

# はじめてのMirror Trader

ポートフォリオでリスク分散ができる！

Mirror Traderで簡単ポートフォリオ作成



2012年2月2日

インディ・パ株式会社

本郷喜千

2012 Indepa, Inc All Rights Reserved.

**INDEPA**

# はじめにお読みください

<当社主催のセミナーについて>

- 本セミナーにて紹介する内容は、為替取引に関する情報ですが、通貨の種類に関わらずその売買を推奨するものではありません。
- 本セミナーにて紹介する内容は、特定の投資目的、金融情勢、あるいは特定の方のニーズを考慮ものではありません。
- 本セミナーにて紹介する情報は、信頼できる情報源から入手されたものですが、その正確性、完全性を保証するものではなく、当該情報または意見を信頼したことに起因して発生するいかなる直接的、間接的または結果的損失についても、弊社はいかなる責任も負いません。投資に関する判断の最終決定は、ご自身で判断されますようお願いいたします。
- 当セミナーにおいて、弊社の外国為替証拠金取引への勧誘を行う場合もございます。
- インディ・パ及びフォレックス・ドットコムは本日のセミナーで示す手法の利用により生ずるいかなる損害の責任を負うものではありません。

# Contents

1. 前回の復習
2. ポートフォリオとは何か？
3. なぜポートフォリオが重要か？
4. ポートフォリオの組み方のコツ
5. Mirror Traderのポートフォリオ機能
6. 簡単なポートフォリオの組み方
7. まとめ

# Mirror Traderのストラテジーの選び方（復習）

- セミオートでの選び方
- 自動売買での選び方
  1. カスタムフィルタ
  2. ストラテジーカード
  3. Excelにエクスポート
  4. ウォッチリスト（フォワードテスト）



# ポートフォリオとは何か？

- 定義 複数の運用資産の組み合わせ
- 目的 リスク分散
- 方法 リスク許容額から逆算する



# なぜポートフォリオが重要か？

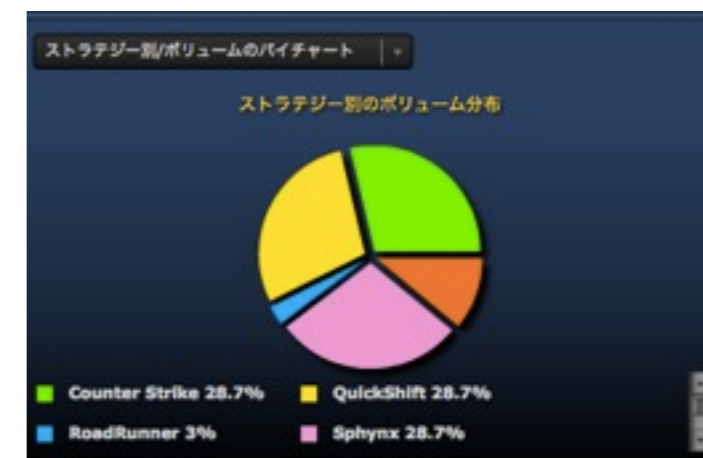
- もしポートフォリオを組まなければ、1つのEAの好調、不調に運用資金全体が左右されます。これはリスクが高い状態です。
- EAは、1本1本を開発するのに時間がかかったり、購入資金がかかったりします。
- Mirror Traderでは、ストラテジーを自分で作ったり調達したりする必要はないので、ストラテジー選びとポートフォリオ組成に集中できます。これがMirror Traderの最大の強みです。

# ポートフォリオの組み方のコツ

- Mirror Traderでは以下の方法で簡単にポートフォリオを組むことができます。
- ストラテジー／通貨ペア／Tスコア／勝率／平均利益／平均取引時間／取引回数
- ポートフォリオを組む際の注意点
  - 相関性が低いもの同士で組む
  - ストラテジーの最大ポジション数
  - 一時停止機能の設定

# Mirror Traderのポートフォリオ機能

- Mirror Traderはポートフォリオ機能が充実
  - 合計損益曲線、ウォッチリスト
  - ポジション倍率、ポジション倍率メーター
  - ポートフォリオのパイチャート
  - 履歴のバーチャート
  - 一時停止機能



# 簡単なポートフォリオの組み方

- 組んでみたポートフォリオを簡単にシミュレートすることができます。
- 合計損益曲線を見る
- ウォッチリストを活用
- 1,000通貨単位できめ細かなポートフォリオを組めるのがForex.com Mirror Traderのメリット
- 目安 証拠金1万円につき1ストラテジー
  - 例) 証拠金50万円...50ストラテジー

# 簡単なポートフォリオの組み方（例）

- 1) リスク許容額を決定します（例：50万円）
- 2) 任意の期間を選択し、Excelファイルにストラテジーの成績をエクスポートします
- 3) 300本の中から任意の50本のストラテジーを選択します
- 4) 最大ドロウダウンの合計額を計算します
- 5) 最大ドロウダウンの合計額が、リスク許容額の範囲内に収まっているかを見ます

# 簡単なポートフォリオの組み方 (例)

25	APS_PyramidS	GBPCHF	1233	131	-1739.3	3
26	APS_PyramidS	USDCHF	1111.7	180	-913.4	3
27	APS_PyramidS	GBPJPY	164.1	213	-1178.8	3
28	APS_RXS	EURAUD	1138.1	106	-286.8	1
29	APS_RXS	USDJPY	-441.7	94	-586.2	1
30	APS_SNIPER_SELLS	EURUSD	638.2	65	-452.9	1
31	APS_SportS	EURAUD	836.8	34	-507	1
32	APS_TRAIL_BUYS	AUDUSD	-16	209	-878.3	2
33	APS_V8	EURAUD	570.6	248	-525.7	1
34	APSGTS1	EURAUD	995.3	42	-584.2	1
35	AttilaFX-7	USDJPY	-4.8	30	-132.8	1
36	Auto-Action FX	EURUSD	2865.6	284	-616.2	4
37	Auto-Aggressor	EURUSD	1312.6	38	-217	1
38	Auto-EuroOne	EURUSD	-284.9	49	-400.3	1
39	Auto-EuroQuad	EURUSD	1912.6	301	-869.6	4
40	Auto-EuroRun DT	EURUSD	435.3	100	-303.8	1
41	Auto-Hedge Fund	EURUSD	2117.3	376	-1109.1	4
42	Auto-Online	EURGBP	2024.2	187	-724.9	4
43	Auto-Online	AUDNZD	1156.5	87	-1081.8	4
44	Auto-Online	USDCAD	1474.7	299	-3737.2	4
45	Auto-Online	NZDUSD	-414.2	262	-4293.3	4
46	Auto-ST5	EURUSD	672	87	-474.5	1
47	Autoincomespr	EURCHF	178.6	6	-51.9	4
48	BreadWinner	USDCHF	-22.4	9	-1062.3	1
49	BreadWinner	GBPUSD	1041.1	12	-423.9	1
50	BreakoutMaster	EURJPY	-274.8	153	-1879.3	3
51	BreakoutMaster	GBPJPY	-762	153	-1904	3
52					-49204.8	

# まとめ

- Mirror Traderのメリットは、個々のストラテジーの開発や調達にとらわれることなく、ポートフォリオの運用に監督としてのエネルギーを割けることです。
- 個々のトレードの損切りはストラテジーに任せ、監督はストラテジーの損切りに注力しましょう。
- ポイントは、1,000通貨単位でトレードできるメリットを活かし、相関性の低いストラテジー同士を組み合わせることでポートフォリオを組むことと、最大ドロウダウンから算定したリスク管理とポートフォリオの入れ替えを行うことです。

# 質問タイム

- Mirror Traderに関していただいたご質問  
にお答えします。
- Mirror Trader公式コミュニティ

❖ <http://mirrortradercom.net/>

