2012 年 2 月 3 日

インヴァスト証券株式会社
（JASDAQ　コード：8709）
問合せ先：営業企画部　03-3595-8907

シストレ 24　月間レポート （2012 年 1 月）

人気 No.1 ストラテジーは 2 ケ月連続 Maloma (USD/CHF)！
ランキング TOP10 のうち 8 割がプラスに！

インヴァスト証券 FX 自動売買サービス「シストレ 24」の月間ストラテジーレポート（2012 年 1 月）をお知らせいたします。（※シストレ 24 では、「売買プログラム」のことをストラテジーといいます。）

【レポートサマリー】

・2012 年 1 月の人気ストラテジーランキング No.1 は、2 ヶ月連続 Maloma(USD/CHF)！
・国内ストラテジープロバイダー（株）テラスのストラテジーが、人気ランキング 6 位にランクイン。
・選ばれているストラテジーTop10 のうち、8 割の損益が期間中プラスに。
・月間最強ストラテジーは、1 ヶ月で「2,309pips」の実現利益！
・取引者の 32%が 1 本のストラテジーで運用。リスク分散のため、3 本以上での運用を推奨します。
・少ない証拠金額でポートフォリオを組むためのワンポイントアドバイスを掲載。

■1 月　人気ストラテジーランキング TOP10　（期間 2012 年 1 月 1 日～1 月 31 日）

シストレ 24 に搭載されたストラテジーのなかで、実際に取引されたストラテジーのランキングです。

RANK	ストラテジー名	通貨ペア	**選択比率**	期間損益 pips	1 万通貨円換算
1	Maloma	USD/CHF	**75.0%**	396.2	32,833 円
2	Return	USD/JPY	**20.4%**	-10.7	-1,070 円
3	Maloma	EUR/USD	**15.0%**	306.4	23,366 円
4	100-NBA	AUD/NZD	**9.8%**	440.9	27,754 円
5	Auto-Action FX	EUR/USD	**8.7%**	661.0	50,407 円
6	3Logic_Algo*(T)	EUR/USD	**7.8%**	150.8	11,500 円
7	Sphynx	EUR/AUD	**7.3%**	718.4	58,176 円
8	Pminvestcapital	EUR/GBP	**6.2%**	204.6	24,590 円
9	Auto-Online	EUR/GBP	**6.1%**	1,159.4	139,348 円
10	Auto-Aggressor	EUR/USD	**5.9%**	-17.4	-1,326 円

※損益 pips は取引画面上のストラテジーカードから該当する期間の損益情報を掲載しています。
※選択比率は月間の総取引人数に対して、期間中、実際に取引した人数となります。
※損益円換算は、1 月 31 日の(株)東京金融取引所「くりっく 365」の終値で換算しています。
※期間損益は、該当期間の実現損益の合計であり、評価損益は含まれておりません。

■1 月　人気国内ストラテジーランキング　TOP5　（期間 2012 年 1 月 1 日～1 月 31 日）

国内プロバイダーが提供するストラテジーのなかで、実際に取引されたストラテジーのランキングです。

RANK	ストラテジー名		通貨ペア	**選択比率**	期間損益 pips	1 万通貨円換算
1	*T	3Logic_Algo	EUR/USD	**7.8%**	150.8	11,500 円
2	*G	BossaNova_EJ	EUR/JPY	**4.4%**	284.1	28,410 円
3	*G	24H Swing	EUR/USD	**1.9%**	18.1	1,380 円
4	*T	T Follow	EUR/USD	**1.8%**	133.7	10,196 円
5	*TR	Kirameki	USD/CHF	**1.5%**	93.1	7,715 円

※プロバイダー名　*G=(株)ゴゴジャン　*T＝(株)株式会社テラス　*TR＝(株)トラヴィス･コンサルティング

■月間 最大 PIPS ランキング TOP5　（期間 2012 年 1 月 1 日～2 月 1 日）

シストレ 24 に搭載されているストラテジーの損益ランキングです。

RANK	ストラテジー名	通貨ペア	**期間損益 pips**	勝率	取引回数
1	ThirdBrainFx	GBP/NZD	**2309.1**	**81%**	11
2	Sphynx	NZD/USD	**1504.2**	**100%**	10
3	Sphynx	GBP/AUD	**1329.1**	**90%**	11
4	Auto-Online	EUR/GBP	**1159.4**	**94%**	53
5	Kameleon	EUR/AUD	**1087.7**	**83%**	43

（取引回数 10 回以上から抽出）

■月間　勝率ランキング TOP5　（期間 2012 年 1 月 1 日～2 月 1 日）

シストレ 24 に搭載されているストラテジーの勝率ランキングです。

RANK	ストラテジー名	通貨ペア	期間損益 pips	**勝率**	取引回数
1	Maloma	USD/CHF	**412.8**	**100%**	21
2	L.O.S.R.	EUR/GBP	**309.5**	**96%**	32
3	SharpPoint	CAD/JPY	**465.8**	**96%**	27
4	Auto-Online	EUR/GBP	**1159.4**	**94%**	53
5	Maloma	EUR/USD	**342**	**93%**	29

（取引回数 20 回以上から抽出）

本レポートに掲載されているストラテジー以外にも、シストレ 24 には数多くのストラテジーが存在します。
自分なりのストラテジー検索方法を見つけ出し、定期的にポートフォリオの見直しをしてください。
一つのストラテジーが永久に勝ち続けることはありませんので、複数のストラテジーでポートフォリオを組み、運用することを心掛けてください。
ストラテジーの探し方やポートフォリオの組み方など、より具体的な運用ポイントは、当社ホームページ「シストレ 24 攻略」（http://www.invast.jp/st24mr/advantage/ ）でご覧いただけます。

■ポートフォリオ状況

ポートフォリオに組入れているストラテジーの本数 （2012 年 2 月 1 日当社調べ）

ポートフォリオ組入れ数	1 本	2 本	3 本	4 本	5 本	6 本以上
人数比率	32.0%	23.2%	17.0%	9.5%	6.6%	11.7%

3 本以上のストラテジーを選択し、ポートフォリオ組んでいる人の割合は、全体の 44.8%となりました。
一方で、1 本しかストラテジーを選択していない人の割合は、全体の 32%に上る結果となっています。
シストレ 24 では、リスク分散を図るために「最低 3 本以上」のストラテジーで、ポートフォリオを構成することを推奨しています。

■参考ポートフォリオ【1 月人気ストラテジーTOP5】ポートフォリオを組んだ場合

No	ストラテジー名	通貨ペア	期間損益 円換算 1 万通貨（10k）	最大建玉数(※2)	必要証拠金額（目安） 1 万通貨（10k）※1
1	Maloma	USD/CHF	32,833 円	2	62,000 円
2	Return	USD/JPY	-1,070 円	2	62,000 円
3	Maloma	EUR/USD	23,366 円	2	80,000 円
4	100-NBA	AUD/NZD	27,754 円	4	128,000 円
5	Auto-Action FX	EUR/USD	50,407 円	4	160,000 円
		合計	**+ 133,290 円**	**14**	**492,000 円**

※1.必要証拠金額の目安は「くりっく 365」の証拠金基準額（2012 年 1 月 23 日付）を参考にした 1 万通貨あたりの証拠金基準額に最大建玉数を乗じて算出しています。また、シストレ 24 の取引単位は、1 万通貨となり「10k」と表記されます。
※2.最大ポジション数とは、そのストラテジーが同時に保有することができる建玉の数をいいます。例えば、最大建玉数「2」のストラテジーは、最大 2 万通貨まで建玉を保有します（2 万通貨を超える建玉を保有することはありません）。

推奨証拠金額

最大損失を加味した推奨証拠金額（目安） **594,800 円**

〇取引額 **各 1 万通貨（10k）** 〇必要証拠金額 **492,000 円** 〇期間最大損失 **514pips**

※推奨証拠金額の目安を考えるときは、期間最大損失（最大ドローダウン）を考慮する必要があります。上記では、必要証拠金に期間最大損失の 2 倍の金額を足した数値としています。また、評価損失は加味しておりませんのでご注意ください。
※推奨証拠金を算出するための期間最大損失（最大ドローダウン）の pips は、1pip＝100 円に簡略化し計算。

■ポートフォリオ作成時のワンポイント

幾つかのストラテジーでポートフォリオを組むことはリスクの分散になります。そのため、ストラテジーを1本しか選択していない方は、リスクコントロールに不備があるといえます。

シストレ 24 では、最大建玉数が「1」(＝1 ポジションを超える建玉は保有しない)のストラテジーが多数存在し、それらのストラテジーは少ない証拠金額でも取引が可能です

少額で運用したい場合、「最大建玉数1」のストラテジーをポートフォリオに追加するなどの方法がお勧めです。

最大建玉数「1」のストラテジー　月間損益ランキング　（期間 2012 年 1 月 1 日～1 月 31 日）

RANK	ストラテジー名	通貨ペア	期間損益 pips	勝率	取引回数
1	Psyco Gene	EUR/USD	**691.5**	**90%**	11
2	Persistence	EUR/USD	**476.7**	**32%**	56
3	Trend Friend	AUD/USD	**457.9**	**90%**	11
4	zhonghua	USD/CHF	**392.8**	**80%**	15
5	Lynx	GBP/AUD	**356.9**	**75%**	16

（取引回数 10 回以上から抽出）

【搭載ストラテジーに関する情報は、当社ホームページ「シストレ 24 攻略」からご覧いただけます】

〇シストレ 24 攻略　（URL http://www.invast.jp/st24mr/advantage/ ）

ストラテジー収益率ランキングをはじめとした「シストレ 24」に関する総合情報サイト。

様々な情報を随時更新しています。

■「シストレ 24」とは

シストレ 24 のプラットフォームは、その性能の高さから世界中で 20 社以上に導入されている Tradency 社の「Mirror Trader」。バックトレードシステムは、機関投資家などのプロ投資家向けに開発され、世界のプロ投資家やブローカーから高い評価を受けているFX取引の最先端システム CURRENEX 社のトレードシステム。さらにストラテジーは「Mirror Trader」標準搭載の約 500 種類に加えて、国内で実績のあるストラテジープロバイダー各社のストラテジーを追加搭載しています。世界中の優れたパートナー企業との連携により、最高水準の性能を兼ね備えた FX システムトレードを無料でご提供いたします。

本社所在地： 東京都港区西新橋一丁目 6 番 21 号 NBF 虎ノ門ビル
代表者 ： 代表取締役社長 川路 猛
資本金 ： 59 億 6,508 万円
設立 ： 昭和 35(1960)年 8 月 10 日
上場市場名： 大証 JASDAQ(コード：8709)
事業内容 ： 金融商品取引業
登録番号 ： 金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第 26 号
加入協会 ： 日本証券業協会、社団法人金融先物取引業協会
URL ： http://www.invast.jp/

●本レポートは、投資判断の参考となる情報の提供を目的にしたもので、投資勧誘を目的としたものではありません。●過去の実績は、将来の結果を保証するものではございません。●提供する情報等は作成時現在のものであり、今後予告なしに変更又は削除されることがございます。●投資にかかる最終決定はお客様ご自身の判断と責任でなされるようにお願いいたします。●各種情報の内容については万全を期しておりますが、その内容を保証するものではありません。また、これらの情報によって生じたいかなる損害についても、当社は一切責任を負いかねます。●本レポートの内容に関するすべての情報について、当社の許可なく転用・販売することを禁じます。

【リスク・費用などについての重要事項】

本取引は、取引通貨の価格および金利等の変動により損失が生ずるおそれがあります。また、スワップポイントが受取りから支払いに転じることもあります。当社は、必要証拠金率が一定水準以上となった場合、全建玉を自動的に強制決済（ロスカット）いたしますが、本取引は、預託すべき証拠金額以上の取引が可能なため、急激な相場の変動等によっては、証拠金の額を上回る損失が発生するおそれがあります。

■売買手数料は、新規注文・決済注文ともに無料です。

■本取引は、通貨ペアの売付けの価格と買付けの価格に差（スプレッド）があり、相場急変時等はスプレッドが拡大する場合があります。

■証拠金は、時価評価額の 4%の額（円換算額）で、証拠金の 25 倍までのお取引が可能です。

（平成 23 年 11 月 16 日現在）

【シストレ 24 における重要事項】・「シストレ 24 Mirror Trader」では、ご自身で数ある売買ストラテジーを選択・設定した内容に基づいて自動売買を行うことができる取引システムです。（以下、シストレ 24 Mirror Trader を本サービスという。）・本サービスは、上記に示した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ありません。また、将来の運用利益を確約するものではなく、相場の状況によっては過去の運用実績を大きく下回るおそれがあります。・本サービスは、当社が正確性・確実性を期すよう努めておりますが、完全性を保証するものではありません。また、予告なしに情報および内容を変更することがありますのでご注意ください。・本サービス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、当社は、一切責任を負いませんのでご了承ください。・本サービスはシステム提供者より当社が提供を受け、お客様に提供している商品であるため、システム提供者および当社が本商品の提供を休止または廃止した場合にはご利用が継続できなくなります。この場合、本サービスをご利用いただけなくなりますのでご注意ください。また、システム提供者または当社の判断により利用されていない個々のストラテジーが削除されることがあります。