

-----3月9日-----

今週のアウトルック（3/9～3/13）

先週は木曜日まで円安が進み、金曜日は利益確定の円高が進むという展開でした。これは先々週とほぼ同じ状況です。

ただ、先々週まではNYダウや日経平均の動きを追うような動きはあまり見られなかったのですが、少しずつ見られるようになったように思います。

これは株価の動きを無視したドル高の力強い動きが影をひそめ、通常の動きのパターンに少し近づいたことを示しているように思います。

ドル円は99.7円の最高値を付けた後、少し弱含んでいるように思います。

今週100円の壁を超えられるかが大きなポイントになりそうですが、一時期とは違いNYダウの動きに大きな影響を受けそうです。

NYダウは今週中のGMやクライスラー、シティバンクなどのニュースであまり明るいものは期待できないように思います。そういったニュースに影響を受けて、基本的には100円の壁を突破できないのではないかと考えています。

97円から99.5円程度のレンジ的な動きを予想しています。

しかし、万が一GM破綻、シティバンク国営化などのニュースが出てしまった場合、逆に悪材料出尽くし感として受け止められ、NYダウが上昇してしまい、その動きに合わせてドル円も100円を突破することも考えられるので注意が必要ないように思います。

ユーロの先週の特徴としては、ドル円が下落する場面でユーロドルが大きく上昇するということが何度も見られました。これはユーロドル下降の行き過ぎ修正が起こっているように思います。この傾向は今週も続くように思います。

ドル円は99.7円を着けたことで、一応の達成感があるようにも思います。

ところが、ユーロ円の今年の最高値を考えた場合、129円程度までは上昇余地があるようにも思います。この点からもドル円下落、ユーロ円上昇という短期的なねじれ現象が起こることもあり得ると思います。

週前半は127円あたりまで上昇、後半は123円あたりまで下落という展開を考えています。

ポンド円もポンドドルの修正的な動きが出るようになっていきます。

ドル円にリンクしないポンド円の動きも注意する必要があります。136円から142円あたりのレンジ的な動きを考えています。

システムトレード的アドバイス

「勝率とプロフィットファクター」

システムトレードを評価する上で、勝率とプロフィットファクターという重要な指標があります。

勝率は $\text{勝ちトレード数} / \text{全体トレード数}$

プロフィットファクターは $\text{勝ちトレード平均利益} / \text{負けトレード平均損失}$ ということになります。

どちらも良いことにこしたことはないのですが、トレーダーによってどちらかをより重視する傾向があるように思います。

勝率重視はスキャルピング派、プロフィットファクターはトレンドフォロワー派（損傷利大重視）に多いように思います。

ただ、たとえば勝率が8割を超えていてもプロフィットファクターが0.25未満ですとトータル損益はマイナス、プロフィットファクターが2以上でも勝率が33.4%以下ですとトータル損益はマイナスということになってしまいます。

つまり勝率とプロフィットファクターはセットで考えていかないとトータルで利益は出ないということです。

勝率は高いのにあまり利益が出ていないという方は、一度損益リストを確かめてみる必要があるように思います。

あまりどちらを重視するという事にこだわらず、勝率5割プロフィットファクターは1以上を基本に考えてバランスを重視するという方法も非常に良い方法のように思います。

* 免責事項 *

当レポートを参考にトレードを行い、損失が生じた場合でも、責任は負いかねますのでご了承ください。