

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す。


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。

パラメーター	プロパティ	スタイル
Symbol_2	SAXO:XAUUSD 	
MAの期間	20	
Long_EntrySigma	2	
Long_ExitSigma	1	
Short_EntrySigma	2	
Short_ExitSigma	1	
<input checked="" type="checkbox"/> ロング 		
<input type="checkbox"/> ショート 		
<input type="checkbox"/> Sign_Reverse 		
<input checked="" type="checkbox"/> Alert_ON 		
Alert_Label_Long_Color	 	
Alert_Arrow_Long_Color	 	
Alert_Label_Short_Color	 	
Alert_Label_Short_Color	 	
Price Change % (Long)	0	
Price Change % (Short)	0	

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。