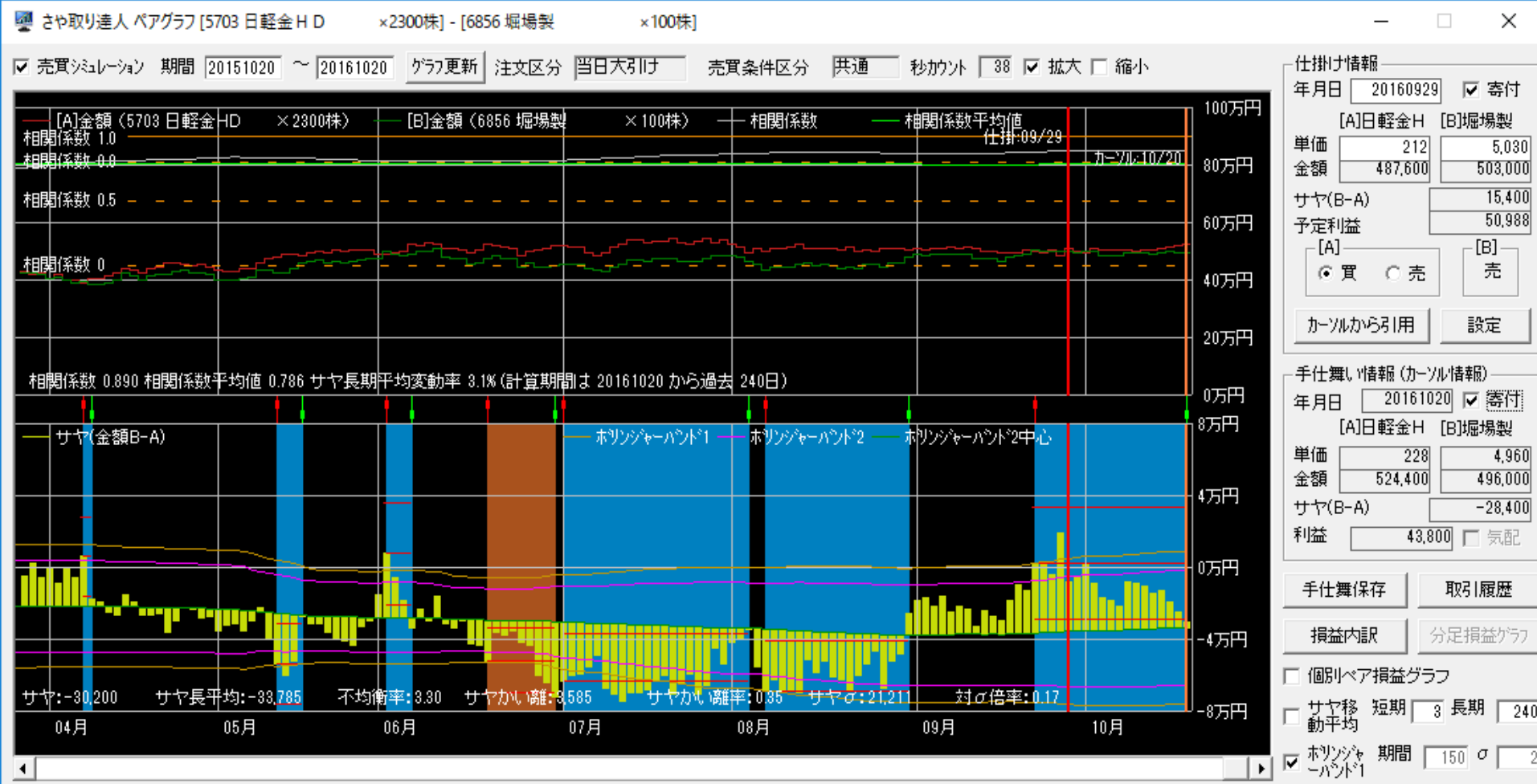
7004 日立造 × 7278 エクセディ

仕掛け時の相関係数:0.945 対σ倍率:2.81 7勝1敗



5706 日軽金 × 6856 堀場製

仕掛け時の相関係数:0.884 対σ倍率:2.70 9勝2敗



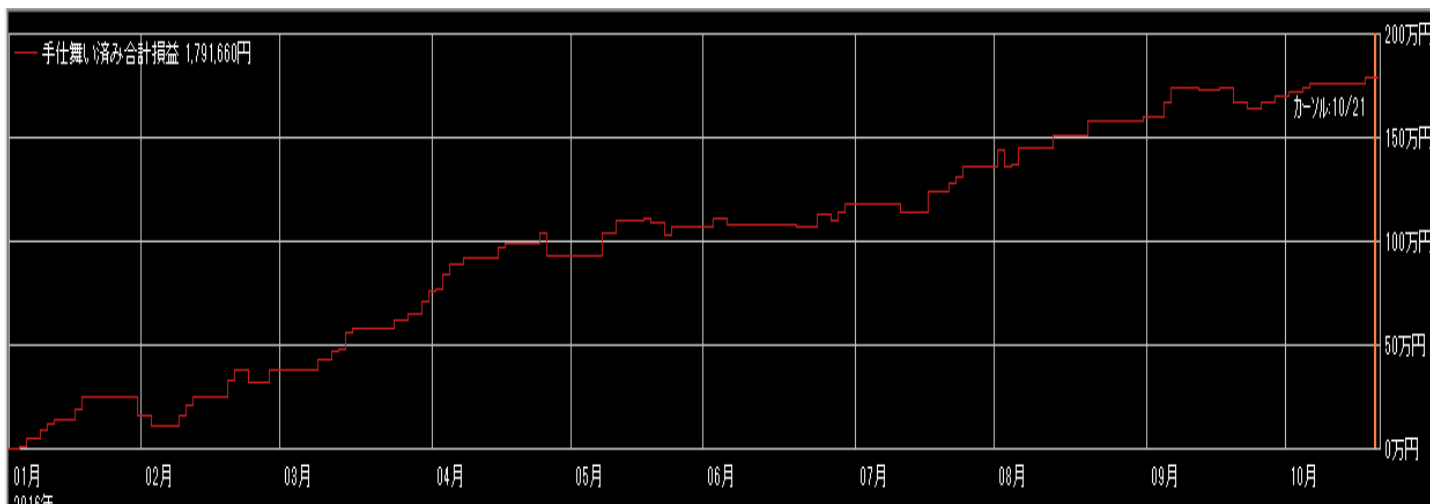
2016年運用実績

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
合計	1,701,460円 (189,051円)	56.72% (6.30%)	73勝25敗	74.5%	19.3日

損益内訳

勝数	負数	利益	損	損益
73	25	2,530,660円	829,200円	1,701,460円

平均利益	34,667円	勝率	74.5%
平均損	33,168円	PF/POR	3.05/1.05
平均損益	17,362円	時給	56,715円



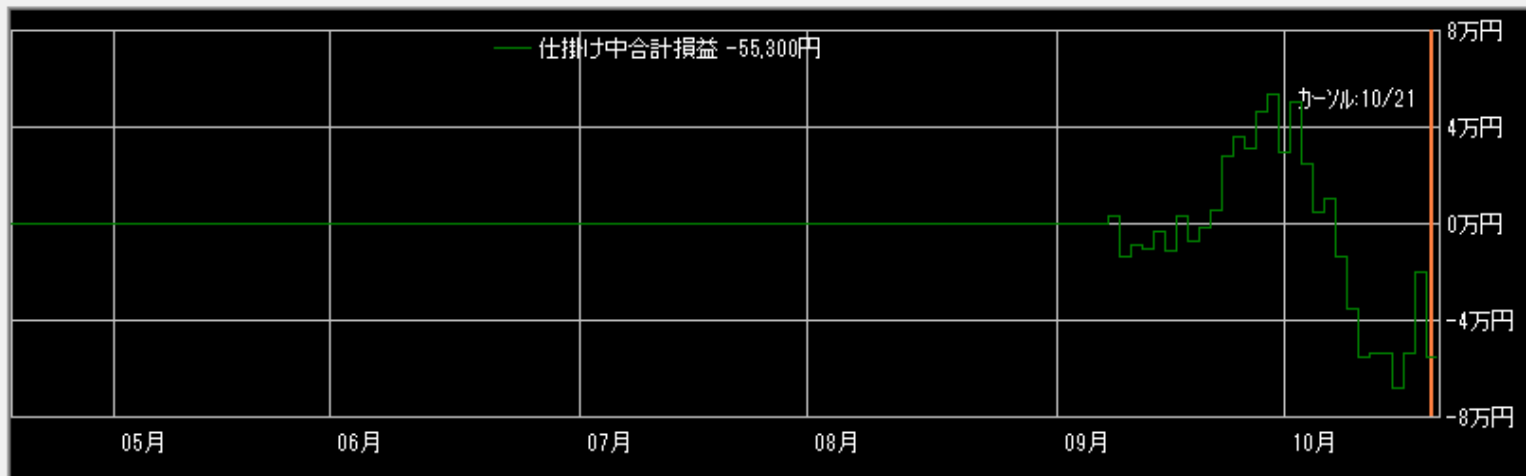
運用実績 (資金300万円 単利運用 寄成注文)

※手数料は考慮していません

取引履歴

表示期間(手仕舞日) 20160926 ~ 20161021 更新 削除 修正 リスト印刷 CSV保存

No.	仕掛日	手仕舞日	経過日数	市場	コード	銘柄	株数	売買	仕掛単価	手仕舞単価	単価比較	仕掛金額	手仕舞金額	個別損益	合計損益	仕掛金額計	利益率
1	20160908	仕掛け	29	東1	4004	昭電工	300	売	1,275	1,338	63	382,500	401,400	-18,900	-11,200	715,000	-1.57
					8593	菱UFJ	700	買	475	486	11	332,500	340,200	7,700			
2	20160915	仕掛け	24	東1	8306	三菱UFJ	600	買	500	524	24	300,000	314,400	14,400	7,200	587,600	1.23
					8750	第一生命	200	売	1,438	1,474	36	287,600	294,800	-7,200			
3	20160920	仕掛け	22	東1	7248	カルノカン	1,000	売	926	1,035	109	926,000	1,035,000	-109,000	-73,800	1,685,800	-4.38
					7270	富士重	200	買	3,799	3,975	176	759,800	795,000	35,200			
4	20160923	仕掛け	20	東1	9449	GMO	200	買	1,265	1,375	110	253,000	275,000	22,000	13,000	574,000	2.26
					4188	三菱ケミH	500	売	642	660	18	321,000	330,000	-9,000			
5	20160928	仕掛け	17	東1	4666	パーク24	200	売	3,355	3,290	-65	671,000	658,000	13,000	26,000	1,148,000	2.26
					2695	くら	100	買	4,770	4,900	130	477,000	490,000	13,000			
6	20160929	仕掛け	16	東1	2181	テンプHD	200	売	1,795	1,744	-51	359,000	348,800	10,200	14,800	628,200	2.36
					1911	住友林	200	買	1,346	1,369	23	269,200	273,800	4,600			
7	20161007	仕掛け	10	東1	2593	伊藤園	200	売	3,665	3,750	85	733,000	750,000	-17,000	-38,300	1,289,500	-2.97
					6005	三浦工	300	買	1,855	1,784	-71	556,500	535,200	-21,300			
8	20161013	仕掛け	7	東1	6395	タダノ	200	売	1,200	1,194	-6	240,000	238,800	1,200	7,000	464,800	1.51
					1568	TPLパD	20	買	11,240	11,530	290	224,800	230,600	5,800			



拡大 縮小

表示区分

- 両方
- 手仕舞い済みのペア
- 仕掛中のペア

表示順

- 仕掛日
- 合計損益
- 手仕舞日
- 仕掛金額
- 経過日数
- 利益率
- Aコード
- Bコード

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んで下さい。

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。

仕掛けのコツ

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。

毎日サヤチャートをチェックして、センス（感覚）を磨いてください。

手仕舞いルール

手仕舞いは、下記を目安に実施してください。

- 手仕舞いは、予定利益の±50%～±100%の範囲。
- 手仕舞い期限は15日～40日の範囲。

※資金量・方針・性格を考慮して自己売買ルールを確立してください。

「投資の掟」を守る

- 自分に合った期待値プラスの売買ルールを決め、一貫して守る。
- 感情(欲・恐怖・退屈等)は、トレードの最大の敵です。
メンタルルールを作り、平常心を保ちましょう。
- 利小損大にならないように資金管理に注意し、分散投資に心がける。

注意点

- 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つ焦らず取り組んでください。

決算について

決算等で、一気にサヤが閉じたり開いたりしますが結果は五分五分と考えています。

重要なのは、ルール通り仕掛け・手仕舞いを繰り返し資金効率を高めることです。