

今週の投資成績(3/24~3/28) [投資日記] [編集]

今週のトレード結果を以下に示します。なお、銘柄名や建て玉数は伏せさせていただきます。また、確定損益率には金利・手数料を含んでいます。保有中の銘柄は評価損益率(金利・手数料含まず)、それ以外の銘柄は確定損益率です。これらは建値に対する損益率であり、総資産に対する損益率ではありません。

システム	銘柄	トレード期間	損益率
逆張り2ドテン買い	H	2008年3月3日~保有中	-2.21%(-0.66p)
順張りドテン売り	G	2008年3月3日~2008年3月25日	-9.43%(-5.49p)
順張りドテン売り	F	2008年3月14日~2008年3月24日	-2.24%(-1.34p)
逆張り1ドテン売り	I	2008年3月18日~2008年3月24日	-7.26%(+0.01p)
順張りドテン買い	F	2008年3月24日~2008年3月27日	-4.61%
逆張り1ドテン買い	I	2008年3月24日~保有中	+0.85%
逆張り1買い	D	2008年3月24日~保有中	+7.41%
順張りドテン買い	G	2008年3月25日~保有中	+3.88%
順張りドテン売り	F	2008年3月27日~保有中	+0.13%

先週の株価上昇によって、売りシステムの内2つが月曜日に、残り1つが火曜日に、買いドテンとなりました。また、買いのみの運用である逆張り1買いDが、月曜日に買い建てとなりました。ただ、権利落ち日の下落によって順張りドテンFに早くも売りシグナルが点灯し、月曜日の買い建て分は損切りとなりました。

現在保有中の建て玉は、概ね堅調に推移していますが、先週までの建て玉がほとんど損切りとなったため、先週末に対して全体としては若干のマイナスとなっています。

特に、順張りドテンFはなかなか調子が上向かず、運用開始後のドローダウンは25%ほどになりました。また、逆張り1ドテンIとは、相変わらず相性が悪いようです。その一方で、逆張り1買いDは好調が続いています。逆張り2ドテンHはちょっと足踏み状態です。

サブプライムローン問題が表面化してから、ボラティリティの大きい相場が続いており、大引け判定、寄り付き売買型のシステムにとっては、厳しい状況が続いています。ある程度トレンドが継続すれば、収益機会も増えるのですが、日替わりでころころ変わる最近の相場では、それも難しいようです。

今年前半は厳しい状況が続くかもしれませんが、それを乗り切れば光明が見えてくるのではないかと思います。

何週間か前に、日経平均が前引けで100円強下落した時、昼のニュースの最後にアナウンサーが「日経平均は小幅安となっています」と言った一言が、今年の相場を象徴しているように思います。

その日経平均株価は、先週末比2.71%のプラスとなり、13,000円がうかがえる位置まで戻りました。ただ、その頭上にはさまざまな抵抗線がひしめいています。

昨年末比では16.25%のマイナスと、相変わらず地を這った状態が続いています。

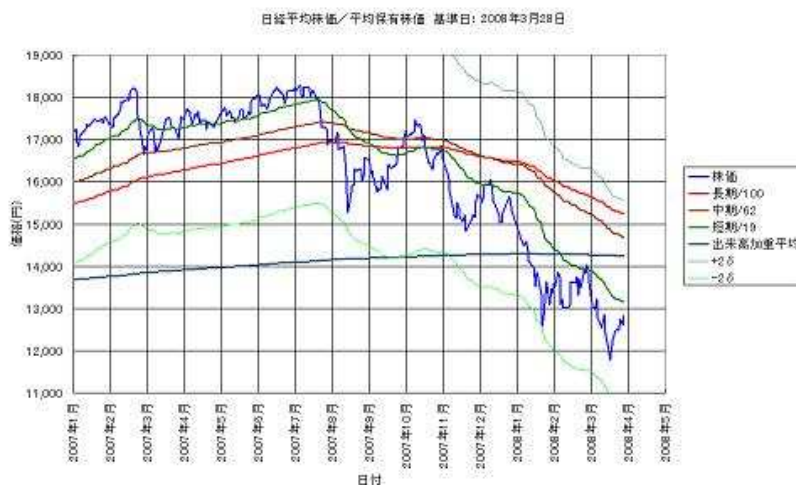
今日は実質的な年度末ということもあってか、昨日のNY市場の大幅続落にも拘らず後場から急騰しましたが、来週以降も好調が続くかどうかは分かりません。

NY市場は相変わらず不安定、国内では暫定税率問題もあり、明るい兆しはまったく見えてきません。

先週末のトレンド予報は一応的中しましたが、予想レンジが広すぎてあまり参考にならなかったかもしれません。

来週は、13,000円台へのチャレンジということになるかと思いますが、はたしてどうなるでしょうか。

以下に3月28日基準日のトレンドラインとチャンネルラインを示します。また、合わせて日経平均の平均保有株価を示します。



今週は、長く続いた中长期上昇トレンド6がついに消滅しました。そして、直近に上昇トレンド2が発生しました。
それ以外のトレンドには変化はありません。

各トレンドの安定指数は、トレンド1が5.01、トレンド7が3.29、トレンド8が4.43、トレンド9が2.04、そしてトレンド2が3.61となっています。
直近の下降トレンド9が大幅に勢力を落しました。ただし、それ以外の下降トレンドは勢力を増しています。

下降トレンド9は下降トレンド1に吸収される手前まで来ており、来週は上昇トレンド2と下降トレンド1との一騎打ちになりそうです。

ただ、短期平均保有株価や25日移動平均などの位置を考えると、下降トレンド1に分があるのではないかと考えます。

以上を踏まえた上で、来週末時点の上値目処を推察すると、下降トレンド1が抑える12,990円程度と考えます。また、来週末時点の下値目処は、下降チャネル8が支える11,340円程度と考えます。

ただ、週初に13,000円を大きく上回る場面があると、13,900円程度までの上昇余地が生じます。

最後に、「予報」を一言。

「来週末時点における日経平均株価の上値目処は12,990円程度、下値目処は11,340円程度になるでしょう。ただし、週初に13,000円を大きく上回るようだと、13,900円程度まで上昇する可能性があります。」

2008-03-28 18:57 nice!(0) コメント(0) トラックバック(0)
共通テーマ:株