

上野ひでのり講師 第11回  
トレード体系の決定方法

トレード手法

- 逆張り
  - 個人投資家に好まれる
    - 底値で買って高く売るのが理想 → 当たったときの収益性は高い
    - 暴落相場の途中で買いを入れて、大損することが多い → 数か月間以上、塩漬けになることも  
ハイレバレッジの場合には強制ストップ
    - 売りができるのは中級者以上だが、リスクの高さは変わらない
  - 上野式サヤ取り
    - 相関係数に着目して、レンジ相場での戻りを取る → いつでも、どの通貨ペアでも通用するとは限らない
- 順張り(トレンドフォロー)
  - 押し目買い、戻り売りを意識するのが基本 → 逆張りにならないように注意
  - レンジブレイクアウト
    - 三角保ち合いなどの強弱拮抗した状況から、上下に大きく放たれる瞬間を狙う
    - ブレイクポイント
      - 現状より不利なレートになるのが通常
      - 具体的なポイント → 直近の高値、安値  
チャート上の重要なサポート、レジスタンス
- 順張り(トレンドフォロー)の垂流
  - 指標トレード → 重要な経済指標が発表になった瞬間に、動き出した方向についていく
  - 提灯をつける → 提灯買い、提灯売り

トレードに要する時間

- ポジショントレード
  - 数か月以上の大きな相場のトレンドを追いかける → 資金力勝負  
モデル系為替ファンドなど
- スイングトレード
  - 数日から1週間以内の相場のトレンドを追いかける → ほとんどの個人投資家が採用  
相場の急変で収益がブレやすい
- 超短期デイトレード
  - 30分から2時間くらいの相場のトレンドを追いかける → 最もリスクが低い方法

トレード時間帯と適した通貨ペア

- 朝から昼間のトレード
  - 東京タイム → 8時以降(11時くらいまでが活発) → AUD/USDやUSD/JPY
- 夕方から夜のトレード
  - ロンドンタイム(欧州タイム) → 15時から21時(冬時間は16時から22時) → EUR/USDやAUD/USD
  - 東京との時差8時間(冬時間は9時間)
- 深夜のトレード
  - ニューヨークタイム → 21時以降(冬時間は22時以降) → EUR/USDやAUD/USD
  - ロンドンとの時差5時間(1週間ほど夏冬時間の適用日はずれるので、そのときは例外)

ストップの設定とポジションサイズ

- 基本的な考え方(例)
  - 1回のトレードの損失が、総資金(証拠金)の1%を超えないようにする
- 決定のステップ(例)
  - (1) 証拠金100万円、レバレッジ25倍と仮定する
  - (2) 総資金の1%は1万円
  - (3) 損失1万円以内でロスカットする → 利益確定は2万円以上を目標とする
  - (4) EUR/USDのストップ値幅を10pipsとする
  - (5) ドル円レートが80円のと看、ロスカット1万円、10pipsと仮定すると  
 $1万円 \div 0.0010 \div 80円 = 125,000$  ∴ 12万ユーロの売買可能 → 実質レバレッジ11.2倍  
 $12万ユーロ \times 98円 = 100万円$

ストップとリミット

- 損小利大タイプ
  - ストップ:リミット=1:2(以上) → 勝率33.3%以上で収益がプラス
- 勝率重視タイプ
  - ストップ:リミット=1:1 → 勝率50%以上で収益がプラス → 目標勝率70%以上
- 理想形
  - ストップ:リミット=1:2(以上) → 目標勝率70%以上