金(NY ゴールド)を指標としたスプレッドボリンジャー考察

2023 年 12 月に過去最高値を付けた NY 金ですが、FRB の利上げサイクルが終了し、2024 年 の上半期にも利下げに転じるというマクロ金融環境の転換があれば、NY 金のさらなる押し上げ要 因となることは言うまでもありません。また、NY 金と米ドル、株式は相関が低いので、分散投資の観点からも注目できるでしょう。

そんな中、今回のレポートでは、NY 金価格を参照指標(シンボル 2) にしたスプレッドボリンジャーの短期トレード例をご紹介したいと思います。

NY 金(参照指標、シンボル 2) には、

- ■GLD:SPDR ゴールドシェア(シンボル:GLD)という金価格に連動する ETF。ニューヨーク証券取引所に上場されています。
- ■XAUUSD:NY 金に連動する CFD。 ほぼ 24 時間取引されているので、FX との比較でも利用可能でしょう。

などが考えられますが、他にももっとあるかもしれません。

今回の検証は、XAUUSD を使って、ETF や個別株の具体例を挙げてみます。

※検証は、SAXO(サクソバンク)の XAUUSD を利用。なお、XAUUSD は NY 金先物と同じ時間 帯で取引されています。取引時間は東部標準時で 18 時から翌 17 時まで(日本時間では、冬時間基準で考えると、午前 8 時から翌午前 7 時まで)。よって売買シグナルは、日本時間の午前 7 時に確定します。

※なお、GLDを使っても検証可能なので、GLDを使った検証結果は各自で確認してください。

さて、取引銘柄と検証結果を見る前に、スプレッドボリンジャーのパラメーター設定などを確認して おきます。



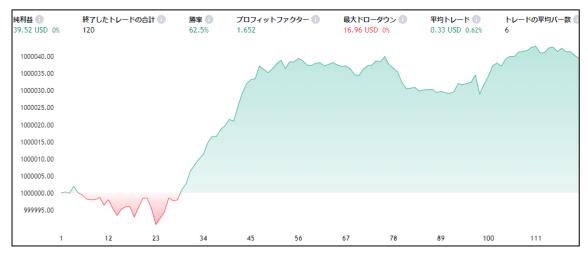
今後、NY 金が上昇していくと仮定すると、NY 金上昇時に各銘柄(ETF や個別株)が XAUUSD に対して割安(売られ過ぎ)になったタイミングでの買いが適切だと考え、検証は「買い」のみを行いました。標準偏差については、ボリンジャーバンドの一般的なパラメーター"2"と"1"を利用。スプレッドボリンジャーのオリジナル"1.5"と"0.5"にした場合は、皆さんの方で検証してみてください。また、これまで述べてきた通り、取引銘柄の Price Change%は"0"にします(スプレッドボリンジャーの効果のみを検証したいため)。

それでは、各銘柄の検証結果を見てみましょう。

なお、今回の結果は皆さんのスプレッドボリンジャー・ストラテジーで検証可能なので、ぜひ行って みてください!

■GDX

金鉱株 ETF でポピュラーなのは、ヴァンエック金鉱株 ETF (VanEck Gold Miners ETF、シンボル: GDX)。金鉱に関連する世界中の上場企業の中小型株から大型株まで幅広い銘柄で構成。

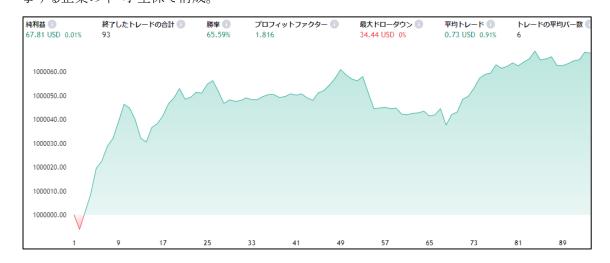


※発注サイズは1単位で設定(以下、同)。

GDXJ

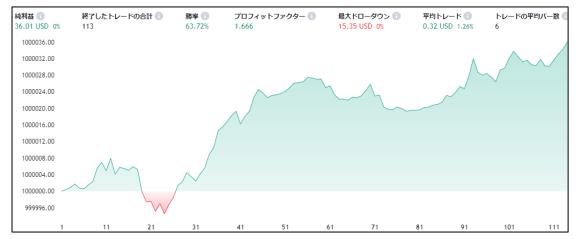
ヴァンエック中小型金鉱株 ETF (VanEck Junior Gold Miners ETF、シンボル: GDXJ)。

NYSE Arca Gold Miners Index に連動する投資成果を目指した ETF。主に金や銀の採掘に従事する企業の中・小型株で構成。



AU

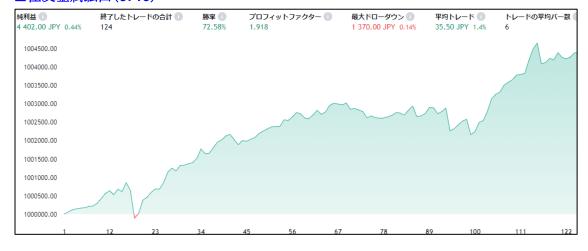
アングロゴールド・アシャンティ(AngloGold Ashanti、シンボル: AU)。ニューヨーク証券取引所で取引されている米国株。



■金価格連動型上場投信(1328)



■住友金属鉱山(5713)



いかがでしたか。

関連銘柄を全て検証したわけではありませんが、各銘柄ともそれなりの成果が出ているようです。 他にも多数の候補銘柄が考えられるので、興味ある方はオリジナルの銘柄を発見してみてください。なお、XAUUSDは FX にも利用可能です。このあたりは、また書きます!

以上

本セミナー/資料、および、検証に対するご注意

- ■本セミナー資料の内容は、作成時点において信頼できると判断した情報やデータ等に基づいていますが、その正確性、完全性等を保証するものではありません。
- ■本セミナーで得た情報の利用により生じた損害について当社は責任を負いません。
- ■本セミナーで紹介した手法による実際の取引はご自身の判断と責任で行うものとし、その取引結果 等について当社は責任を負いません。
- ■本セミナー資料に記載されている内容は、その全部か一部かを問わず、当社または情報提供者等に 無断で転用、複製、再配信、ウェブサイトへ投稿や掲載等は行うことはできません。
- ■先物等の取引は、有価証券の価格や指数、貴金属その他の商品相場または金利等の変動によって 損失を生じるおそれがあります。
- ■取引にあたっては、十分に仕組みやリスクをご理解頂いた上で、ご自身の判断にてお取引をお願いいたします。