

「スキルアップトレード戦略」

～実践編：チャート戦略～

文責：福寄 儀寛

はじめに
チャートの役割を正確に定義します。

「上or下を示してくれるモノ」ではなく

- ①なりやすいパターン・波形があり、いくつかの想定シナリオを限定する際に役立つ「道標」として。(どのシナリオでも逃げ道は必要)
- ②自分の意図や行動を正確に認識する「ものさし」として。
(感情や射幸心、金銭欲などでかかったバイアスを取り除く手段)

上記の2つの意味で利用できるもの、と考えています。
利用目的は「ルールを作り、守り、実践していくこと」です。

- 1) チャートを使って場面選定(トレンドorレンジ)
- 2) それぞれの場面で確度の高いパターンを知る
トレンド時/レンジ時
- 3) Entry/Exitルールをチャート視点で決める
※金額視点は×。最悪時のカットルール以外は避ける。
- 4) チャート起点のトレードを進めやすい心構えなど

スキャルピングトレードは短時間に高回転で取引を繰り返す手法です。

そのため、瞬間判断＝「裁量」で感覚的に行っていると思われがちな面があります。しかし私の場合「感覚的な裁量トレード」は殆ど行っていません。

正しいと思われるルールを作り、それを回す。結果を見つつ修正・最適化する。運要素にできるだけ左右されず淡々と試行を重ね、期待値に収束させるイメージ。

自分の主要な時間軸を短期と中期で上下に表示しつつ
 自分の主要通貨ペアとそのクロス通貨ペアを横列に表示。
 表示テクニカルはMA20、MA5のみ

5m



EUR/GBP

EUR/USD

USD/JPY

個別材料の
影響を見る
(Brexitなど)

ユーロドルを
主に取引

ドル円は
常にCheck

4H



チャート内の3要素：MA20、MA5、現レートの配置で判断。

長期：MA20に対してMA5がどちら側にあるか

中期：MA20に対して現レートがどちら側にあるか

短期：MA5に対して現レートがどちら側にあるか



長期～短期まで
現状は全て上方向

現レート > 5MA > 20MAとすべてが上方向への勢いを示している状況なのに注目。

この位置関係で判断するため、チャート解釈に幅が少なく視点はブレない。

シンプルなチャートなので見るポイントは少なく明瞭です。
 高値安値と3要素の位置関係が最重要。
 次点として、揉み合い時に節目となっていた抵抗ライン。
 および、MA5やMA20との接点。(MA同士のクロスも)



この場面では二つの要因から上方向に張る価値がある。

(1)
 テレンドが上方向に綺麗に並んでいる。

(2)
 安値を背に高値を狙ってもリスク:リターンが折り合う。1次カットラインに使える抵抗ラインもある。
 ※上抜け済み

(1)改めて、場面選定

見るポイントはここでも2点です。

- (1)各時間軸でトレンドなのかレンジ(揉み合い)なのか
 - (2)直近高値/安値やその他の抵抗水準にCAPされてるか
- ※揉み合いの時は長めの時間軸(MA配置)を重視して見る。

5m



EUR/GBP
5M: ↓
4H: 揉合

EUR/USD
5M: ↓
4H: 揉合

USD/JPY
5M: ↑
4H: 揉合

4H



(1)改めて、場面選定

今回はどの通貨ペアも同様に「揉み合い」の場面。
 そのため、トレンドフォローではなくレンジ相場用の
 チャート(オシレータ系チャート)を用いて過熱感を見る。

5m



EUR/GBP
 5M: ↓
 4H: 揉合

EUR/USD
 5M: ↓
 4H: 揉合

USD/JPY
 5M: ↑
 4H: 揉合

4H



両時間軸の方向性がそろっている通貨ペアで5Mを見てエントリーします。タイミングがやや遅れてしまった場合などは15Mにスケールしてみるもありますが、基本は5Mでできるだけ迅速にEntryします。



エントリーポイントは複数あります。

MAを現レートが跨いだタイミング、MAがゴールデンクロスしたタイミング、直近の節目を抜けてきたタイミング、などこの場面は複数想定できます。

短期で回す場合は5M>20Mの状況下で現レートが5MAを勢いよく上抜いた場面が最もお勧めです。

主として意識する起点は直近の高値と安値。
 この位置関係を見て、リターン>リスクの場面を狙うのがセオリーです。
 このセオリーと、短期のトレンドフォローを徹底＝勝率を5割以上を
 満たせば、勝率と値幅双方で損小利大が成立させられます。
 9割・10割勝つ必要はありません。妥当な勝率で資産を増やします。



撤退ラインは
 ・タイトな値幅で
 ・節目が複数入っている
 のが理想です。

節目が複数入っていれば純粋に強固なサポートとなる点もありますし、撤退判断を安値に行く前に検討する機会が複数持てます。

MA5との接点、MA20との接点、MA同士のデッドクロスなども候補となります。

大切なのは、このトレードが成功したかどうかではなく、..

このように、複数の時間軸と、複数の通貨ペアを優先度の強弱を持ちながら明確な指標(MAの上か下か、どうクロスしているか)で判断する癖をつけること。

自分なりのルールで取引を重ねていく中で、これは良かった、これは勝ちやすい場面だ、という場面が掴めるようになってきます。そのとき「狙った根拠が変わった場合はちゃんと逃げる」癖も同時につけることが大切です。

ENTRYとEXITのルールは5分足で短期は主に見ますが、かならず4Hでもトレンドが出ているのか(現レート > 5MA > 20MA)とEXITがスケールできるかを確認しておきます。(5分足の直近高値を破ったら、4H足の高値にも良い形でトライできる形が理想です。(意外とこのルールだと自然となっています。))

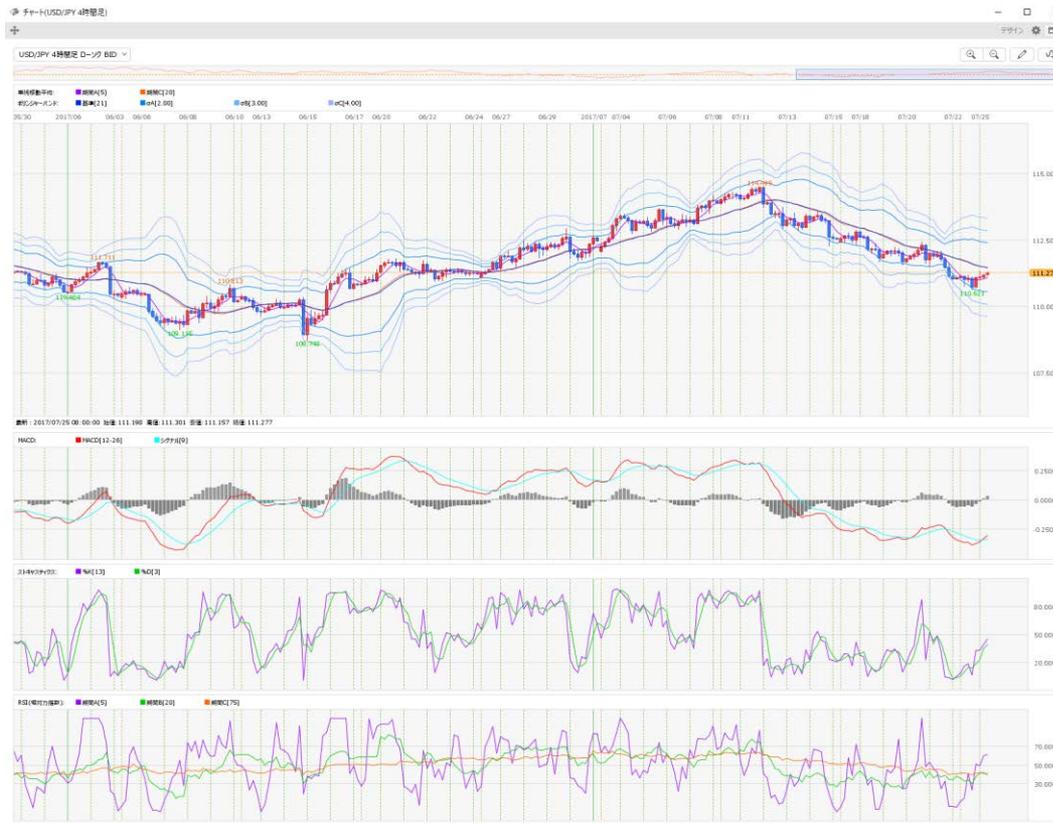


前述のシンプルチャートでトレンドフォロー系が実践できない場面では

①トレンドが出るまで待つ

②レンジ揉み合いをオシレーターの過熱感で回していく

の二つの選択肢があります。大きなイベント、IMMの偏り、市況時間帯の切替がない場面では、レンジ相場をオシレーターで回すのも効果的です。



ボリンジャーバンド
(シグマ2・3と高値/安値を主にチェック)

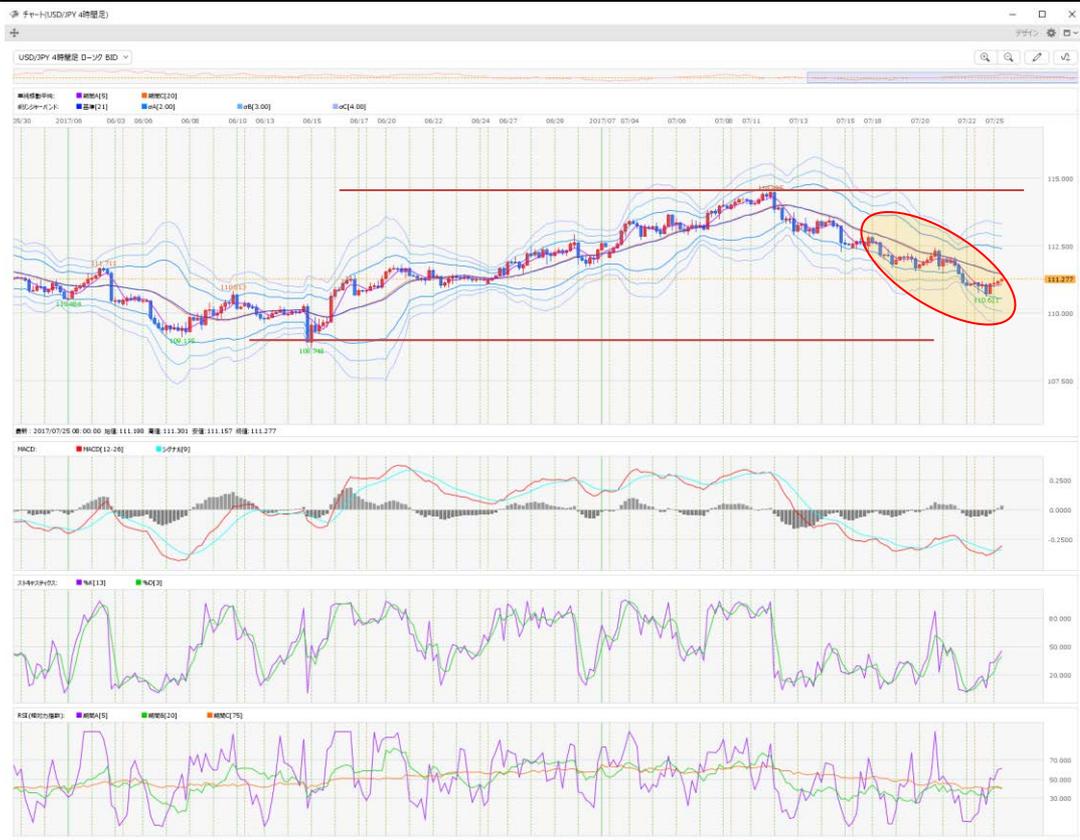
MACD
最も遅くサイン(クロス)が出る

ストキャスティクス
主にトレード指針として主軸

RCIまたはRSI(個人的にはRCIのが好み)
感度を高めにして、ストキャスの前に初動を確認する。

ここでも最重要となってくるのは

- ①高値/安値にCAPされているか、どちらにどのくらいの配分で位置しているか
更にはボリンジャーバンドで下記を見ます。
- ②ミドルバンドの傾きでその時間軸の大枠の方向感を知る。
- ③ミドルバンドとシグマ2の間の幅の収縮状況を見る。



ボリンジャーバンド

- ・ミドルバンドが傾いている
⇒この時間軸の中での長期のトレンド方向
この場合、下方向
- ・現レートから見ると、上方向、高値側の方が
値幅が取れる
- ・今の波はミドルバンドに対してシグマの各
ラインが収束する方向で閉まっている。
⇒直近のトレンドの反動、反発が来る場面

上記要素から、トレンドの収束を狙う逆張り
を選択(まずこの指針を上段部分で検討する)

3つの感度のオシレータの並びを見て、鋭敏なもの(RCI)で初動が出ていて
 ストキャスティクスでGクロスorDクロス(+理想はレベル20or80を跨いでいるか)
 さらに、MACDのクロスにもつながりそうなきれいな時系列の波形が出ている
 かを確認。この部分がチグハグな場合は流れが不明瞭ということで保留します。
 明瞭に流れが見えている場合はストキャスティクスの水準をみつつエントリー



この場面においても、EXIT判断の最重要な
 根拠は高値/安値を基準とする。

次点で、ミドルバンドとの接点、以降は
 シグマ2あたりも検討に入れるが、優先度は
 下がる。基本的に高値/安値やそれまで
 揉み合って抵抗を形成していた水準を重視
 します。

結果的にそれらがミドルバンドや、シグマと
 良い形で重なる場面などはしっかり機能する
 場面となりがちです。

なので、あくまでシグマは副次的なラインとして
 優先度を低めに見ます。

※どちらかという幅の増減をみるものと
 思っています。

ボラティリティが高い場面、低い場面を意識します。

急変動する場面。(指標、要人発言)

サプライズの発生要因。(カバー/IMMポジションの解消方向)

実需フロー特性。(ゴト一日、月末のLDN-FIX等)

チャートだけを見ているとその背景にある実需やマーケットの変化、ファンダメンタルズ的な動きやポジション調整を見失いがちです。

短期に狭い値幅を狙う \equiv ポジションが大きい短期売買ではこうした小さなギャップも大きなリスクになり得るので、場面選定を厳格に行いましょう。

主要な判断とエントリー/EXITのコントロールはチャート軸で行うとしても上記の様々な状況は「リスク要因」として把握しておくことが重要です。

その上で、大きな変動場面ではオシレータはほぼ見ません。

大きな市場変化、高ボラティリティ下においては、極力シンプルチャートでCAPされている節目との攻防を注視します。

<リスク開示>

このセミナーは、情報提供を目的としており、FX取引の勧誘を目的としたものではありません。また、実際の市場動向とは異なる可能性があり、断定的判断を提供するものでもありません。当該セミナーの内容を予告なく変更する場合があります。

当該セミナーの内容および資料のご利用によりお客様に損失が生じた場合であっても、当社および当該セミナーの講師（所属会社を含む。）は一切の責任を負いません。お取引につきましては、お客様ご自身の判断と責任において行っていただきますようお願い申し上げます。

なお、セミナーに関する著作権は、当社および作成者に属します。

お客様の私的使用目的以外での使用、他人への譲渡や販売または再配信等を行うことはできません。

<注意喚起>

店頭外国為替証拠金取引は、元本や利益を保証した金融商品ではなく、為替レートの変動等による損失発生可能性があります。さらに、レバレッジ効果（想定元本と比較して少額の資金で大きな取引ができる仕組み）や為替レートの変動等によって注文（ロスカット注文を含む）が約定しない場合等、元本を上回る損失発生の可能性があります。

特に、マイナー通貨（流動性の低い通貨）の取引をされる場合、元本以上の損失発生の可能性が高くなります。加えて、スワップポイント（通貨間の金利差調整額）においては通貨ペアやポジションの状態（売りまたは買い）によっては、受け取れる場合もあれば、支払わなければならない場合もあります。

当社は、インターネットを通じて店頭外国為替証拠金取引サービスをご提供しておりますので、お客様のパソコン・インターネット環境や当社のシステムに不具合が生じた場合等、取引ができなくなる可能性があります。また、お客様の取引の相手方は当社（相対取引）となっており、取引所取引とは異なりますので、契約締結前交付書面をよくお読みいただき、内容をご理解の上、ご自身の判断により取引を行っていただきますようお願いいたします。

商号：ヒロセ通商株式会社

業務内容：第一種金融商品取引業

登録番号：近畿財務局長（金商）第41号

加入協会：金融先物取引業協会会員番号1562