

資産運用レポート：自己分析

1 はじめに

『続マーケットの魔術師』にトップバッターとして登場するトレーダー、スティーブ・クラークのアドバイスを引用します。

トレーダーがすると役に立つ練習は、過去のトレードを勝ちトレードと負けトレードに分けて、分析することだ。

この分析によって、どちらかのトレードでよく見られるパターンが明らかになる。

あるパターンで利益が出て、別のパターンで損が出ていると分かれば、うまくいくことを増やして、うまくいかないことを減らすべきだ。

今回の資産運用レポートでは、私自身の売買を「勝ち」と「負け」に分けて分析し、何がうまくいって、何がうまくいっていないのかを確認してみます。

皆さんのご参考になれば幸いです。

★日本株個別銘柄の通算損益（1995年～2018年）

年	勝	負	勝率	売買全体			1銘柄当たり		
				利益額	損失額	損益額	平均利益額	平均損失額	利益/損失
1996	1	0	100.0%	307,000	0	307,000	307,000		
1997	0	1	0.0%	0	-314,000	-314,000		-314,000	
2001	2	5	28.6%	539,958	-655,520	-115,562	269,979	-131,104	2.06
2002	3	9	25.0%	722,976	-703,528	19,448	240,992	-78,170	3.08
2003	4	11	26.7%	1,258,300	-1,026,280	232,020	314,575	-93,298	3.37
2004	24	4	85.7%	8,191,830	-347,430	7,844,400	292,565	-86,858	3.37
2005	25	4	86.2%	11,313,371	-478,525	10,834,846	452,535	-119,631	3.78
2006	20	17	54.1%	11,667,209	-2,700,368	8,966,841	583,360	-158,845	3.67
2007	19	25	43.2%	8,203,306	-4,895,030	3,308,276	431,753	-195,801	2.21
2008	14	51	21.5%	3,218,833	-9,599,250	-6,380,417	229,917	-188,221	1.22
2009	11	10	52.4%	784,450	-693,750	90,700	71,314	-69,375	1.03
2010	0	2	0.0%	0	-57,790	-57,790		-28,895	
2011	33	41	44.6%	1,773,059	-1,729,407	43,652	53,729	-42,181	1.27
2012	46	25	64.8%	4,304,132	-691,799	3,612,333	93,569	-27,672	3.38
2013	41	18	69.5%	6,662,371	-397,343	6,265,028	162,497	-22,075	7.36
2014	24	22	52.2%	970,540	-465,293	505,247	40,439	-21,150	1.91
2015	5	8	38.5%	614,930	-337,504	277,426	122,986	-42,188	2.92
2016	3	1	75.0%	437,463	-27,679	409,784	145,821	-27,679	5.27
2017	8	2	80.0%	1,077,500	-62,598	1,014,902	134,688	-31,299	4.30
2018	15	5	75.0%	2,214,166	-130,010	2,084,156	147,611	-26,002	5.68
通算	298	261	53.3%	64,261,394	-25,313,104	38,948,290	215,642	-96,985	2.22