



実践FBPS 株式投資



野良愚羅馬

はじめに

この本は、3年で資金を2倍にするFBPS投資法の実際の運用サンプルを記録する目的となる。本質的にコンピュータによる自動売買+私個人の感覚を用いることになるため、そういう意味では新しいシステムが構成されるために、運用パフォーマンスが自動売買システムと乖離せざるおえない。

とはいえ、人間が関与して機械よりパフォーマンスが悪化するようでは、何をやっているやらわけわからなくなるので、もちろん、システム売買の成績を超えていくつもりでやるのである。

投資ルールは、FBPS投資法の原則にのっとり、基本的には1年間ホールド。ただし、場合によっていつ売買するかは、価格をにらんだ展開にもなるので、必ず1年でというわけではない。

銘柄選択は、FBPSのソフトウェアでかなりの部分を行ってくれるわけであるけれども、ソフトウェアの癖による悪い選択があることもわかっているので、それは排除する。すなわちFBPSの提示する銘柄の監査を行い実際に売買することになる。

また、銘柄選択というのは、株式投資における重要なパートではあるけれども、その他にマネーマネジメントの問題もあるし、売買の時期の問題もある。FBPSのソフト自体では、そこらへんは運用者の裁量にまかされているので、そのベンチマークというかサンプルとして開発者の私が記録していくということである。

4月5日

さて、FBPSの実践編ということで、仮想売買ではあるけれども、割と真剣にポートフォリオを組んでいこう。

FBPSの原理であるヴァリュース株投資は、のんびり着実に利益が増えるメソッドではあるけれども、付随する面倒くささもあって、まあ、その辺のニュアンスが伝われば面白いと思う。

とりあえず、軍資金は1000万円。仮想売買、取引手数料なし、配当なし、税金なし、信用売りも場合によっては行うぐらいの設定で、日経平均を+20%程度アウトパフォームするのが目標となる。

無理？さあ、やってみればわかることである。

軍資金1000万円は、わかりやすくするための仮想的な数字。

その他細かいことを省くのは、処理が面倒くさいというせいでもある。

1000万円で一手100万円で10手という感覚。

いずれにせよポートフォリオを組まないで確率分布による優位を得ることができないので、10銘柄に分散投資するということである。

4月4日の日経平均の終値は9820円であった。

しばらくは10手分の銘柄選択が必要なので、週に1銘柄ずつ選択していこう。

今週の一手は、FBPSおなじみの1966：高田工業所。

285円で3200株買いとする。

目標株価は1400円。およそ3年がかりかも知れない。

4月

2012年4月

3月末の配当落ち前は日経平均10000円超えと上昇相場が見られたが、4月に入って揉みあい調整局面へと変わったようである。

5月になると、3月末の決算の発表が行われて、FBPSでの目標株価もたくさん変更されることになる。

FBPSによる投資は1年ホールドが基本であるけれども、時期的にいうなら、新しい決算が発表されて、それが落ち着いたところから購入されて、そこから1年という感じが基本ではある。

値上がりが不十分なら、もう1年ホールドすることもあり得るけれど。

決算内容が悪化した場合は、基本的にポートフォリオの組み換え対象になるので、決算発表は個別株にとってはすごく重要なイベントなのである。

4月12日

さて、週に1回のペースで少しずつ、キャッシュを株に変換していく。

4月に入ってから、日経平均は9500円前後に5%ダウン。

いわゆる調整、揉みあい基調であり、仕込みどきと考える。

今週の銘柄は、1771：日本乾溜工業（株）

152円で6500株買いである。

目標は2倍であり動きの弱い株であるので、目標に到達するなら即処分の方向。

トレードリスト

ID	<u>コード</u>	会社名	<u>PF</u> <u>R</u>	<u>PF</u> <u>ER</u>	F B P S	日付	売 買	株数	取引 株価	現在 株価	投資額	評価額	利益 率
1	1966	(株)高田工業 所【1966】	0.185	1.495	1,536	2012- 04-05	買	3,200	285	284	912,000	908,800	- 0.35%
1001	1771	日本乾溜工 業(株)【1771 】	0.255	2.052	600	2012- 04-12	買	6,500	152	153	988,000	994,500	0.66%

現金：円 総資産：10,003,300円

4月20日

今週の購入銘柄は、日本リーテック(株)【1938】

P B R	0.49	P E R	2.95
-------	------	-------	------

とお手ごろ価格という感じ。

目標900円というところで2000株買いとしよう。

トレードリスト

コード： 取引価格： 株数： 買 売

ID	コード	会社名	<u>P</u> <u>R</u>	<u>F</u> <u>E</u> <u>R</u>	F B P S	日付	売 買	株数	取引 株価	現在 株価	投資額	評価額	利益 率
1	1966	(株)高田工業 所【1966】	0.179	1.438	1,527	2012- 04-05	買	3,200	285	273	912,000	873,600	- 4.21%
		日本乾溜工 業(株)【1771 】	0.252	2.012	596	2012- 04-12	買	6,500	152	150	988,000	975,000	- 1.32%
		日本リーテッ ク(株)【1938 】	0.418	3.628	913	2012- 04-20	買	2,000	380	382	760,000	764,000	0.53%

現金：7340000円

総資産：9,952,600円

4月26日

日経平均9500円前後で調整がずっと続いているようだ。
というわけで、たまには信用売り銘柄を選んでみよう。

<http://fbpsixjp.appspot.com/stock/ViewCode/2159>

フルスピード：2159

P B R	47.86	P E R	-2.94
-------	-------	-------	-------

過大評価されすぎと考える。

25250円40株 信用売りである。

ID	コード	会社名	P F R	P F E R	F B P S	日付	売買	株数	取引株価	現在株価	投資額	評価額	利益率
1	1966	(株)高田工業所【1966】	0.179	1.438	1,527	2012-04-05	買	3,200	285	273	912,000	873,600	-4.21%
1001	1771	日本乾溜工業(株)【1771】	0.252	2.012	596	2012-04-12	買	6,500	152	150	988,000	975,000	-1.32%
2001	1938	日本リーテック(株)【1938】	0.418	3.628	913	2012-04-20	買	2,000	380	382	760,000	764,000	0.53%
3001	2159	(株)フルスピード【2159】	24,400.000	-3.891	1	2012-04-26	売	40	25,250	24,400	1,010,000	1,044,000	3.37%

現金：6330000円 総資産：9,986,600円

5月7日

日経平均が9100円台に急降下。

どうなるんでしょうね。

今週の銘柄は、ウチダエスコ(株)【4699】

PBR	0.57	PER	4.03
-----	------	-----	------

という数値で調度おいしいところ。

448円で2000株 買いとす。

トレードリスト

ID	コード	会社名	PFR	PER	FB PS	日付	売買	株数	取引株 価	現在株 価	投資額	評価額	利益率
1	1966	(株)高田 工業 所【1966 】	0.178	1.448	1,544	2012- 04-05	買	3,200	285	275	912,000	880,000	- 3.51%
1001	1771	日本乾溜 工業(株)【1771 】	0.262	2.119	603	2012- 04-12	買	6,500	152	158	988,000	1,027,000	3.95%
2001	1938	日本リ ーテッ ク(株)【1938 】	0.404	3.542	923	2012- 04-20	買	2,000	380	373	760,000	746,000	- 1.84%
3001	2159	(株)フル スピー ド【2159 】	25,000.000	- 3.987	1	2012- 04-26	売	40	25,250	25,000	1,010,000	1,020,000	0.99%
4001	4699	ウチダエ スコ(株)【4699 】	0.481	3.886	931	2012- 05-07	買	2,000	448	448	896,000	896,000	0.00%

現金：5434000円 総資産：10,003,000円

5月29日

日経平均の下げがきついですね。

というわけで、割と間をあけて休んでいました。

そろそろ落ち着いてきたようなので仕込みを再開。

今週は、【9077】名鉄運輸(株)

PBR	0.36	PER	1.97
-----	------	-----	------

とお手ごろすぎる状態です。

170円で4000株仕込みましょう。

ID	コード	会社名	PFR	PER	FB PS	日付	売買	株数	取引株 価	現在株 価	投資額	評価額	利益率
1	1966	(株)高田 工業 所【1966 】	0.170	2.101	1,444	2012- 04-05	買	3,200	285	246	912,000	787,200	- 13.68%
1001	1771	日本乾溜 工業(株)【1771 】	0.253	2.039	600	2012- 04-12	買	6,500	152	152	988,000	988,000	0.00%
2001	1938	日本リ ーテッ ク(株)【1938 】	0.297	2.304	1,107	2012- 04-20	買	2,000	380	329	760,000	658,000	- 13.42%
3001	2159	(株)フル スピー ド【2159 】	21,870.000	- 3.488	1	2012- 04-26	売	40	25,250	21,870	1,010,000	1,145,200	13.39%
4001	4699	ウチダエ スコ(株)【4699 】	0.442	3.557	927	2012- 05-07	買	2,000	448	410	896,000	820,000	-8.48%
5001	9077	名鉄運 輸(株)【9077 】	0.299	2.214	569	2012- 05-29	買	4,000	170	170	680,000	680,000	0.00%

】

現金：4754000円

総資産：9,832,400円

6月26日

今回の一手は、内海造船(株) 7018。

P B R	0.42	P E R	3.54
-------	------	-------	------

とこれまたちょうどお買い得な銘柄。

158円で5000株購入とする。

7月2日

日経平均の下げも一段落ついたもよう。
なのでまた買っていきましょうか。
今日の日経平均は9000円前後でした。

今週の買い目は、(株)名村造船所【7014】。

PBR	0.27	PER	2.24
-----	------	-----	------

とやはりお手ごろ価格。

265円で3000株購入とします。

トレードリスト

コード： 取引価格： 株数： 買 売

ID	コード	会社名	PFR	PER	FB PS	日付	売 買	株数	取引株 価	現在株 価	投資額	評価額	利益 率
1	1966	(株)高田 工業 所【1966 】	0.228	2.614	1,343	2012- 04-05	買	3,200	285	306	912,000	979,200	7.37%
1001	1771	日本乾溜 工業(株)【1771 】	0.293	2.146	547	2012- 04-12	買	6,500	152	160	988,000	1,040,000	5.26%
2001	1938	日本リ ーテッ ク(株)【1938 】	0.353	2.487	1,006	2012- 04-20	買	2,000	380	355	760,000	710,000	- 6.58%
3001	2159	(株)フル スピー ド【2159 】	24,990.000	- 4.713	1	2012- 04-26	売	40	25,250	24,990	1,010,000	1,020,400	1.03%
4001	4699	ウチダエ スコ(株)【4699 】	0.486	3.557	844	2012- 05-07	買	2,000	448	410	896,000	820,000	- 8.48%

5001 9077	名鉄運 輸(株) 【9077 】	0.342	2.266 508	2012- 05-29	買 4,000 170	174	680,000	696,000	2.35%
6001 7018	内海造 船(株) 【7018 】	0.340	2.043 444	2012- 06-26	買 5,000 158	151	790,000	755,000	- 4.43%
7001 7014	(株)名村 造船 所【7014 】	0.269	2.669 972	2012- 07-02	買 3,000 265	261	795,000	783,000	- 1.51%

現金 : 3169000 円 総資産 : 9,972,600円

6001 7018	船(株))【7018 】	0.336	2.016 443	2012- 06-26	買 5,000 158	149	790,000	745,000	- 5.70%
7001 7014	(株)名村 造船 所【7014 】	0.280	2.843 994	2012- 07-02	買 3,000 265	278	795,000	834,000	4.91%
8001 6023	ダイハ ツディー ゼル(株))【6023 】	0.338	2.808 817	2012- 07-17	買 3,000 254	276	762,000	828,000	8.66%

現金 : 2407000 円 総資産 : 10,108,400円

10ヶ月パフォーマンス

2011年9月24日から2012年8月1日の機械的売買の結果をまとめます。

F B P S I X 投資パフォーマンス

期間:2011-09-24:2012-08-14

fbpsix1

コード	名称	株数	取引価格	評価価格	利益	金額
1966	高田工業所	4.202	238	294	235.	1,235.
8600	トモニホールディングス	3.145	318	314	-13.	987.
1938	日本リーテック(株)【1938】	3.367	297	358	205.	1,205.
5566	中央電気工業(株)【5566】	3.268	306	314	26.	1,026.
1834	大和小田急建設(株)【1834】	5	200	174	-130.	870.
6307	サンセイ(株)【6307】	11.628	86	107	244.	1,244.
1771	日本乾溜工業(株)【1771】	5.882	170	158	-71.	929.
8732	(株)マネーパートナーズグループ【8732】	0.079	12,620	13,000	30.	1,030.
6784	プラネックスホールディング(株)【6784】	0.038	26,000	42,050	617.	1,617.
3731	株)京王ズホールディングス【3731】	0.054	18,600	25,400	366.	1,366.
合計						11,511.

fbpsix2

コード	名称	株数	取引価格	評価価格	利益	金額
6624	田淵電機(株)【6624】	8.065	124	178	-435.	565.
6812	(株)ジャルコ【6812】	11.236	89	77	135.	1,135.
2160	(株)ジーエヌアイグループ【2160】	6.897	145	100	310.	1,310.
3587	(株)プリンシパル・コーポレーション【3587】	30.303	33	19	424.	1,424.
9898	(株)サハダイヤモンド【9898】	20.408	49	16	673.	1,673.
3832	(株)T & Cホールディングス【3832】	0.027	36,700	6,200	831.	1,831.
9424	日本通信(株)【9424】	0.134	7,470	8,280	-108.	892.
9439	(株)エム・エイチ・グループ【9439】	0.042	23,870	23,800	3.	1,003.

2798	(株)ワイズテーブルコーポレーション【2798】	0.013	77,500	91,500	-181.819.
2158	(株)U B I C【2158】	0.032	31,400	5,620	821. 1,821.
	合計				12,473.

ということで、買いで+15% 売りで24%。総合で20%ということでしょうか。
 年利換算で24%前後という結果です。

月に1時間程度チェックするだけで、資金が25%増えるのだから、サブのお小遣い稼ぎとしては十分な方法といえると思います。

とはいえ、8月1日にデータ取得先のフォーマット変更が行われたので、プログラムの変更をしないといけないのだけれども、プライベート用に作ってあるのは対応したのだけれど、公開版のほうはほかのユーザもいないみたいだし、このままお蔵入りするかもしれません。

約1年間、エネルギーをかけて開発してきましたが、個人用で終わらせることになりそうです。
 それでは、みなさん、さようなら。