

【木南制作 自動売買システム】

システムトレードの原理原則

著作権について

本冊子と表記は、著作権法で保護されている著作物です。
本冊子の著作権は、発行者にあります。
本冊子の使用に関しましては、以下の点にご注意ください。

使用許諾契約書

本契約は、本冊子を購入した個人・法人(以下、甲と称す)と発行者(以下、乙と称す)との間で合意した契約です。本冊子を甲が受け取り開封することにより、甲はこの契約に同意したことになります。

本契約の目的：

乙が著作権を有する本冊子に含まれる情報を、本契約に基づき甲が非独占的に使用する権利を承諾するものです。

禁止事項：

本冊子に含まれる情報は、著作権法によって保護されています。甲は本冊子から得た情報を、乙の書面による事前許可を得ずして出版・講演活動および電子メディアによる配信等により一般公開することを禁じます。特に当ファイルを第三者に渡すことは厳しく禁じます。甲は、自らの事業、所属する会社および関連組織においてのみ本冊子に含まれる情報を使用できるものとします。

損害賠償：

甲が本契約の第2条に違反し、乙に損害が生じた場合、甲は乙に対し、違約金が発生する場合がございますのでご注意ください。

契約の解除：

甲が本契約に違反したと乙が判断した場合には、乙は使用許諾契約書を解除することができるものとします。

責任の範囲：

本冊子の情報の使用の一切の責任は甲にあり、この情報を使って損害が生じたとしても一切の責任を負いません

目次

著作権について	2
使用許諾契約書	2
1. 現実を直視して自分に最適な投資を選択する。.....	4
2. 今回の特典でお話しするシステムトレードの概念.....	6
3. 自分で判断を下さないトレードにどの程度のリターンを望むのか?.....	7
4. バックテストで数字が良くても、絶対に必要なフォワードテスト.....	8
5. フォワードテストのチェックの次はミニマムテスト.....	9
6. 自分が何かしらのビジネスに投資する事をイメージする.....	10
7. コツコツドカンのキッカケは資金管理ミス.....	11
8. 友人の稼いでいるシステムトレーダーの思考.....	12
9. 【重要】 EA 販売者は誰も損をさせたい訳では無い	13
10. 最後に・・・このレポートを腑に落としてくれない人には何も勧められない。..	14

1. 現実を直視して自分に最適な投資を選択する。

こんにちは、木南です。

今回は『システムトレードの原理原則』をお受け取り頂き誠にありがとうございます。

僕は2011年より裁量トレーダーとして活動しており、このレポートを書いている2019年現在は、

裁量トレードを本業としながら、

- ・ネットビジネス（物販・アフィリエイト）
- ・システムトレード（EA×16台）

といった、いくつかの収入源を確保しています。

なぜ、裁量トレードで稼げているにも関わらず他のビジネスにも手を出しているのか？という質問も多く受けますので、まずはそこからお話ししますが、

理由は至ってシンプルで、いくつかの収入源を得ることで生活基盤を安定させ、裁量トレードはあくまで余剰資金で行うという感覚を持つことで、トレードに対するメンタルプレッシャーを軽減させたかったから・・・。

他のビジネス・投資案件と比べて

裁量トレードの方が圧倒的に収益率は高いのですが、

誰が何を言おうが僕たち裁量トレーダーの生命線は『自分の資産・・・自分の資金力』になってきます。

万が一、自己崩壊を起こし資金を失ってしまっても再起するだけの収入源があれば、**精神的にもゆとりを持ちながら裁量トレードに挑める**ことから、裁量トレードで得た収入を元に、リスクヘッジを掛けてきました。

（実際、専業トレーダーとして生活していた時代もありましたが、1回のトレードに対するプレッシャーが半端なかったですから・・・）

要するに、

僕が裁量トレードと並行して EA の運用や他のビジネスを実践している理由は、
『常に付きまとう不安を拭い去りたかったから』なんです（笑）

裁量トレードに関しては、ほどほどで満足して、
コップから溢れた余剰資金を他のビジネスの軍資金に回したり、
EA などの自分がトレード判断しなくて良い投資案件に投げる。

特に EA は自分が意思決定していない以上、リターンは大きくなくて良いので、
安定的な収入を望んで投じているという事です。

プライベートバンクにお金を預けないとか、
仮想通貨の ICO を買わないか？など色々な投資案件の話は来ますが、
やっぱり、餅は餅屋ですからね（笑）

分からない世界に手を出す前に、
まずは、自分が専門の世界で投資に携わる方が一番リスクが小さいですから、
為替に絞ってシステムを回しています。（今現在はですが・・・）

要するに、僕がいくつかの収入源を確保している理由は

『裁量トレードだけでは得られない安定という恩恵を得るため』という事です。



2. 今回の特典でお話しするシステムトレードの概念

今回は『システムトレードの原理原則』を題材にしていきますので、
まず、始めに『何を持ってシステムトレードなのか?』という根幹をお伝えします。

今回お話しする資金管理法はシステムトレードに限らず、
自分で判断を下す必要の無い投資案件ならばほぼ順応させる事が出来ると考えています。

- ・システムトレード (EA) (自動売買ソフト)
- ・投資信託
- ・コピートレード

などなど、第三者が自分の代わりに判断を下してくれる方法を前提に
構成していますので、その点は注意しておいて下さいね。

《注意》

今回、お話しする『システムトレードの原理原則』は、
裁量トレードの事は一切考えずに構成していますので、
あまり裁量トレードの参考にはなりません。

裁量トレードを学ぶ意識で当レポートを読むと、
おそらく頭が混乱して行きます (笑)

あくまでも、自分で判断を下さない投資案件の原理原則として
考えて貰いますようお願い申し上げます。

3. 自分で判断を下さないトレードにどの程度のリターンを望むのか？

現代社会には様々な金融商品が存在しますが、
自分でトレード判断を下さない投資案件で一番メジャーなのは、
やはり、投資信託です。

長期投資に該当する金融商品が殆どですが、
どうしても、自分自身で判断を下さない投資案件になると、
リターンは驚くほど小さくなります。

**投資信託ですと、年利 10%を維持できていれば
優秀な金融商品と言われていますし、**

完全自動の EA でも安定性を確保しようと思ったら
月利で 5%~10% (年利 60%~120%) も取れば十分です。
(裁量を含む半自動の EA なら利益率は上がります)

優秀なトレーダーのコピートレードでしたらもっと数字は伸びますが、
本当にその人が優秀なトレーダーかは
実際に長期間トレードして貰わなくては分かりませんし、

どうしても、得た利益の 30%~50%程度を管理者に払っていく事になりますから、
結果的に残る数字というのは月利 5%~10%程度が妥当な数字となってきます。

ですが、貯金しておいても 1 円も増えない超低金利時代に
必要以上のお金を残しておく意味はありませんから

貯蓄の一部を投資に回していく事により
ゆっくりと、資産を増やしていくのは正しい選択だと僕は考えています。
(勿論、貯金してからの余剰金を投資に回すという意味です)

4. バックテストで数字が良くても、絶対に必要なフォワードテスト

システムトレード（EA）の場合、
ほとんどの方はバックテストデータ（過去相場でのテストデータ）を鵜呑みにして、
稼げているかどうかを判断していると思いますが、

今まで様々なEAへ資金を投じてきた立場から正直な意見をお伝えすると、
バックテストデータの数字だけを鵜呑みにして資金を投入しても、
その通りの結果を出す事が出来ないケースが何気に多い><

僕もEAを触る前はバックテストデータこそが
優劣を判断する唯一の判断材料だと思っていたし、

結果的に、EAによって資金を溶かされた時には、
詐欺じゃないかと不信感を募らせた時期もありました。

なぜ、そんな詐欺的に理不尽な状況がまかり通っているか・・・
僕もひたすらに悩みましたが、正直・・・答えはありません。
（過去統計の限界と考えています。）

だからこそ、大事な事は『**自分のお金は自分で守る意識を高く持つ事**』

- ・バックテストデータが良いからと言って安心せず
- ・最大ドローダウンが小さいからと言って信用せず
- ・グラフが右肩あがり過ぎる時は逆に不信感を抱く

①こういった意識を忘れずに、

②ほどほどの数字で満足しながら、

③**リアル口座で運用しているフォワードテスト**

（現在の相場で実際にEAを回しテストすること）のチェックを継続して行う

常にシステムはベータ版（完成していないシステム）という意識を持って、①～③の
テスト結果を元に自分自身がシステムに投じて良い金額を算出する流れが良いと思います。

なお、どの程度の期間、フォワードテストをチェックすべきかですが、
**僕自身は最低でも1ヶ月、出来れば3ヵ月間はフォワードテストのチェックをした方が良
いと考えています。**

5. フォワードテストのチェックの次はミニマムテスト

バックテストのデータはチェックした

継続してリアル口座で運用しているフォワードテストのチェックもした。

結果、リスクを呑める EA を見つけたからといって、まだまだ安心してはいけません（笑）

あなたがどれだけお金を持っていようとも、その EA を実際に稼働させるときは、必ず一番小さいポジションサイズ（ミニマム）からスタートさせて下さい。

要するに、他人が提供しているデータを鵜呑みにせず、実際に自分自身で損益を確認するひと手間を加えて欲しいのです。

このミニマムテストは最低でも3ヶ月、出来る事なら1年は行って下さい。

投資の最大の利点は、ポジションサイズを2倍に引き上げれば同じ作業量であっても、2倍の利益を稼ぐ事が出来ること。

正直・・・安定して稼げる EA を見つけ出し、その EA の正しい資金管理を実践していれば、お金っていうのは元本次第で幾らでも稼げます。（これ本当に）

だからこそ、チェックやテストは嫌っていうほどして損はありません。

- ・バックテストが良いからといって信用せず
- ・フォワードテストが良いからといって過信せず
- ・実際に自分のリアル口座でミニマムテストを行って初めて信用する。

その間に、損切りを受けることも普通にあると思いますが、**大事なことは損切りを受けながらどう稼いでいるかのチェック**なんです。

この世に損切りを受けない EA は存在しないからこそ、実際にミニマムで稼働させながら、損切りの周期や、ダメージ、ROIなどを長期スパンでチェックしていきましょう。

6. 自分が何かしらのビジネスに投資する事をイメージする

これまでも、システムを過信せず
石橋を叩いて渡る気持ちを忘れない事をお伝えしてきましたが、
まだまだ、安心してシステムを稼働させる事は出来ません。

自分で判断を下さないシステムトレードにお金を投じるのなら
絶対に忘れないでおいて欲しい1つの発想転換があります。

それは・・・『自分自身が飲食店のオーナーになった気持ちで投じる事・・・。』
現場に立つ店長さんではなく**お金だけを投じているだけのオーナーをイメージして下さい。**

飲食店の立ち上げで2000万円のお金を投じ、
店舗契約・内装工事・従業員雇用・広告費などを支払い・・・
現場に立つ店長さんと四苦八苦しながら、ようやく数字が伸びてきた。

毎月100万円近い利益を出せるようになってきて1年。
店長さんからは『もう1店舗、店舗を増やしたい』と、相談を受けたとします。

さて、あなたはどんな決断を下すでしょう。
確かに追加投資の決断をしたとしても、1店舗目で身に付けたノウハウがあるので、
2店舗目は投資金額も小さく、より大きな利益が望める事が見込めます。

おそらくこの話をサラッと聞いた人の中には、
『1年間の実績を買い追加投資を行う』という決断を取る人も少なからずいる事でしょう。

でも、システムトレードに関しては絶対に安心してはいけません。
何よりも**先に投じた元本を回収する事を第一目標にして下さい。**

追加の資金を投じるという事は、
稼いできたお金を元にポジションサイズを引き上げる事に酷似しています。(無謀な複利)

ポジションサイズを上げれば、それだけ利益も大きくなると安易に考えがちですが、
ここだけは財布の紐を締めて、**元本回収を終えてから複利を考える**ようにして下さい。

7. コツコツドカンのキッカケは資金管理ミス

少しだけ勘違いしそうなポイントがありますので、具体例を用いて説明しますね。

=====
安定的に月利 5%程度で運用できる EA があったとします。

最低の必要投資金は 50 万円。

こんな EA で元本回収・複利運用が出来るのはいつのタイミングか？
=====

簡単な算数なので、当たり前の事です

50 万円を投じて 5%のリターンですから 1 カ月の投資利益は

$50 \text{ 万} \times 0.05 = 25,000 \text{ 円}$ になります。

単純計算で 20 カ月（1 年 8 カ月）安定的に運用する事が出来たら、

50 万円の元手は 100 万円になりますよね。

大切な事は、この段階で 50 万円を出金するという事です。

多くの人はこの段階から元本回収出来たと勘違いし、

もっと稼ぎたいという思いから 100 万円で運用を始めますが、

これは大きく間違っています。

元手の 50 万円を出金し、再度 20 カ月運用した結果の 100 万円であれば、

ポジションサイズを引き揚げる事は個人の自由ですが、

元本を出金する前に安心するのは絶対に辞めて下さい。

これは裁量トレードでも同じ事です、投資でなかなか稼ぎを伸ばせない人ほど、

元本を出金する意識が薄い・・・薄過ぎる。

投資あるあるで、コツコツ稼げるがドカンと負けてしまうコツコツドカンの典型例が、

元本回収の意識の甘さと複利運用の勘違いをキッカケにしています。

元本回収さえできれば、あなたが損をする事は実質無くなる訳ですが、

僕なら、回収した元本は次のシステムに入れ込んだ方が、より良いと考えています。

8. 友人の稼いでいるシステムトレーダーの思考

実際、システムトレードで安定的な収益を稼いでいる友人の投資方法を見ても、リスクヘッジの意識は裁量トレーダーとは全く異なります。

僕たち裁量トレーダーは自分のスキルに投資するので、ある意味、**1つの人格に集中的に投資**しますが、

システムトレードは実績と統計に投資するので、ある意味、ファンドマネージャー的な思考で投資していると言えるでしょう。

具体例を出すのなら、1000万円を1人のトレーダーに投じるのではなく、100万円を10タイプのEAに投じる事により安定性を重要視している。

収益面の話なら10個の稼げるEAがあれば、極端な話、1つのEAの月利が平均1%だったとしても、全部で月利10%、年利120%になるという事ですし、

損失面なら、AというEAの収支がマイナスであっても、B, C, DというEAが保管してくれるので、月間を通じてマイナスに陥ることを極限まで回避する作戦を取っている。

出来るだけ扱う通貨ペアもバラバラに分散し、スキャル、デイ、スイングといった時間軸もEAごとに違うタイプを採用して行くことで、

突発的な暴落・暴騰があったとしても、自分の資金を守り切るスタイルを構築していくのが、システムトレードの投資法だと思います。

ゆっくり、投じて行く金額を上げて行けば、月利10%という数字も、将来的に凄い数字になりますよ（笑）

目標は投資金、1000万円ですね^^
そしたら月利10%の威力を体感できる筈です。

9. 【重要】EA 販売者は誰も損をさせたい訳では無い

ここ極めて重要なんですが、誰が何を言おうが、
どれだけ誇大広告で魅力的な表現をしようが、『投資の世界に絶対はありません』

悪質な販売業者は

- ・100%確実に・・・とか
- ・元本保証・・・とか
- ・投資しないのは勿体ないとか

あれこれセールストークを並べてきますが

結論、最終的に投資すると決断するのは、あなた自身である事を忘れないでください。

システムトレードのような自分で判断を下さない投資案件になればなるほど、
損失を負ったり、溶かしてしまうと、システムの責任にしたい気持ちは分かりますが、

システム提供者もコピートレード実践者も『別にあなたに損をさせたい訳ではありません』
(一部、悪質な業者はデータを改ざんしているケースもあるので一概には言えませんが)

自分が組み立てたシステムや、自分のトレード実績を元に、
個人投資家から資金を募り、投資金を大きくしていくのは、
投資ビジネスにおいては至って普通の事であり、

何もせずに不労所得を得る以上、絶対にリスクっていうのは呑まなければならないんです。

要するに、裁量トレーダーは自分のトレードスキルにお金を投じてお金を稼いでいる。

自分で判断を下さない個人投資家は

『自分が優秀だと判断した道具や人にお金を投じてお金を稼ごうと考えている』のです。

- ・たとえ、データ改ざんなどしていなくても・・・、
 - ・日ごろから重要指標や要人発言のチェックを怠らなくとも・・・、
- 突発的な暴落・暴騰によって多大な損失を生む事は普通にあります。

だからこそ、覚えておいて欲しい事は

その道具・人に対してお金を投じると決断したのは自分自身である事を忘れずに、

たとえ何が起きてもリスクをシッカリと呑みこむ覚悟を持ってお金を投じて行きましょう。

10. 最後に・・・このレポートを腑に落としてくれない人には何も勧められない。

- ①自分でトレード判断を下さないEAやコピートレード等の場合は
小さい利益率で満足する代わりに出来るだけ安定型の投資案件を選ぶべき

大きな収益が望めるシステムほどリスクも大きくなるのが投資の常です。
リスクとリターンは常に表裏一体ですから、自分の目的にあったシステムを選ぶべきです。
不労所得なのに、より多くの報酬を求めると大体粗悪なシステムを掴まされてしまいます。

- ②常に疑いの目を持ち、トレード実績の数字を安易に過信しない。
必ずシステム開発者が定めた最低の資金量でミニマムテストを実施する。
期間は最低で四半期、出来る事なら1年間は欲しい所。

もし、資金にゆとりがあるのなら、最低資金量よりも少し多めに入金し、
その上で最低ロットでトレードする事でより安全に投資を行うのが良いと思いますよ。
そのくらい、安全を期した方がより良い結果に結びつきます。

- ③自分が他のビジネスに投資を行っている意識を持ち、
元本回収を第一目標にして必ず元本を出金する。

正しい複利と間違っている複利を必ず覚えておき、
元本回収からスタートである事を忘れないでおいて下さい。

- ④リスクヘッジの意識を強く持ち、EAは複数個に分散させていく

1つのEAに固執するのではなく、複数個のEAや通貨ペアに資金分散して行く事により
リスクヘッジを高めて行く意識を忘れないようにする。

- ⑤たとえどんな結果になったとしても、
『お金を稼ぎたいと考えお金を投じたのは自分の判断』であることを腑に落とす。

この世で最も詐欺が多いと言われている金融業界だからこそ
真実を見抜く目を持ち、リスクをシッカリと呑みこむ事が出来た場合に限り
お金を投じて行きましょう。

上記5つの項目さえ守れていれば、
僕のようにEAを収入源の柱の1つにすることはそこまで難しいモノではありませんし、

大抵のシステムの最低投資金は30万円～50万円程度ですので、
年間1つずつシステムやポートフォリオを増やして行けば、
資産は徐々に膨らんで行きます。

僕も今まで何十個というシステムにお金を投じてきましたが、
どんなに前評判の良いシステムでも、ハッキリ言って溶ける時は溶けます。

だからこそ、何個もチャレンジして複数個のシステムを稼働させることで、
より強固なリスクヘッジを掛けて行く事が、
何十年と安定した収入を確保する最短ルートになると考えています。

なお、今回の様に僕が紹介して行くシステムは、
実際に僕が利用して、現状、安定的な成果を出す事が出来ているシステムになります。

ですから、あなたの資金が溶けた時ってというのは、僕も同様に溶けていますので、
僕に文句を言われても『それもシステム』としか返答する事は出来ません(笑)

僕も何かを勧める以上、自分のお金を投じてテストを重ね、
これならば問題ないと判断を下して紹介させて頂きますが、

『投資に絶対はない』以上、
あなた自身もリスクを吞んでリターンを狙いに行く以外に方法はないですよ。

自分でトレード判断を下す必要の無い楽さを取る代わりに、
低い利益率・高い安定性を得る。

それでも、フォワードテストをチェックして、やっぱり念には念を押して
ミニマムテストを実地し元本回収までが勝負と割り切る。

こんな思考で取り組んで行けば、
必ず良い不労所得に出会えると思いますよ^^これも継続ですね。