

**【FX や仮想通貨の EA や自動売買の効率的な運用方法とは？】**  
**(前半は基礎的考え方、後半は発展編)**

どうもゆうです！  
読者さん、こんにちは！

さてさて、最近ですが FX や仮想通貨系のシステムが  
多く出てきておりますが

昨日もちよつと書いたのですが今号では  
FX や仮想通貨の EA や自動売買の効率的な運用方法について  
考えて生きたいと  
思います。

**【FX や仮想通貨の EA や自動売買の効率的な運用方法とは？】  
(前半基礎。)**

ちなみに、私の友人でファンドを自動売買で回している人間が  
おりまして、もうかなりの資産家の人がいるのですが

「本当の自動売買の使い方」って意外に世間では知られてません。

私はこの友人結構仲良くてよく話するのですが

もう資産何十億円とかある人なんですけど

ずっと EA 運用(裁量ではなくて)で稼ぎまくってる人ですね。

たぶん日本でも EA 系の実力ではトップ10には入るのではないかな？

と思う人です。

それで・・・プロの EA の使い方って世間では知られていませんが

大体 EA で月利5%~10% 年間で月利50%~100%くらい

出している人がプロのずっとやってる人で

いらっしゃるわけですが

彼らがどういう EA の使い方してるか??

というと「40個とかの EA を同時に回して利益得てる」

ってのが実情ですね。

なので、自動売買システムも

ひとつずつ検証して

特徴を踏まえていくつか組み合わせるってのが重要な EA 運用スキル

ですね。

ちなみにそれこそ何十億円とか運用してるプロは

EA をいくつも回しているってことなんですけど

EA ってのはそれぞれ特徴があるんですね。

例えばレンジに強い自動売買とかトレンドに強い自動売買とか。

もしくは両建てなんかで利益出す自動売買とかもあります。

それでこれらの自動売買を組み合わせていくってことを

するのだけど

自動売買の場合は最初に一番見ないといけないのが

「ドローダウン」ってもので

過去の最高損失なんですよ。

例えば毎月300 PIPS とか取るのだけど

ある月はマイナス1000 PIPS・・・とかそんなものは  
とても多いです。

コツコツドカーン系ですね。

大体無知な人ってのはこういうもの一つを使って  
「さようなら～～」していきます。

ただ・・・実は最初数百万円から始めていまや  
資産数十億円とかになっているような EA の本当のオタクってのは  
「こういう EA も利用している」んですよ。

どういうことか？というとバックテストなんかをパソコンフル稼働で  
行いますが、

一時的に例えばドローダウンで資産がマイナス50%超えるような  
EA でもですね

これがその後巻き返して、それで利益最高値を更新する  
EA も沢山あるんですね。

だから右肩上がりであるのが前提です。

ただその間にドローダウン期間ってのがあって、これが  
まあ一時的に50%とかなくなるわけです。痛いですね。

じゃあそこでどうやってこういう EA を組み合わせるか？？

ということなんだけど

「負け方から組み合わせる」ってのが実は

EA で勝ってるポートフォリオ組んでる人たちがやってることでですね。

素人のちょっと脳みそが止まってる人は

そもそも検証もテストもしないんですけど

それこそ「うわー EA 飛んだよ！ どうしてくれんだよ！」とか

素人の人が言ってる間に

プロの EA 運用者はどのような負け方をして

そこでどうやってその EA が最高値を更新するかどうか

それを見てるわけです。

**全然視点が違って「負け方から見る」ってこと。**

そんじゃあ負け方から見てどうするの？？

ってことなんですけど

実はEAによって最高ドローダウンを更新する「時期」

ってのがああるんですね～

例えばレンジ型のEA 1で

過去2008年のリーマンショックで資産を

60%減らしたけどその後持ち直して

結局2018年に利益出してきたEA。

まあこれを1つだけでは運用したくないですよ。

ハラハラしちゃいます。

一方トレンドフォロー型EA 2で2008年の

リーマンショックでむしろ最高益をたたき出しており

逆に2011年の相場で最大ドローダウンになってしまった

EAがあったとします。例として。

しかしそのEAは結局2018年には最高値を更新して

右肩上がり。

実はですね、上記のようなEA 1とEA 2があったとしたら

ここでEA 1とEA 2をあわせるんですね。

要するに資金の増え方を見ていなくて、  
「資金の減り方、減る時期、負け方にフォーカス」してる  
わけですね。

それで EA 1と EA 2をあわせるとどうなるか？というと  
それぞれの不得意相場ってのは違いますから

ここで「同時にどの EA も最高ドローダウン」みたいな事態を  
防げるわけです。

だから例えば2018年の夏に暴落があったとして

それで EA 1は最大ドローダウンを出してしまうかもしれない。

けど EA 2は意外に堅調にすごしたりするわけですね。

ちょっと利益が膨らんだりする。

となるとここで EA 1ではドローダウンで損失出てるけど

EA 2では利益が出たりするので

トータル損益で言うと、まあプラスだったりマイナス幅が  
浅くなったりするんです。

こうやって時間のリスクを EA を複数組み合わせて

消去していく

っていうことをするんです。

そうすると利益曲線があったとして両者の EA も

右肩上がりなんだけど

EA 1 だけだったらその利益曲線が「いびつ」になるわけでした

右肩上がりだけど結構波が激しくなったりするわけですね。

ただここで EA 2 を組み合わせたらそこで利益曲線は

平準化していきまして、

右肩上がりの曲線が直線に近くなっていくわけです。

こうやってプロの人たちは EA 運用してるので

そういうのを参考に EA なりは検証するといいかもですね。

なので「一つの EA だけで億万長者になるぞ〜」ってのは

かなり愚の骨頂なんですけど

そうじゃなくてこうやって使える EA とかを検証して

負け方を見ながら、

そこで EA ポートフォリオを完成させていくってのがまあ



実は大事なんです。

そこで重要なのは勝ち方ではなくて「負け方」にフォーカスして

EA ポートフォリオを組むってことでして

これが金持ちの EA 運用者がやってることですね。

しかしこの上記知識は大体の人が知りませんね。

知らないって事は怖いことです。

知らないからみんな「この EA 1つで大金持ち〜うひひひ」

って感じで仮想通貨系はやられてる人ばかりで

いわゆる情報弱者なんですけど

そうじゃなくて EA を複数組み合わせる、

そして組み合わせる時には負け方をみながら組み合わせ

時間リスクを殺すってことをするのが重要なわけです。

それで上記では EA 2つの組み合わせを例として言いましたが

実際はファンドレベルでやってる人は

EA を40個とか使ってますね。

100個は使っていない、40個くらい。

それでその40個の得意相場、不得意相場も理解してるから

ここでオンオフを彼らはやるんです。

だからまあ結局裁量なんですね。

ちなみに指標発表は対応できないことが多いので

私に色々 EA 関係のことを教えてくれる友人は

指標発表前は絶対止めてますね。

もしくは何か突発的ニュースがあったらアラートが

飛んできてそこで止めるのは徹底されてますね。

だから結局 EA 運用で利益出すのも、裁量なんですね。

それなので「1個の EA だけで億万長者うひうひ～～」

という態度ではないわけで

ちゃんと負けから見て、そしてポートフォリオ組んで

強い人は堅実に資産を増やしているわけでした

その辺は知っておいたほうがいいと思います。

そして今回はそのうちの一つで完全自動で  
ビットコインが増えるというふれこみですから

こちらのシステムも負け方から見て、その上でポートフォリオを  
組んでいくと自分なりの仮想通貨の自動ポートフォリオが  
できますね。

ということでシステム系は上記のような使い方が  
プロの使い方の一つなので参考にされると良いと思いました～

ゆう

追伸・・・ちなみに世の中の大多数は  
EAを複数組み合わせるっていう知識もなかったりしますね。

またEAを複数組み合わせるっていうところに行っても

大体勝ち方、資金の増え方から見てしまいますから  
(人間の脳みその性質のため)

うまいポートフォリオが組めないんですね。

けどそこで複数 EA で負け方から見てポートフォリオ組していく  
っていう

世間と違うことをしてる人たちだけは勝って行き  
億万長者になっていくわけです。

だから結局お金稼ぎって冷酷な視点が必要で  
大衆が「やった～あがったぞ、おれ天才」(慢心)

とか

「うわ～最高ドローダウンどうしてくれるんだ」  
(常に人のせい)

とかやってる間にですね、

その動きを冷酷に見て、負け方を分析してドローダウンを  
巻き返して利益に転換できるかとか見ながら

時間リスクを殺してポートフォリオを組んだ人が  
金持ちになるんですね。

そういう意味でポートフォリオの1つとして機能するかどうか  
を基準に見ていき検証する方向で EA 運用は考えると良いかと思います。



## FX や仮想通貨での EA や自動売買の効率的な運用方法とは？ (後半、発展。)



さてさて、上記でも少し書いたのですが

最近結構 FX や仮想通貨の自動売買系が増えてきているのもありまして

この自動売買や EA についての効率的な運用方法について

今号では考えていきたいと思います。

ちなみに、世間では EA とか自動売買では勝てないよ

って言う人もいらっしゃいますが、

実際に私の友人なんかではもう何年も月間単位で負けないで

それで EA を運用しているっていう金持ちの人とかいるんですね。

それで主には上に書いた「負けないこと」に焦点をあわせて

勝つことというよりは「負け方でポートフォリオを組む」ってことを

するわけですね。

同じ右肩上がりの A という自動売買と B という自動売買があったとして

上に書いているように

A の自動売買では2008年時点で最大ドローダウンが出ている

B の自動売買では2011年時点で最大ドローダウンが出ている

としたら

この2つをあわせたりするわけですね。

同じ2008年とか2011年に最大ドローダウンが出ていない

ってのがポイントですよ。

こうすることで何か相場変動があっても EA が対応できない場合も

他の EA が利益を補填してくれたりするわけです。

チャートでいえば利益曲線として

2008年に最大ドローだけど右肩あがり

2011年に最大ドローだけど右肩上がりだとしたら

2つのチャートを合わせたら、これ利益曲線が

平らの直線に近づいていくわけですね。

これをするわけでした時間リスクを殺していくってことを

するわけです。

実は私ゆうはEAの塾なんかも以前入っていたのだけど

基本的にこうやって利益は上がるものでして

自分もシステム運用から開始した口なんですけど

こうやって負けにフォーカスしてポートフォリオを組むのが

まず最初に大事なんですね。

バフェット名言でも1負けしないこと 2負けしないこと

3 1と2を遵守しろ

とかありますが

基本的にはこの考え方でポートフォリオを組むわけですね。

こうやってEAとか自動売買は回すものでして

それをやっていくと

トータル収益は安定してくってことですね。

だから、一番ダメなパターンは何か？というと

「これは儲かるのか！じゃあ100万円突っ込もう」みたいな

そういう投資姿勢でして

これは「検証」っていう段階を踏んでいないですよ。

ちなみに私なんかシステム運用してたときもそうだし

あとは上記の EA のプロなんかも私の友人でいるけど

彼なんかは最低でも3ヶ月は検証で小資金なりで

テストをかけるんですね。

それでその後見ているのが負け方でして

負けた後その EA が挽回していくかどうかってのを見る

わけですね。

あくまでも勝ち方、資金の増え方じゃなくて

負け方を重視しているということなのです。

それで負け方を見ながら、EA のポートフォリオ構築をして

1のEA 2のEA 3のEA・・・

ということで最終的にはこれを40個くらいに絞って

それで運用したりするわけですね。



ちなみにそのEAのプロのファンドやってる人のEAって

じゃあ特別なEAか?って言ったら違って

日本とかアメリカのインフォ業界にあるEAなんですね。

特別にファンド用にプログラミングされたものとか

そういうわけでもない。

だから結構彼なんかはこのインフォ系の内容もチェックしていて

逐次検証していたりするわけですが

見方としてはまず負け方を見るってことでして

この辺がもう素人の人とは違うわけですね。

彼なんかは昔EAを回す塾をやるって話もあったんだけど

まあちょっと流れたんだけど

私は仲が良くて個人的に教えてもらったこともあるので

この辺は良く知ってるってことです。

昔システムの回し方は彼に教えてもらってましたので。

それで、最近だとEAだけじゃなくてMQL5とかありますよね?

MQL5なんかではメタトレーダーベースでの

自動売買を構築できるんですけど

この MQL 5ではそれこそ 世界のトレーダーたちが  
エントリーしているので

彼らの成績とかトレードのやり方とかが解説されていて  
そこで月数千円とか払ったら彼らのトレードがコピーできたり  
します。

ただ日本在住の人はある程度制限はかかっているかもしれませんが  
ただ今海外では結構流行しているやり方で  
仮想通貨でのコピートレードってのもいずれ流行してくるでしょう。

それで自動売買だけじゃなくてコピートレードの  
トレーダーの合わせ方でも実はこの辺は一緒でして

やはり収益曲線を見て時間リスクを潰していくために  
トレーダーの収益曲線直近数年分が出ているものなので  
ここで最大ドロウ、損失時期が重なっていない右肩あがりの  
トレーダーを合わせてポートフォリオを組むわけですね。

こうやって複数ポートフォリオを組んでいくことで、

読者さんのトータル収益は最大化できるわけでした

そういうのを考えながら EA 系の案件は見ると良いです。

それで MQL 5 っていうのは世界のトレーダーを雇えるサービスですが

ここでもトレーダーによって EA と同じで個性がありまして

トレンドが出たときに強いトレーダー、

レンジ気味の相場に強いトレーダー

もしくはロジックでもプライスアクションの統計使うトレーダー

MA なんかを使うトレーダー

ナンピン使うトレーダー

単一ロットだけでやるトレーダー

時間軸で言えばデイトレのトレーダーや

スイングのトレーダーなんか、

まあ色々いるわけです。

ここでどうやって組み合わせっていくか？っていうことですが

やはりここでもポートフォリオは大事でした

まず収益曲線の最大ドローダウンから見るのは一緒なのですが

そこで組み合わせつつ、

またそのポートフォリオを広げていくためには

ロジックごとに分散するってのも大事だったりしますよね。

例えばプライスアクションでトレードしてます、っていうトレーダーとか

あとは MA の移動平均ベースでトレードしてますっていう

トレーダーとかいるのですが

ここでそれぞれロジックの元が違うわけですが

これも分散していくってことをするわけです。

だから実は組み合わせていく場合はやっぱり相場の知識が大事

なんですね。

大体の EA とかってロジック非公開なんですけど

その EA 観察検証してるときに

ある程度その EA の特徴把握はできていないといけない

となります。

そのためには相場知識がかなり必要でして

結局 EA とか自動売買運用のためには裁量技術が必須なんです。

それである程度ロジックが検証していると見えてくるので  
そこで、それぞれ違うロジックと思われるものを組み合わせていく  
っていうことでこういう分散方法もあるわけですね。

実はこれらってEAの塾で教えられていることでもあります。

こうやって一つの指標がいまいち機能していないようなときに  
リスクをヘッジするわけですね。

だから重要なのは

- 1 時間のリスクを分散していく。  
(最大ドローダウンの時期がずれているものを選ぶ)
- 2 ロジックのリスクを分散していく

みたいなところですよ～

それで同じトレードスタイルのリスクを分散するってのも  
ありまして、

あるEAとかMQL5のトレーダーはバリバリの

スキャルだったとします。

けど結構安定していてドローダウンも小さくて

利益は安定的。

まあかなり実力のあるトレーダーでしょう。

あとはもう一つの EA とかトレーダーは

スイングトレードでこれもまたドローダウンは小さめで

利益は安定的であったとします。

それでこの2人のトレードの時間軸スタイルってのは

それぞれ違うのですが

こういうのも組み合わせていくといいわけですね。

スキャルやデイトレーダーと

スイングトレーダーを組み合わせると。

例えばスキャルの人がいまいちダメなときでも

スイングの安定的な人、EA とかが安定して利益取ってくれたり

するわけでした

こうやってリスク分散するという方法もあつたりします。

こうやってどんどんリスク分散かけていくってのが  
EA 運用だと今のところ結果が出てきている方法ですよ。

またさらに重要なのが EA なりコピートレーダーの  
リスクリワードと勝率比の分析だったりします。

例えば何かひとつ EA を検証するとしたら

最低3ヶ月くらいは  
リスクリワードと勝率ってのを計算していくんですね。

これが個人的にはすごい大事かなと思いますね。

平均損失が1に対して平均利益が1.5で

勝率が70%の EA だったとしたら

これはバルサラの破産確率表だと

破産確率はぎりぎり0%ですね。

バルサラの破産確率表

[http://blog-imgs-52.fc2.com/f/x/w/fxwin0402/blog\\_import\\_4fc7458d6b834.png](http://blog-imgs-52.fc2.com/f/x/w/fxwin0402/blog_import_4fc7458d6b834.png)

けどここで平均損失が1に対して平均利益が1.2で

それで同じく勝率が60%だとしたら・・・

破産確率はちょっと上がってしまうわけです。

だから検証している間にその EA とかトレーダーの  
破産確率を出すってのもかなり大事でして

ここでバルサラの破産確率表なんかを当てはめて  
破産確率を出すってのも大事ですね。

それでトレーダーや EA でもかなりタイプは違って  
勝率高くて

コツコツと利益を出していくけど一回の損失が大きかったりする人で  
けどなんとかプラスにしている人もいれば

逆に勝率は捨てていて

コツコツ損きりするけど、1回の利益額が大きい人、EA なんかも  
あるわけです。

たとえば、これらの損益比率とかスタイルでも

同じくトレーダーの分散をするっていう発想がありますね。

前者の勝率重視の人や EA なんかだと、収益曲線は比較的滑らかに



増えていたりするんだけど

そこで鋭くマイナス時期で谷ができてたりするわけですね。

一方後者の収益曲線でいうと

損きを繰り返しますから徐々に減って行って

そして利益取る時に一気にもぎとりますから

一気に利益が増えるという

階段のような右肩上がりになるわけです。

だからこの収益曲線の性質の違いってのもトレーダーやEA

の個性やスタイルの違いで出てくるわけなんですけども

ここもまた違うスタイルのトレーダーで組み合わせるってことを

していくわけですね。

(ただやはり後者のトレーダーやEAが何気に長生きしますから

後者のコツコツ損き、利益はドカーンと取るトレーダーやEAを

ポートフォリオの中で多めに配置していくと良い)

だからポートフォリオって言ってもかなり奥深いものがあるんですけど

大きくはこうやってそれぞれの EA やトレーダーの負け方などを  
注目して

ヘッジしていくって言う発想が大事になります。

だから検証は必要で裁量でトレードするのと同じく

「コツコツ」やるのは大事でして

毎回コツコツとバルサラの破産確率表に照らし合わせたり

結構地味な作業にはなりますよね。

ただこういうのを続けていくとやはり EA 運用では最強になっていく

わけですので

読者さんもこういうのを意識してポートフォリオ組すると

良いと思いました。

それでこの EA なんかも勝ち方というよりは負け方からみる

ってのは重要なのでそういう視点で見ていくと良いでしょう。

それでこんなことを書くと

中には

「俺がほしいのは聖杯のEAだ！！それ一つだけで  
ずっと勝ち続けるものがほしいのだ！！」

という人もいるわけですが

これはやっぱり相場の心理が分かっていない人で

勝ち続けるっていても最大ドローダウンが

10%で右肩上がり続けるものもあれば

最大ドローダウンで90%を記録して死に体を経験しながらも

最高値を更新して右肩上がり続けるものもあるんです。

後者のEAとかも「勝ち続けてる」のだけど

実際の運用だと例えば100万円運用していて資金が10万円まで

減ってしまうわけですが

さあ、これに精神的に耐えられるかな？？って話なんですね。

すなわち大体の人はそこで稼働停止するでしょう。

結局の話 EAとか自動売買っていても

運用するのは感情もった人間ですから、

そこに配慮していく必要があるわけですね。

例えばある人は90%損失が出たら「もうだめだ、EAストップ」

とするかもしれませんし

ある人は90%損失出てもそのまま機械のような感情で  
そのまま続行するかもしれません。

もうここで差が出てきてしまうわけです。

だから上記のようなめんどくさいように思える

負けから見てポートフォリオを組むってことをするわけでした  
精神的に負担がかからないような配慮をしていく必要がある  
ってことです。

だから「自動で儲ける」「自動で稼ぐ」とか言っても

人によって全然アプローチ方法は変わるわけですが

結局最終的に生き残ってるのは最初からそういう戦略スキームを  
持って負けから考えて、心理状態をうまくコントロールできる人  
なわけですね。

なので最近多くの自動売買のツールとかシステムが

仮想通貨で出てきていますが

仮想通貨であっても基本的にその辺はFXと同じですので、

上記のようなことを意識して

ポートフォリオ組をしていくと良いということですね！！

だから大きくは

1 負けないこと

2 負けないこと

3 1と2を遵守せよ

の法則から EA のポートフォリオ組にも当てはめていくんだけど

そこで勝つこと、利益を出すことより

負けないこと、を意識して攻撃をしていくわけです。

こういうことをやり続けた人だけが金持ちになるってことなので

上記のようなことは知っておいたほうがいいでしょう。

こういう知識を得た上で色々な EA を検証していくと

自分なりのオリジナルポートフォリオを作っていくことができますね。

それでは！

ゆう

追伸・・・だから今号で書いた例えば

1ヶ月の平均損失と平均利益と勝率を割り出して

バルサラの破産確率表で破産確率のパーセントを出していく

とか、こういうのをやる必要が最低限 EA とかシステム運用はある  
ってことですね。

世間で「EA やシステムは勝てない」という言葉が流布されてるのは  
上記のような知識がないからだと思われれます。

またさらに発展だと EA ってのは最大ドローダウンってのが  
発生しますが、

この最大ドローダウンが更新されていく時ですね、

ここでどこで EA をストップする目安にするか？という

私が EA 運用教えてもらった人は大体最大ドローダウンの2倍を  
更新してしまったら

一度その EA をポートフォリオから外すんです。

といってもその時は他の EA が利益あげているからトータルでは  
プラスなんですけど

そうやって判断を繰り返すわけですね。

だから EA 運用は EA 運用なりの上記のような  
裁量が絶対的に必要なんですけど

この辺を意識しながら EA は回していくと良いわけですね～