

2024/08/03(土)

21:00 ~

TAK1123にJoin

VRC株式投資座談会

Stock Investment Symposium



お願い事項

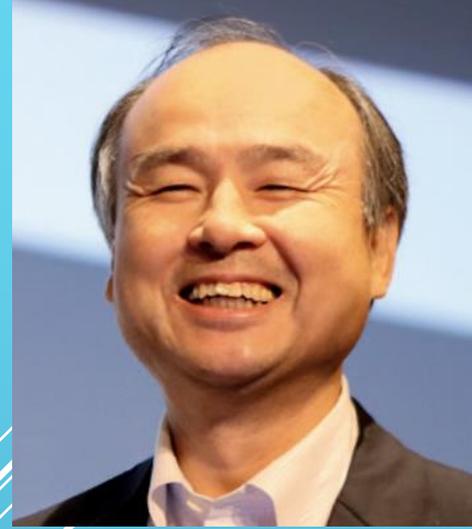
- ・本イベントは株式投資の勉強、情報交換会がメインです。
- ・個別株等の情報が出てきますが、投資を推奨しているものではありません。投資の判断は自己責任でお願いします。
- ・投資商品等の宣伝、営業、勧誘などの行為は
ご遠慮ください。
- ・投資は自己責任でお願いします。投資にかかわるいかなる損害
において主催者、参加者は責任をとりません。
- ・入退場自由。

経営者 & 投資家

- 自分で考えて、自分で判断すること
- 判断したことに対する責任を取る
- なので、投資は自己責任と言われる
- だから投資は難しい仕事



個人投資家は常に勉強が必要



VRC株式投資座談会のビジョン

- 個人投資家は継続的に学習する姿勢が必要
- PDCAサイクルを回すことでレベルアップ
- VRC株式投資座談会では、一緒に学ぶ環境を提供したい。

主催者自己紹介



本業：会社員

株式投資経験：7年

TAK
1123

ミニオプション
マイクロ先物



日本株
(個別/ETF)



米国株
(ETF)

株式投資トピック

- ・ 日本個別株 システムトレード開発、運用
- ・ ミニオプション・マイクロ先物勉強,実践中

J Qunats 株式投資コンペ参加実績

- ・ ファンダメンタルズ分析チャレンジ 成績：上位15%
- ・ JPX Tokyo Stock Exchange Prediction 成績：中位

1. 今週の日経平均は？

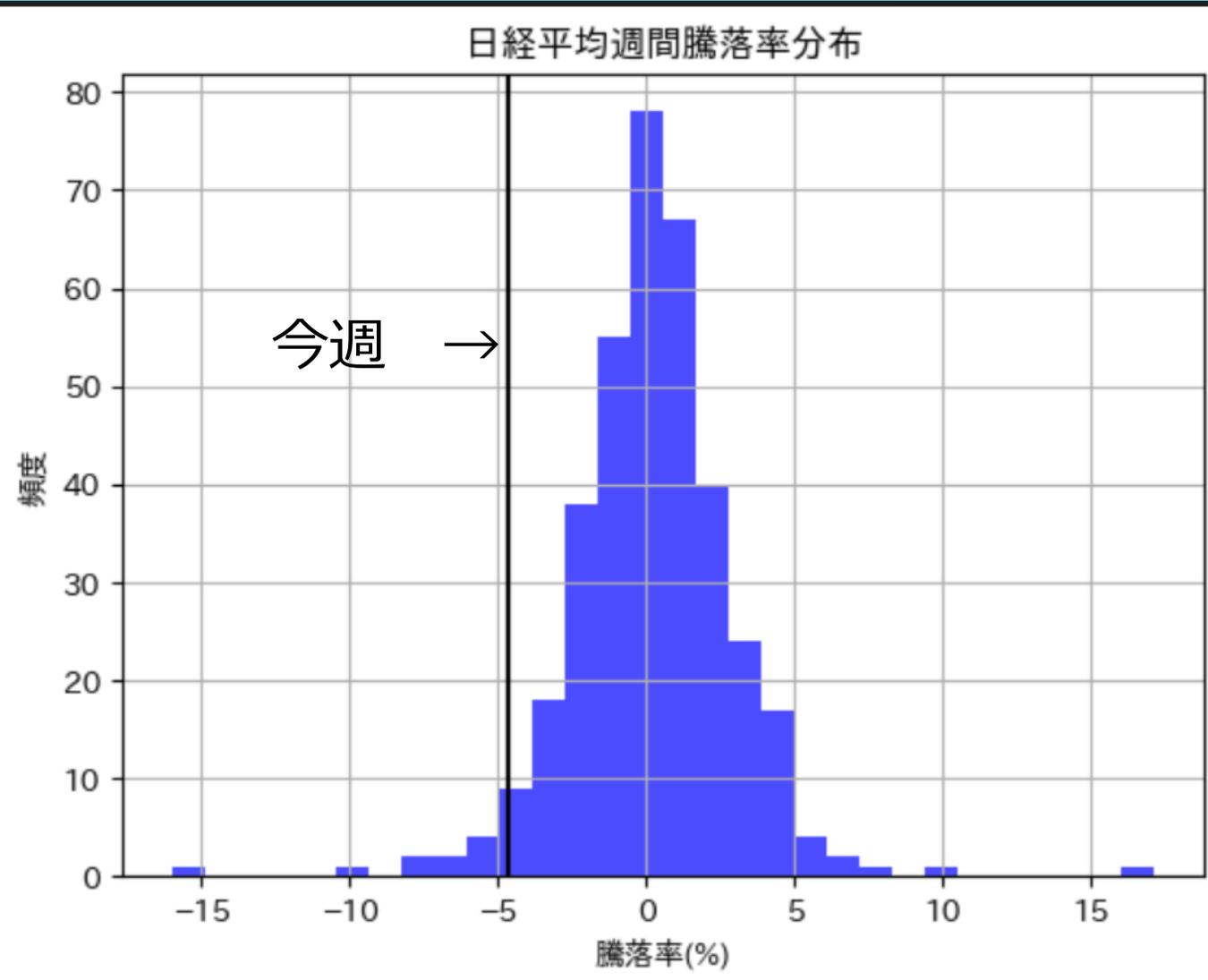
日経225 (NK225)

よくわからない
パニック相場になっている



- 日経平均は、大暴落(下落幅だと歴代2位)
- 防衛ラインと思われた37000円も軽く突破された

日経平均週間騰落率分布



- ・今週は下位5%程度に入るくらい急激な下げに見舞われた

プライム市場騰落レシオ

2024-08-02 プライム市場騰落率

Date	上昇銘柄数	下降銘柄数	上昇銘柄率(%)	25日騰落レシオ	15日騰落レシオ	10日騰落レシオ	6日騰落レシオ
2024-08-02	23	1653	1	82	70	60	79
2024-08-01	108	1566	6	90	86	68	88
2024-07-31	1474	189	88	98	95	75	89
2024-07-30	461	1179	28	98	90	69	78
2024-07-29	1598	72	95	105	91	76	72
2024-07-26	724	887	44	96	74	66	44
2024-07-25	283	1356	17	97	77	76	39
2024-07-24	129	1528	7	104	87	84	59
2024-07-23	1150	484	70	116	99	107	80
2024-07-22	243	1404	14	107	94	92	76
2024-07-19	509	1134	30	121	101	93	116
2024-07-18	476	1163	29	118	108	106	125
2024-07-17	1158	472	71	120	119	121	166
2024-07-16	842	795	51	113	124	114	126
2024-07-12	1029	601	63	119	130	113	101
2024-07-11	1279	364	77	119	123	104	101
2024-07-10	663	943	41	111	113	95	90
2024-07-09	1120	488	69	108	121	104	99
2024-07-08	510	1117	31	104	122	111	87
2024-07-05	313	1341	18	110	119	130	93
2024-07-04	1014	594	63	124	143	144	121
2024-07-03	1010	621	61	124	127	135	120
2024-07-02	890	731	54	115	119	136	143
2024-07-01	815	808	50	112	113	148	159

騰落レシオは低いなか、上昇銘柄率の上下振れが激しい



ボラティリティーが高く、難易度の高い相場と一般的に言われる。

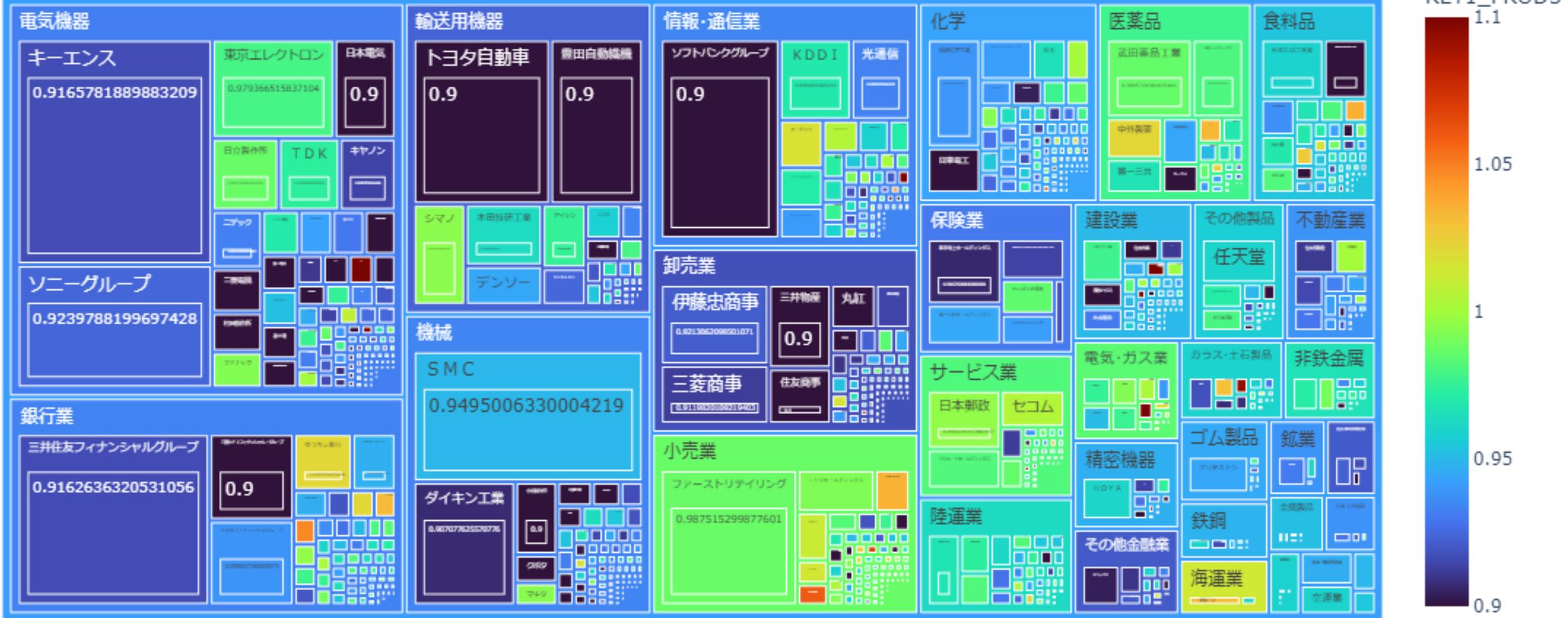


インバース, ショート系

→常時監視しておかないと、いつ来るかもわからない大きな反動で焼かれることもあるので、初心者はショート系は避ける方がよいと思う。

今週のプライム市場騰落率分布

過去5日間の累積リターンを表示する 1.1以上0.9以下のものはそれぞれ1.1,0.9に変換する



- ・ ハイテク系銘柄が壊滅的
- ・ 内需、ディフェンシブ系銘柄は比較的下落から逃れている

日経平均VIX考察

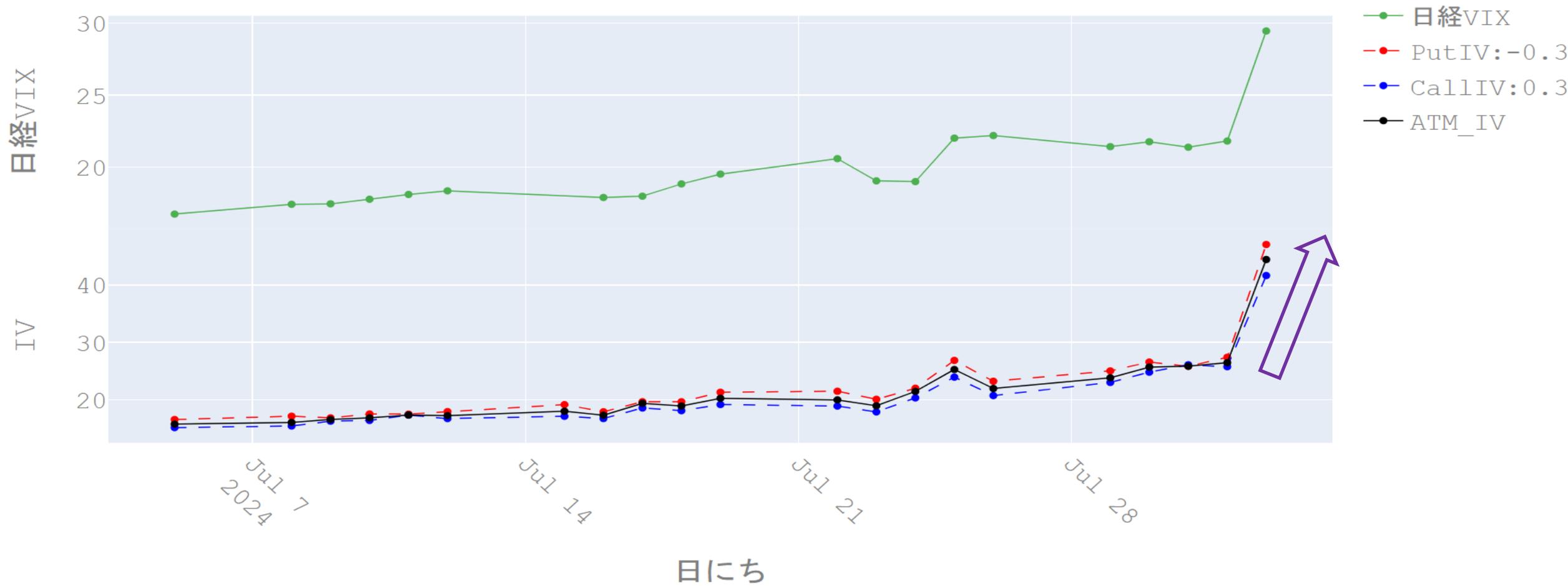
^N225のチャートを描写します



- 日経VIXが急上昇(30近く)。年初来最高値

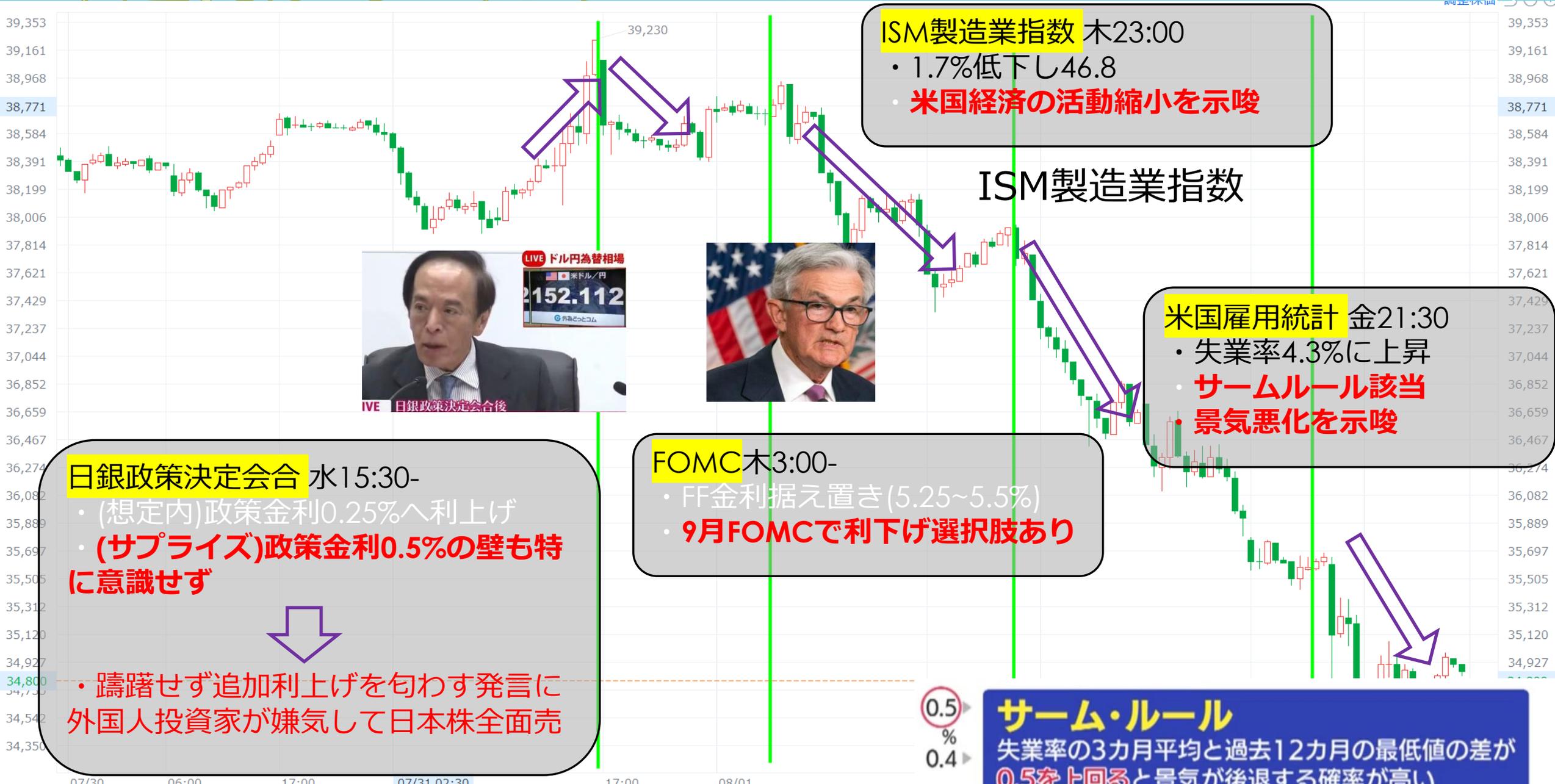
日経平均VIX考察

日経VIX, ATM付近オプションIVの推移



・ATM付近のオプションIVがここまで急激に上昇するのはまれ

今週何があったの？



ISM製造業指数 木23:00

- 1.7%低下し46.8
- **米国経済の活動縮小を示唆**

ISM製造業指数

米国雇用統計 金21:30

- 失業率4.3%に上昇
- **サムムルール該当**
- **景気悪化を示唆**

FOMC 木3:00-

- FF金利据え置き(5.25~5.5%)
- **9月FOMCで利下げ選択肢あり**

日銀政策決定会合 水15:30-

- (想定内)政策金利0.25%へ利上げ
- **(サプライズ)政策金利0.5%の壁も特に意識せず**

↓

- 躊躇せず追加利上げを匂わす発言に外国人投資家が嫌気して日本株全面売

0.5%
0.4%

サムム・ルール
失業率の3カ月平均と過去12カ月の最低値の差が**0.5を上回る**と景気が後退する確率が高い

今週の日本株

日経平均
大幅下落
35909円



金融政策
不透明



米国経済
不透明



地政学
リスク

色々な不透明なこと



- ・日銀の迷走、信頼性低下
- ・日本政府の為替介入
- ・円高へ逆回転
- ・外国人の強烈な売



- ・米国大統領選不透明
- ・ハイテク株(AI)の一極集中
- ・AI投資回収プロセス不明
- ・米国経済失速



- ・地政学リスク
- 第5次中東戦争リスク

日経平均(長期)



- ・ 200日移動平均線を下回ると、200日移動平均線が強い抵抗になる。

日本株 部門別売買動向



投資主体別 売買状況



日経平均株価

日付	日経平均株価	日経平均 変化(週)	海外	個人	個人(現金)	個人(信用)	投資信託	信託銀行	証券自己
2024-07-26	37,667.41	▼5.98%	-565,910	+505,065	+275,300	+229,765	+44,970	+25,663	-259,233
2024-07-19	40,063.79	▼2.74%	-245,954	+251,201	-678	+251,879	-58,059	-25,777	-31,824
2024-07-12	41,190.68	▲0.68%	+128,868	-77,360	-276,357	+198,997	-150,537	-73,334	-2,320
2024-07-05	40,912.37	▲3.36%	+183,692	-496,643	-511,028	+14,385	+103,253	+51,827	+19,743
2024-06-28	39,583.08	▲2.56%	+123,974	-488,587	-383,971	-104,616	-6,544	+1,599	+419,476

7/26週

・外国人投資家と機関投資家の強烈な売り

VS

・個人投資家の逆張り買

落ちるナイフをつかんで、身動きが取れない個人投資家増加が推測される

おまけ

2024/8/2

2024/7/9

2024/6/20

2024/6/18



ヒンデンブルグオーメン The Hindenburg Omen  @Hindenburg · 3時間 ..

Hindenburg Omen Update

The Hindenburg Omen did trigger at the close of the U.S. market on Aug 2.

8/2米国市場終値において、ヒンデンブルグオーメンが点灯しました。

[#ヒンデンブルグオーメン](#)

[#HindenburgOmen](#)



ヒンデンブルグオーメン The Hindenburg Om  @Hindenburg · 7月10日 ..

Hindenburg Omen Update

The Hindenburg Omen did trigger at the close of the U.S. market on July 9.

7/9米国市場終値において、ヒンデンブルグオーメンが点灯しました。

[#ヒンデンブルグオーメン](#)

[#HindenburgOmen](#)



ヒンデンブルグオーメン The Hindenburg Om  @Hindenburg · 6月21日 ..

Hindenburg Omen Update

As of the close of the U.S. market on Jun 20, the Hindenburg Omen is still lit. It was triggered on Jun 18.

6/20米国市場終値において、ヒンデンブルグオーメン点灯中です。 6/18に点灯しています。

本日の動画(39:00→55:00)

マケデコポートフォリオチェックシート

Tomoya Kitay...

ファクター投資の論文で言われていることと、実際の日本株のバックテストではことなる結果を示すことが多いので注意が必要。バックテストベースなので今後も続くかわからないですが、マケデコでの議論を参考に、今後も続く可能性が高いと考えるものを採用。なお、リスクを把握して*意図的に*傾けている人はそのリスクを理解していればOK。

期待される収益・シャープレシオの期待値が下がる可能性のある観点

#	観点
A	日本株において、ローテーションが発生しやすい指数(特に時価総額やグロース)に対して高い銘柄 or 低い銘柄のみでポートフォリオを構成する
B	長期間保有するポートフォリオでROEが低い銘柄でポートフォリオを統一する(高いROEで構成することのリスクはそこまでは高くない)
C	株価の直近12ヶ月の上昇率、ボラティリティが上位の銘柄に投資する

期待される収益・シャープレシオの期待値が上がる可能性のある観点

#	観点
D	翌年の予想ROE/予想配当利回りの上位銘柄をポートフォリオに多めに混ぜる
E	金(SPDR、NEXT FUNDSなどの国内ETFで可能)をポートフォリオに混ぜる

その他 information



VRC株式投資 座談会



2023/04/15



プロフィールを編集

TAK1123

@fdfpy1123

Oculus quest2を買ってからVRの世界を楽しんでいます。VRCで遊んでいます。主にVRC垢です。VRC以外：株式投資やっています。日本個別株,ETFに加え、ミニオプション、マイクロ先物のトレードをやっています。VRChatで「VRC株式投資座談会」を隔週土曜日21:00より開催しています。#VRC株式投資座談会

📍 Japan Hiroshima [🔗 discord.com/invite/3u8eTax...](https://discord.com/invite/3u8eTax...)

📅 2016年12月からTwitterを利用しています

- # ルール
- # みんなの写真置き場
- # 役立つ情報
- # 雑談チャンネル

個別株専門



Attention!!

ボイスチャンネル +

test

🔊 一般

JPX TOKYO STOCK EXCHANG... +

はじめに



VRC株式投資座談会のディスコードもよろしくね

● tak1123

VRC株式投資座談会主催



Join Friends 24 >

Groups >

Join the Jam >

Download >



VRC株式投資座談会

Stock Investment Symposium

VRC株式投資座談会

● 2 22 TAKG.1159

Overview

Announcement

Instances

Gallery

Members

Invites

Settings

Banned Users

Announcements

1% (土) 21:00- からVRC株式投資座談会開始します。

VRC株式投資座談会のグループを作りました。

VRC株式投資座談会Newポスター

VRC株式投資座談会って？

隔週土曜日、21時から開催している株式投資や、FX、仮想通貨など、投資好きなVRChatterが集まって、楽しくお話ししたりするイベントです。



初心者さんからベテランの方までみんな仲良し♪



主催
TAK1123

ハッシュタグ
#VRC株式投資座談会

どんな事をやってるの？

主催のTAKさんが、その週にあったトピックスや市況についてのLTを開催その後は、初心者さんグループ、経験者グループに分かれての交流会♪



LTを聞いたり★



楽しく話したり★



分からない事は気軽に聞いてね♪

ハッシュタグ
#VRC株式投資座談会

初心者さん大歓迎！

株とか良く分からない、難しそう。FXとか怖い、仮想通貨って危ない？まったく知らなくても、全然大丈夫！皆優しいから気軽に聞けちゃいます♪



株以外の話だってOK!



平日も株クラで

遊んだりしてます。



私も初心者です★

ハッシュタグ
#VRC株式投資座談会

ルールは守って！

株式投資の勉強、情報交換がメインです。投資商品等の宣伝、営業、勧誘、ナンパなどの行為は、一切NGです。投資は自己責任でお願いします。投資にかかわるいかなる損害において主催者、参加者は責任をとりません。ルールを守って楽しい株クラライフを楽しみましょう。



ダメ！絶対！
怪しい話に騙されないで

ハッシュタグ
#VRC株式投資座談会

Thank you for しおびく@VRC さん



しおびく@VRC

次回は 8/24 21:00-予定



グループ分け(目安)



グループ分け(目安)



各トピックで座談したい人は
看板持って行っていただき
座談してください。