株式 サヤ取り実践セミナー

2022年11月15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
- ■質疑応答

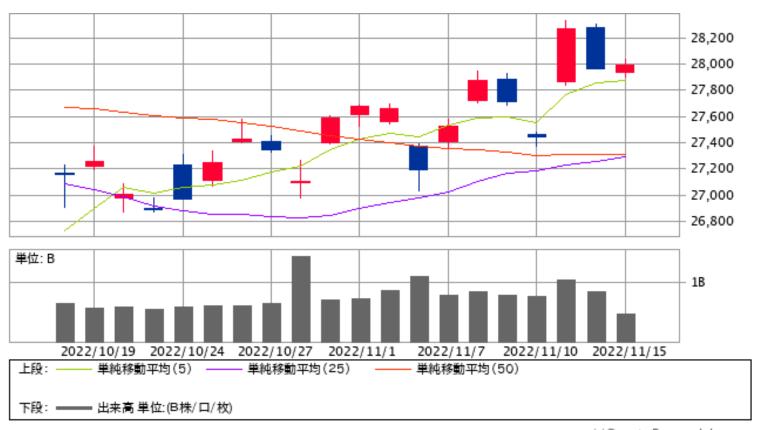


日経平均(1年)



(c)Ouants Research Inc.

日経平均(1ケ月)



(c)Ouants Research Inc.

達人売買ルール

- 相関係数と勝数が高くサヤの動きが良いペアを選定
- サヤσを考慮した最大かい離で仕掛ける
- ▶ 利食いは予定利益の+80%
- ▶ 損切りは予定利益の−80%
- > 手仕舞い期限は30日
 - ※早手仕舞い・増玉

取引履歴 (手仕舞い)

	引履歴	訳手仕舞日:	2022101	0 0	. 202	21115 車	新	削除	修正		リスト印刷	1 0	SV保存				>
No.	仕掛日						 株 数 売買			単価比較				合計損益	仕掛金額計	利益率	T_
1		20221019		東1		システナ	800 實	414		9		338,400	7,200	19.200	696,200	2.76	
				プラ		福井コンピ	100 売	3,650		-120	365,000	353,000	12,000	,	,		
2	20221012	20221021		東1		三菱自	600 買	483		18	289,800	300,600	10,800	34,800	620,800	5.61	
				プラ		エムアップ	200 売	1,655	1,535	-120	331,000	307,000	24,000		·		1
3	20220907	20221021	30	東1	3103	ユニチカ	1,300 売	275	267	-8	357,500	347,100	10,400	36,900	663,000	5.57	
				プラ		福山運	100 買	3,055	3,320	265	305,500	332,000	26,500				
4	20220912	20221026	30	東1	4307	NRI	100 買	3,750	3,645	-105	375,000	364,500	-10,500	18,500	730,000	2.53	1
				プラ	8919	カチタス	100 売	3,550	3,260	-290	355,000	326,000	29,000		-		
5	20221006	20221027	15	東1	8985	JホテルR	7 売	73,400	74,200	800	513,800	519,400	-5,600	-28,700	934,700	-3.07	1
				ブラ		西武HD	300 買	1,403	1,326	-77	420,900	397,800	-23,100				
6	20220928	20221028	22	東1	4502	武田	100 買	3,733	3,806	73	373,300	380,600	7,300	22,000	736,000	2.99	
				プラ	3048	Bカメラ	300 売	1,209	1,160	-49	362,700	348,000	14,700				
7	20221003	20221102	22	東1	3103	ユニチカ	900 売	290	272	-18	261,000	244,800	16,200	10,700	487,900	2.19	
				ブラ	3110	日東紡	100 買	2,269	2,214	-55	226,900	221,400	-5,500				
8	20221019	20221114	18	東1	9364	上組	100 實	2,890	2,820	-70	289,000	282,000	-7,000	30,500	632,000	4.83	
				ブラ	8050	セイコーH	100 売	3,430	3,055	-375	343,000	305,500	37,500				
9	20221021	20221114	16	東1		三菱地所	300 買	1,921	1,971	50	576,300	591,300	15,000	80,200	1,201,900	6.67	
				ブラ	9006	京急	400 売	1,564	1,401	-163	625,600	560,400	65,200				•
1	手仕舞い済。	み合計損益	224,100円	1									40万		▼ 拡大 ▼ 振大		J
				\vdash								カーソル:11	/15 30万l	_	の配力) 両方) 手仕舞い済	みのペア	
													20万		仕掛け中の		
								\perp					1075			つ合計損益	_
													07-17	0	6 手仕舞日(3 経過日数(溴
	06,	月		07月		0:	8月	0	9月	10.	月	11月	—— — 0万円	(A⊐ード		

2317システナ×9790福井コン

損益 +19,200円

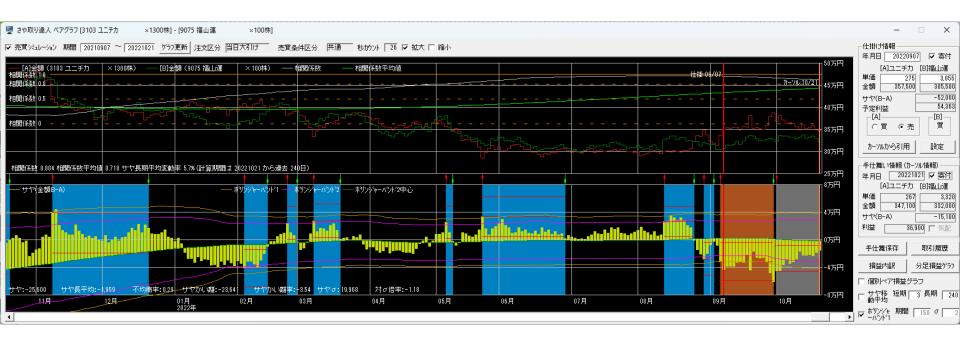
仕掛け時の相関係数0.931 サヤかい離47,091円(6.68%) 対σ倍率2.62 7勝0敗 30日



3103ユニチカ×9075福山運

損益 +36,900円

仕掛け時の相関係数0.962 サヤかい離34,153円(5.32%) 対σ倍率2.04 9勝0敗 30日



7211三菱自×3661エムアップ

損益 +34,800円

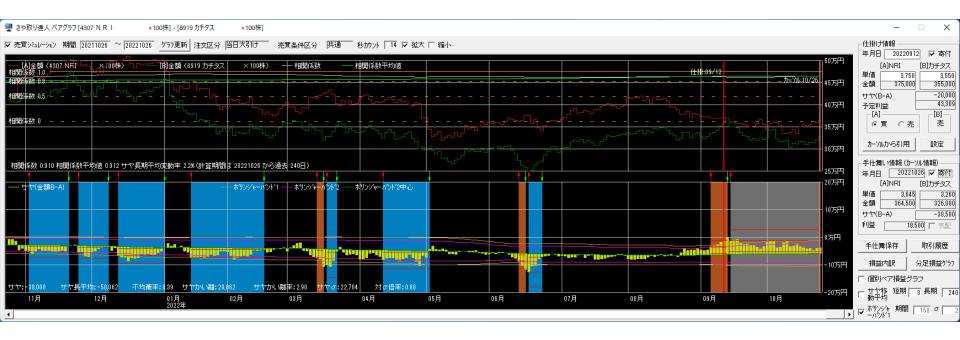
仕掛け時の相関係数0.895 サヤかい離49,581円(7.88%) 対σ倍率1.99 8勝1敗 6日



4307NRI×8919カチタス

損益 +18,500円

仕掛け時の相関係数0.897 サヤかい離45,079円(6.26%) 対σ倍率2.48 8勝2敗 30日



8985Jホテル×9024西武HD

損益 -28,700円

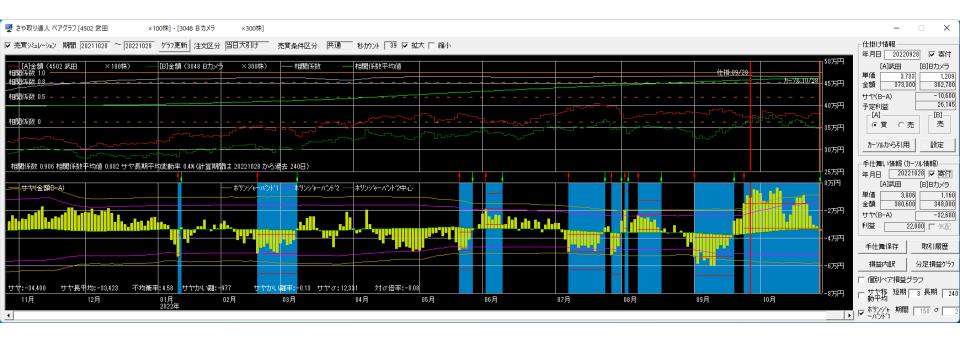
仕掛け時の相関係数0.856 サヤかい離37,816円(4.05%) 対σ倍率2.11 10勝0敗 15日



4502武田×3048Bカメラ

損益 +22,000円

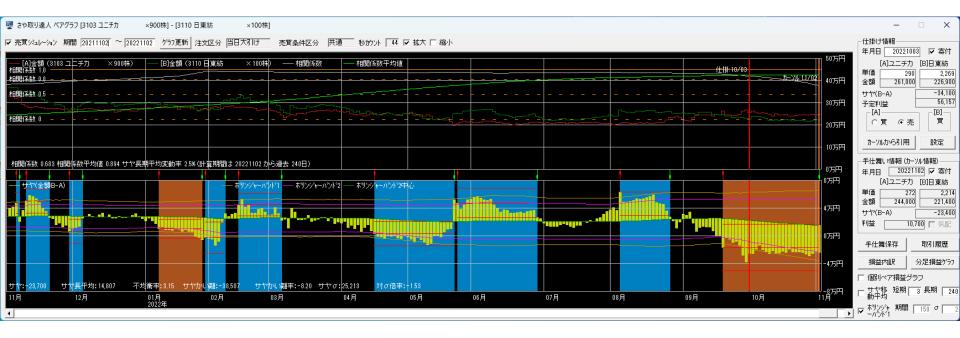
仕掛け時の相関係数0.931 サヤかい離27,547円(3.72%) 対σ倍率2.84 11勝0敗 22日



3103ユニチカ×3110日東紡

損益 +10,700円

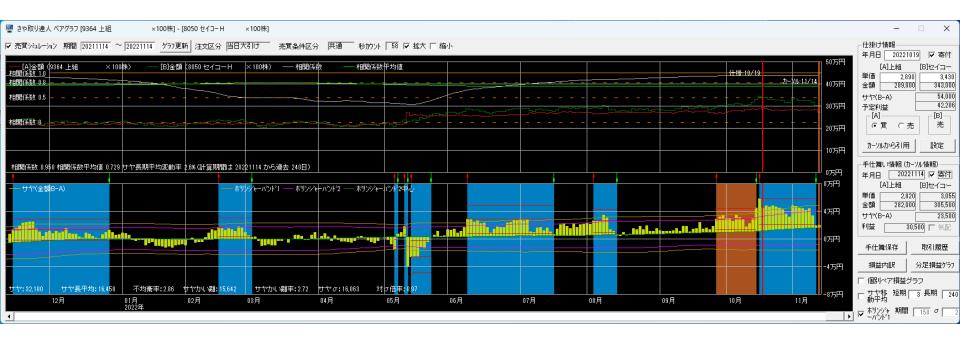
仕掛け時の相関係数0.872 サヤかい離60,142円(12.06%) 対σ倍率3.00 8勝1敗 22日



9364上組×8050セイコー

損益 +30,500円

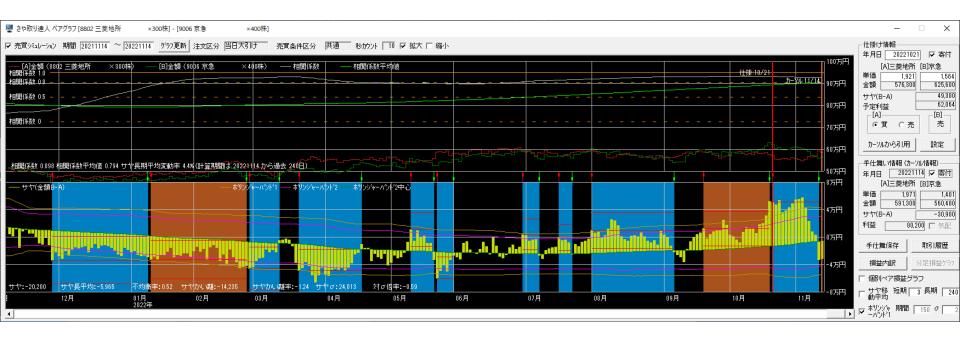
仕掛け時の相関係数0.945 サヤかい離46,563円(7.34%) 対σ倍率3.38 8勝1敗 18日



8802三菱地所×9006京急

損益 +80,200円

仕掛け時の相関係数0.923 サヤかい離64,737円(5.36%) 対σ倍率3.10 9勝2敗 16日

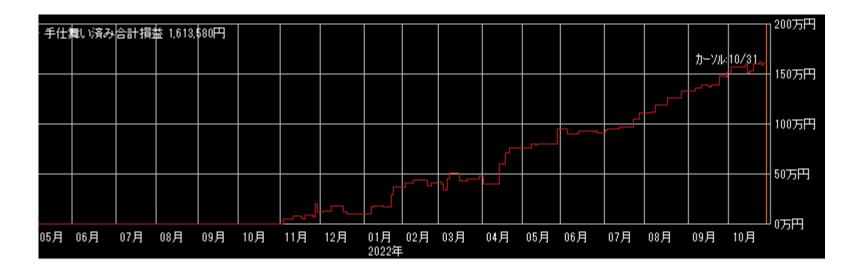


300万円運用実績

	損益	損益率	勝敗	勝率	日数
11月	121,900円	4.06%	6勝5敗	54.5%	18.4日
12月	-18,000円	-0.60%	2勝4敗	33.3%	25.7日
1月	267,000円	8.90%	5勝1敗	83.3%	20.2日
2月	37,000円	1.23%	4勝1敗	80.0%	13.0日
3月	73,980円	2.47%	6勝4敗	60.0%	23.2日
4月	277,200円	9.24%	4勝2敗	66.7%	25.2日
5月	187,900円	6.26%	3勝2敗	60.0%	16.2日
6月	-33,100円	-1.10%	4勝4敗	50.0%	26.4日
7月	195,400円	6.51%	5勝0敗	100.0%	20.4日
8月	218,600円	7.29%	5勝1敗	83.3%	18.0日
9月	142,800円	4.76%	5勝3敗	62.5%	26.0日
10月	142,900円	4.76%	8勝3敗	72.7%	19.5日
合計	1,613,580円 (134,465円)	53.79% (4.48%)	57勝30敗	65.5%	21.3日

損益内訳

勝数	負数	利益	損	損益
57	30	2,541,080円	927,500円	1,613,580円
平均利益	ŧ	44,580円	勝率	65.5%
平均損		30,917円	PF/POR	2.74/1.44
平均損益	ŧ	18,547円	時給	40,340円

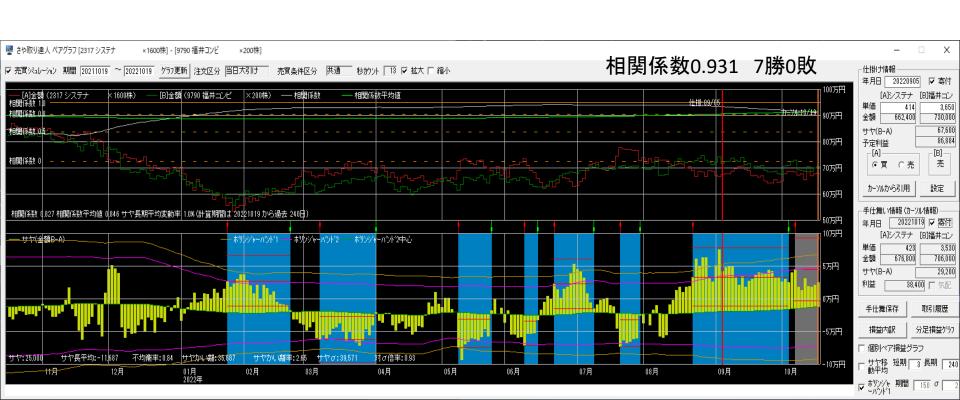


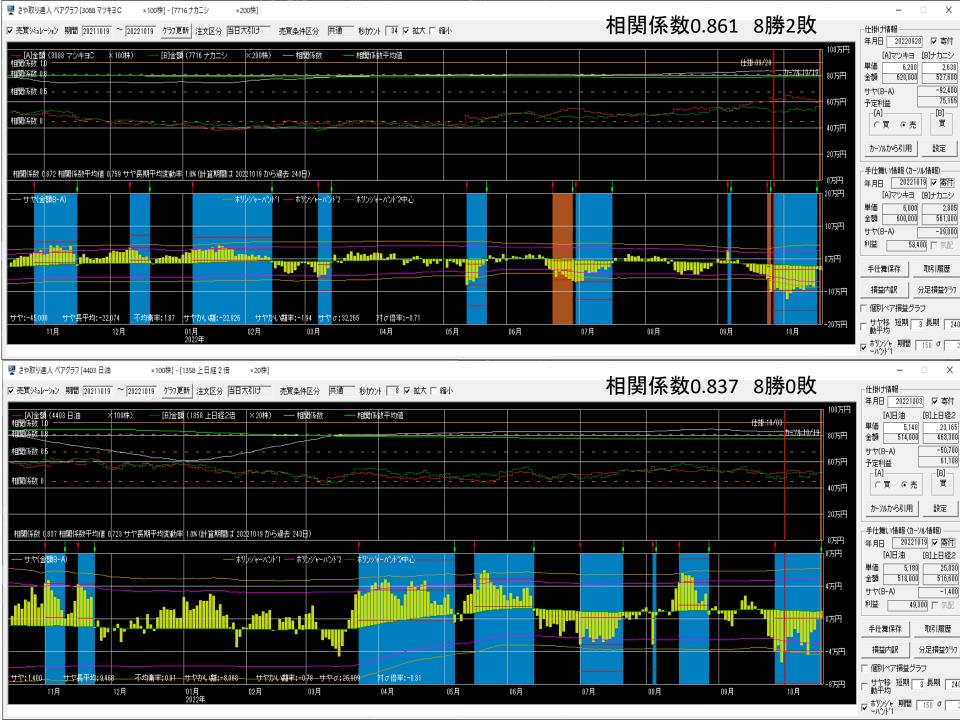
2022/10/19~2022/11/15

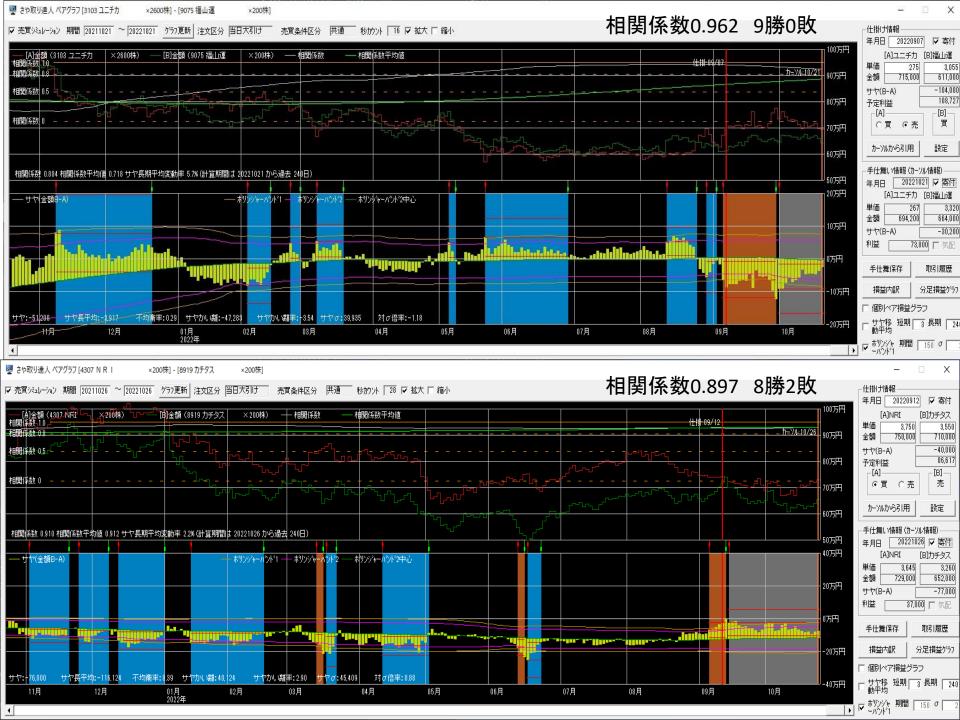
取引履歴(仕掛け中)

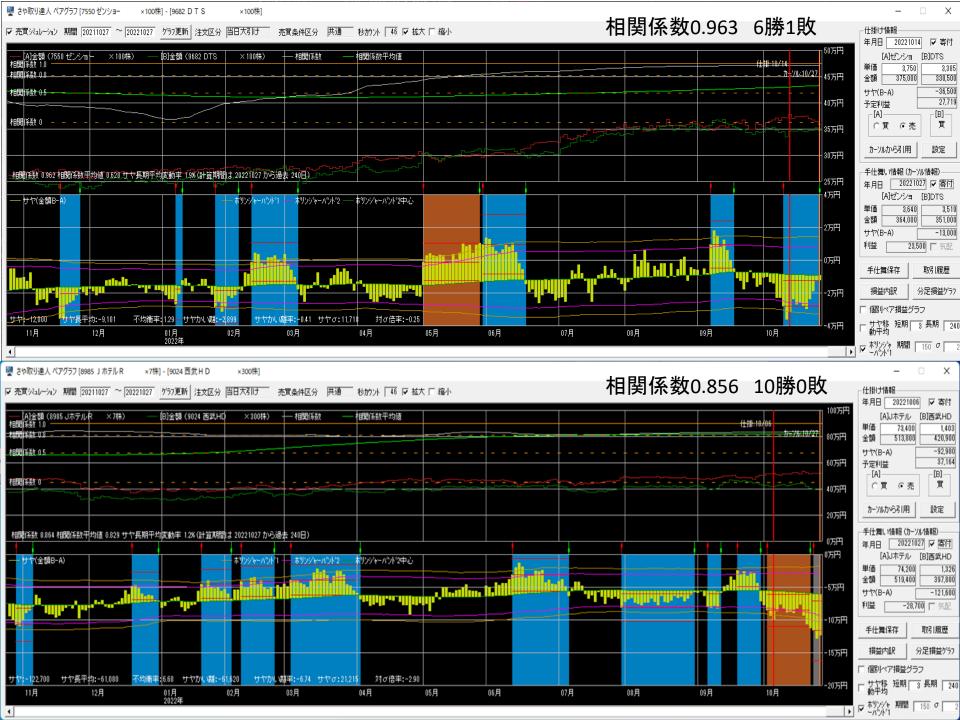


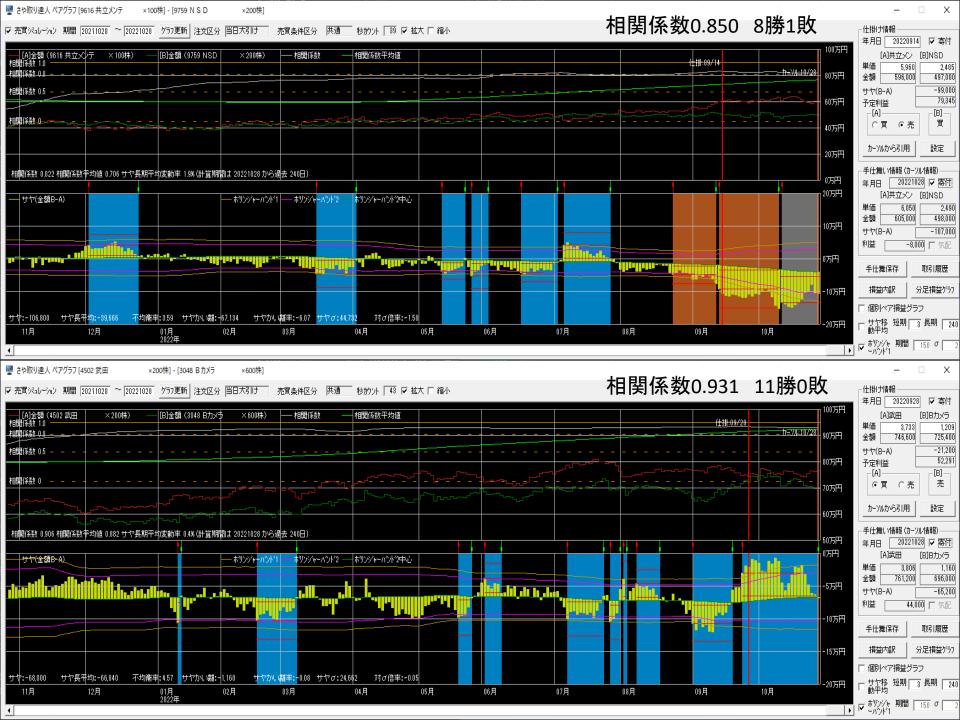
10/19~11/15 手仕舞い 22ペア +741,000円 15勝8敗 勝率65% (利食11 損切4 期限5 早手3)

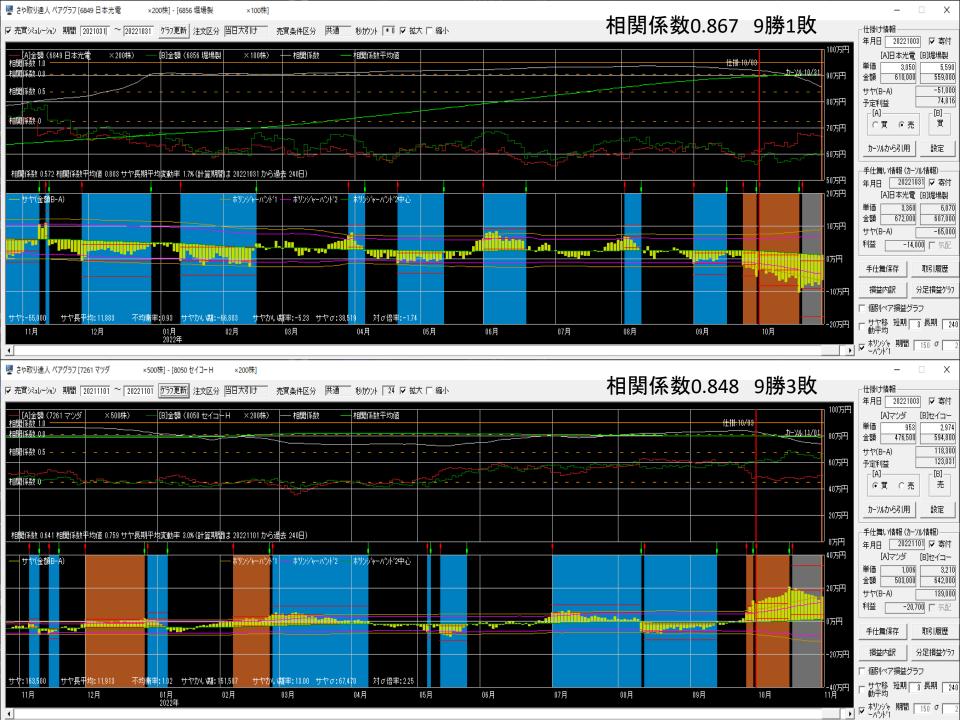


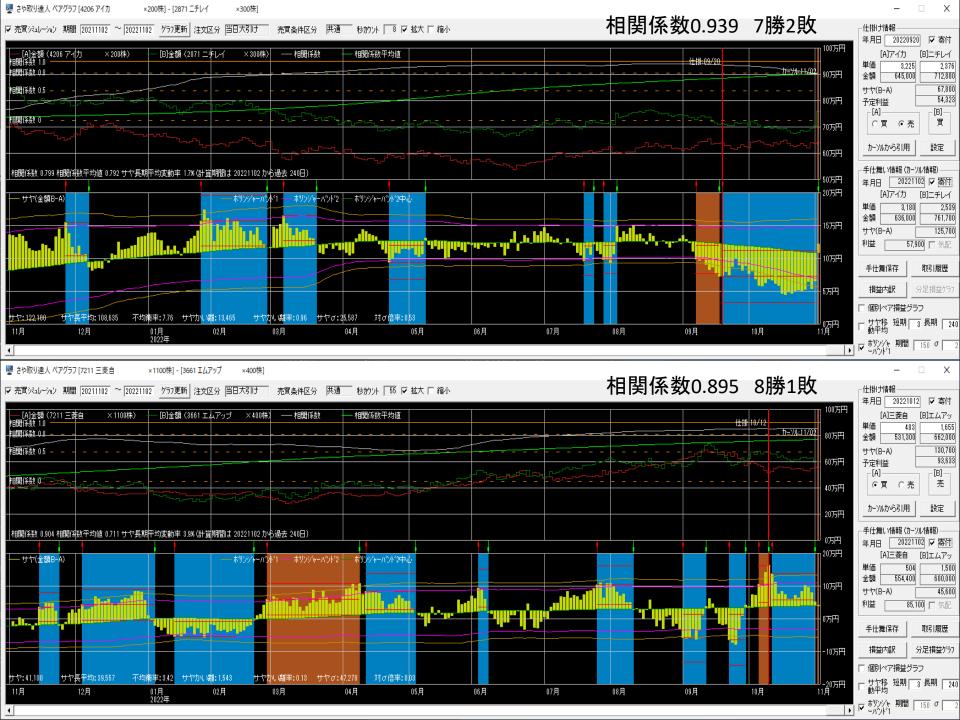


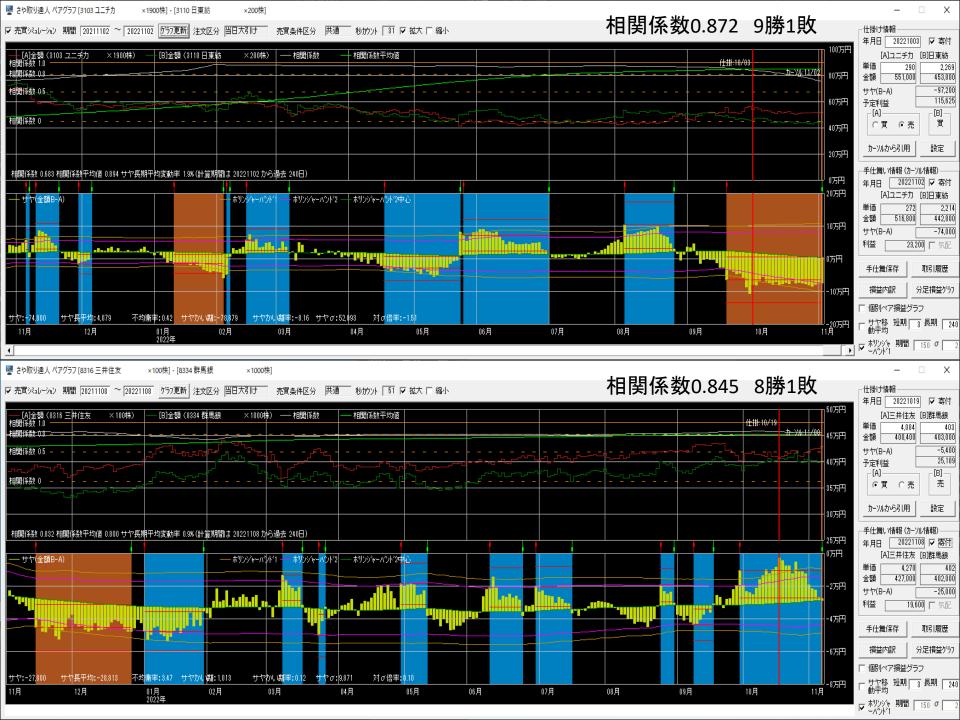




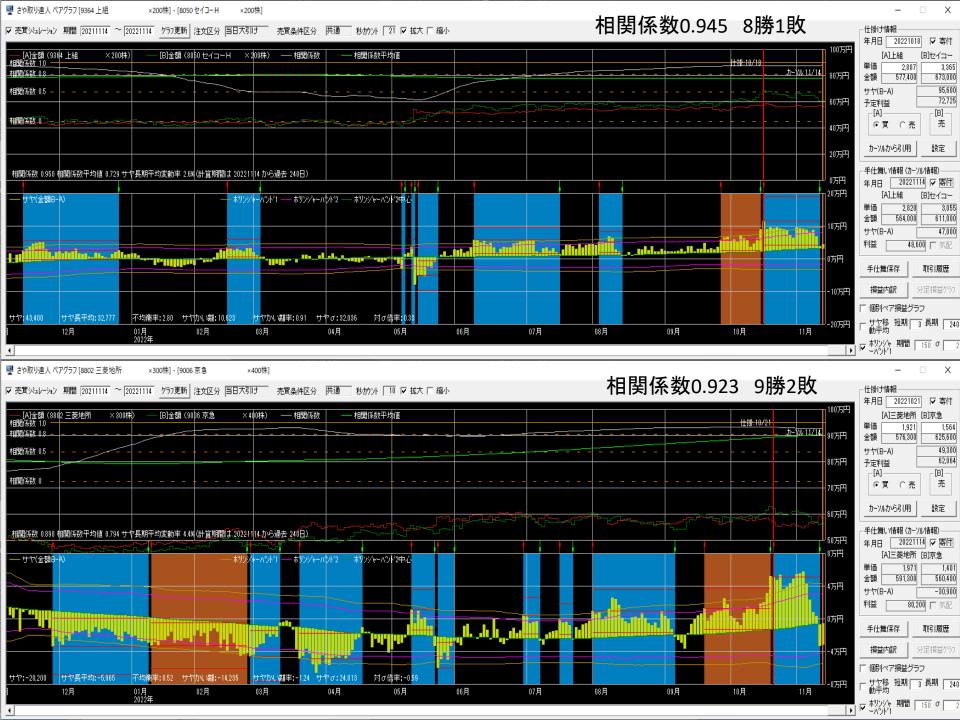


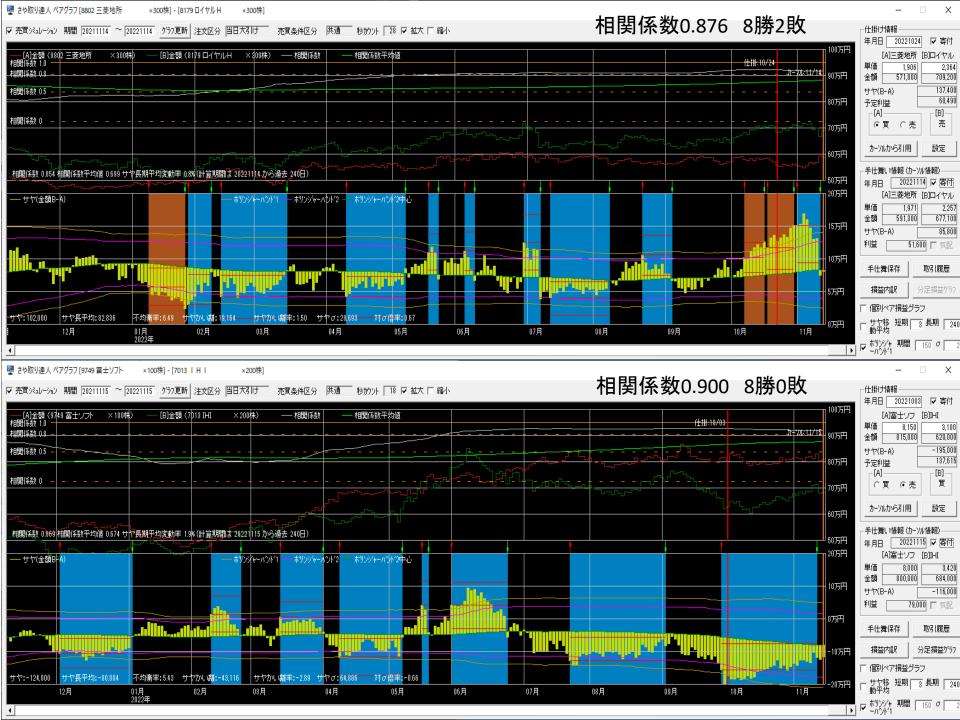










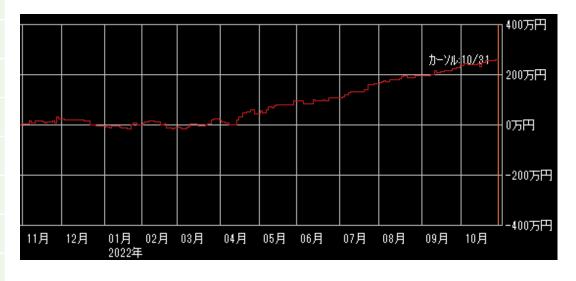


10/19~11/15 手仕舞い 22ペア +741,000円 15勝8敗 勝率65% (利食11 損切4 期限5 早手3)

仕掛け中 20ペア -45,600円

1000万円運用実績

	損益	利率
11月	257,110円	2.6%
12月	-311,100円	-3.1%
1月	72,100円	0.7%
2月	-136,250円	-1.4%
3月	377,500円	3.8%
4月	184,800円	1.8%
5月	498,200円	5.0%
6月	128,200円	1.3%
7月	582,800円	5.8%
8月	309,500円	3.1%
9月	315,300円	3.2%
10月	315,800円	3.2%
合計	2,593,960円	25.9%



ペア選定

できるだけ相関係数と勝数 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
- ▶サヤが短期で開閉している
- ▶ボリンジャーバンドの間隔、サヤ長期移動平均線が一定
- > サヤチャートの綺麗なペア

仕掛けのコツ

サヤσを考慮した最大かい 離で仕掛ける。

サヤボリンジャーバンドの 変動幅を確認して、仕掛け のタイミングを計る。

リスク許容度

どれくらいまでなら資金がマイナスとなっても受け入れることができるか、気持ち的に耐えられるか

年齢(時間)、資産、年収、 性格・経験と照らし合わせて 考えてください

手仕舞いルール

資金量・方針・性格等を考慮して 自己売買ルールを確立して下さい。

- ・利食いは予定利益の+80%前後
- ・損切りは予定利益の-80%前後
- ・手仕舞い期限は30日前後

投資の掟

▶売買ルールを守る

メンタルコントロールをする

>資金管理に心がける

売買ルール

- ルールがないといつも悩む
- ルールがないと結果が安定しない
- 自分に合ったルールを確立する
- ・楽なトレードができる
- ・検証ができ、修正も可能
- 複雑にしない
- 損失が出ることも含めルール
- コロコロ変えない
- ・機械的に淡々と
- メンタルも安定する

メンタルコントロール

- メンタルが崩れると台無しになる
- ・感情(欲・恐怖・退屈)は最大の敵
- ・ポーカーフェイス
- 1回の結果よりトータルが大事
- 勇気から自信が生まれる
- 成功体験
- ・プラス思考
- 好きこそものの上手なれ
- 信じることができるか
- ルールが守れる

資金管理

- ・利小損大にならないように
- 銘柄分散
- 時間分散
- 資金分散
- ・余裕資金を持つておく

トレード

トレードで勝てるようになる というのは、決してスマート なことではなく、泥臭く、粘 り強く、自分の形を作り上げ ていくものです。

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。