

日本市場検知型デュアル Momentum投資戦略

暴落を回避し、相場の波に乗る
「独自カスタマイズ」の全貌

学術的根拠に基づくルールベース運用と、
日本向けコスト最適化モデル



インデックス投資の死角を補う「攻守のシステム」

伝統的な「バイ・アンド・ホールド」が抱える暴落リスクを克服するため、学術的に証明されたデュアルモメンタムを日本の個人投資家向けに最適化。



【1604検知器】
グローバル資金の日本流入を捉える5資産ユニバース



【6ヶ月ルックバック】
現代の激しいボラティリティへの適応



【5%バッファルール】
往復ビンタと「税金コスト」の抑制

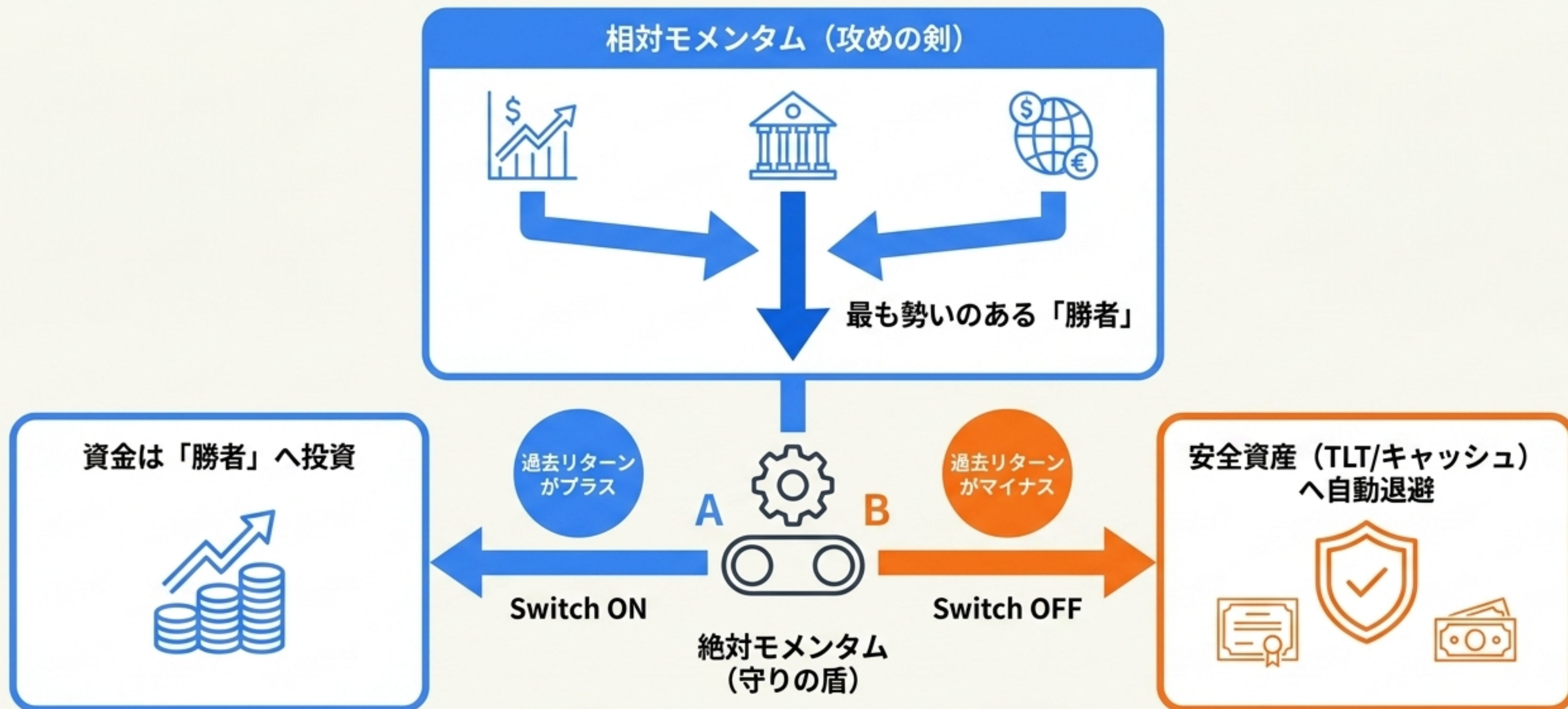
モメンタム効果を生み出す「人間心理の歪み」

1800年代からあらゆる資産で観測される普遍的なアノマリーは、効率的市場仮説では説明できない投資家の「感情」に起因する。



システムを駆動する2つのフィルター「攻めの剣」と「守りの盾」

絶対▶ モメンタムと相対モメンタムを組み合わせることで、リターンの最大化と暴落の回避を両立する。



日本の投資環境に合わせた「独自カスタマイズモデル」への進化

現代のボラティリティと、日本の約20%の譲渡益税（Tax Drag）に対応するためのアップデート。

標準GEMモデル

12ヶ月ルックバック

米国株 vs 世界株

コスト管理なし

独自カスタマイズモデル

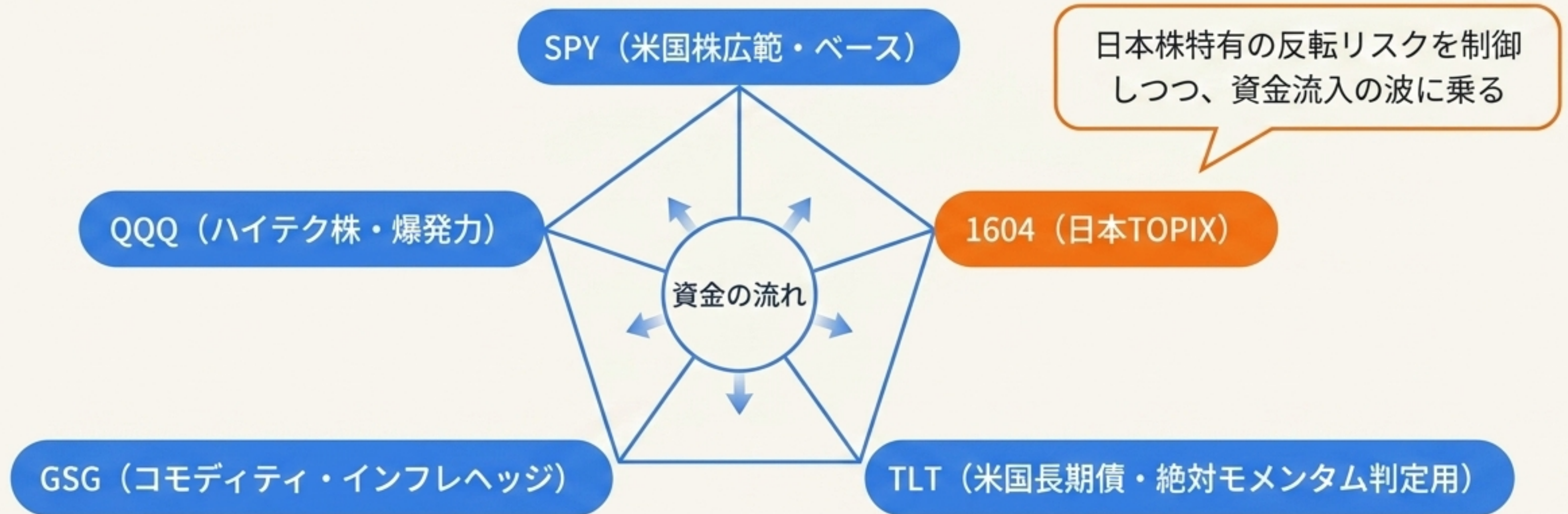
✓ 6ヶ月ルックバック

✓ 5資産（SPY/QQQ/GSG/TLT/1604）

✓ 5%バッファルール

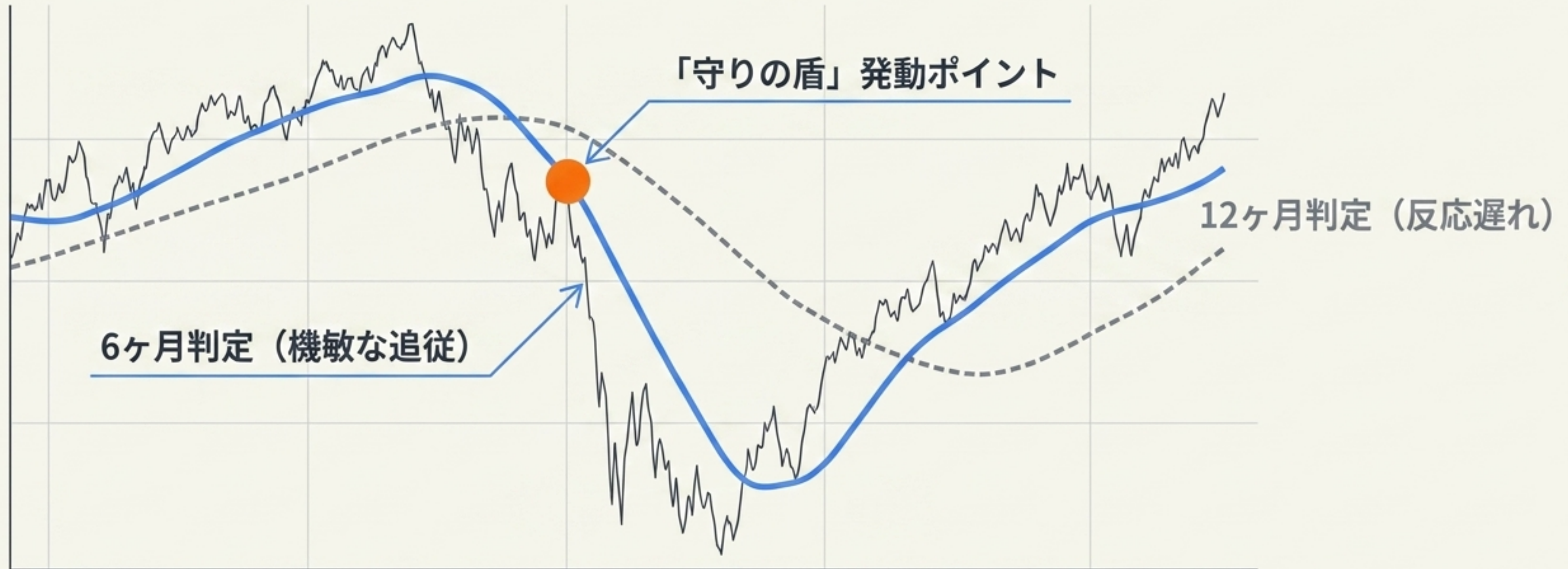
グローバル資金の動きを捉える「5つの観測対象」

特に1604（日本TOPIX）は、海外マネーが日本へ流入しているかを測る「検知器」として機能する。



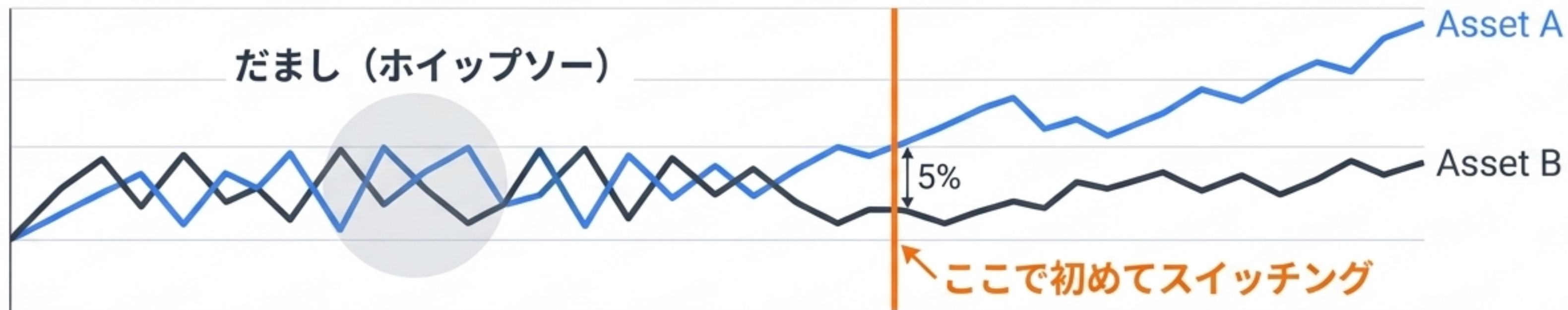
レジームチェンジに機敏に反応する「6ヶ月ルックバック」

12ヶ月では対応が遅れる現代の急激な市場変動（ボラティリティの増大）に対し、感応度を高める。

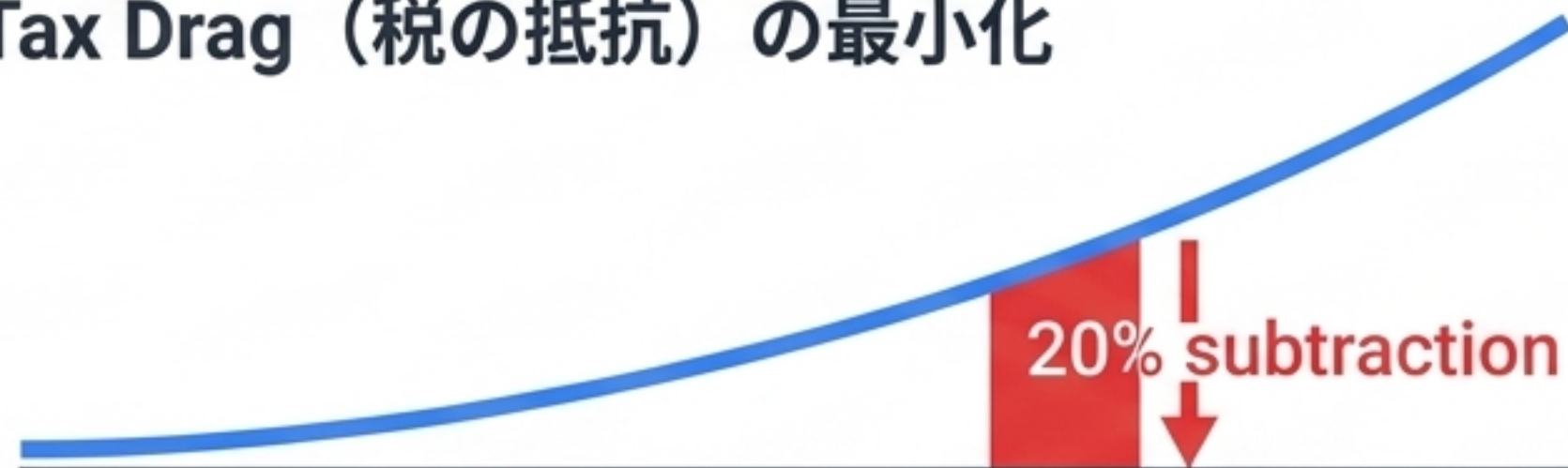


往復ビンタと税金コストを防ぐ「5%バッファルール」

指標が逆転しても、5%以上の差が開かない限り乗り換ええない (Hold)。



Tax Drag (税の抵抗) の最小化



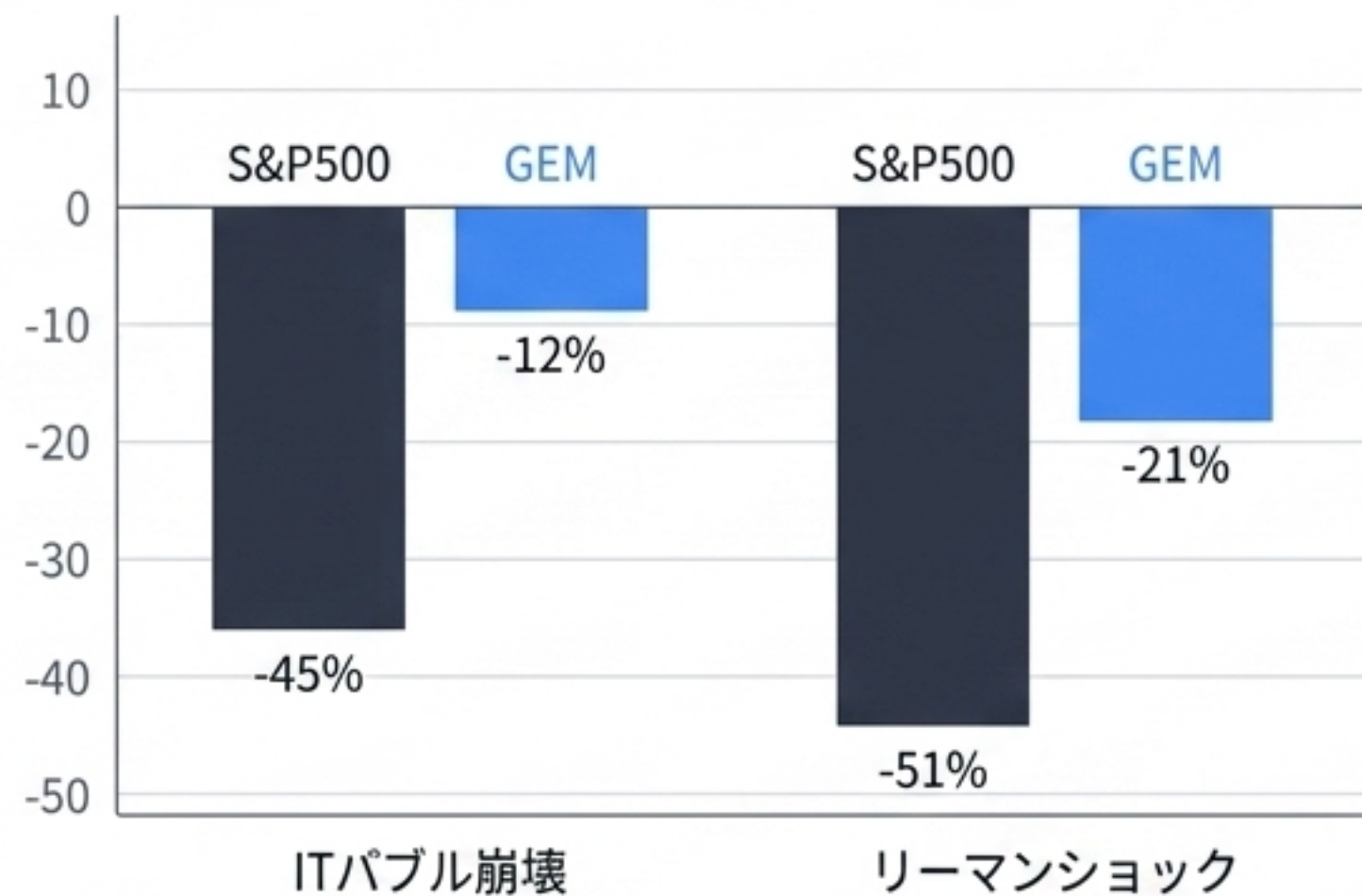
利益確定ごとの約20%の譲渡益税を回避し、複利効果を最大化

歴史的暴落の回避実績と、唯一の弱点「モメンタム・クラッシュ」

ITバブルやリーマンショックでドロアダウンを抑制した実績。一方で、急激なV字回復には弱いという限界の公正な開示。

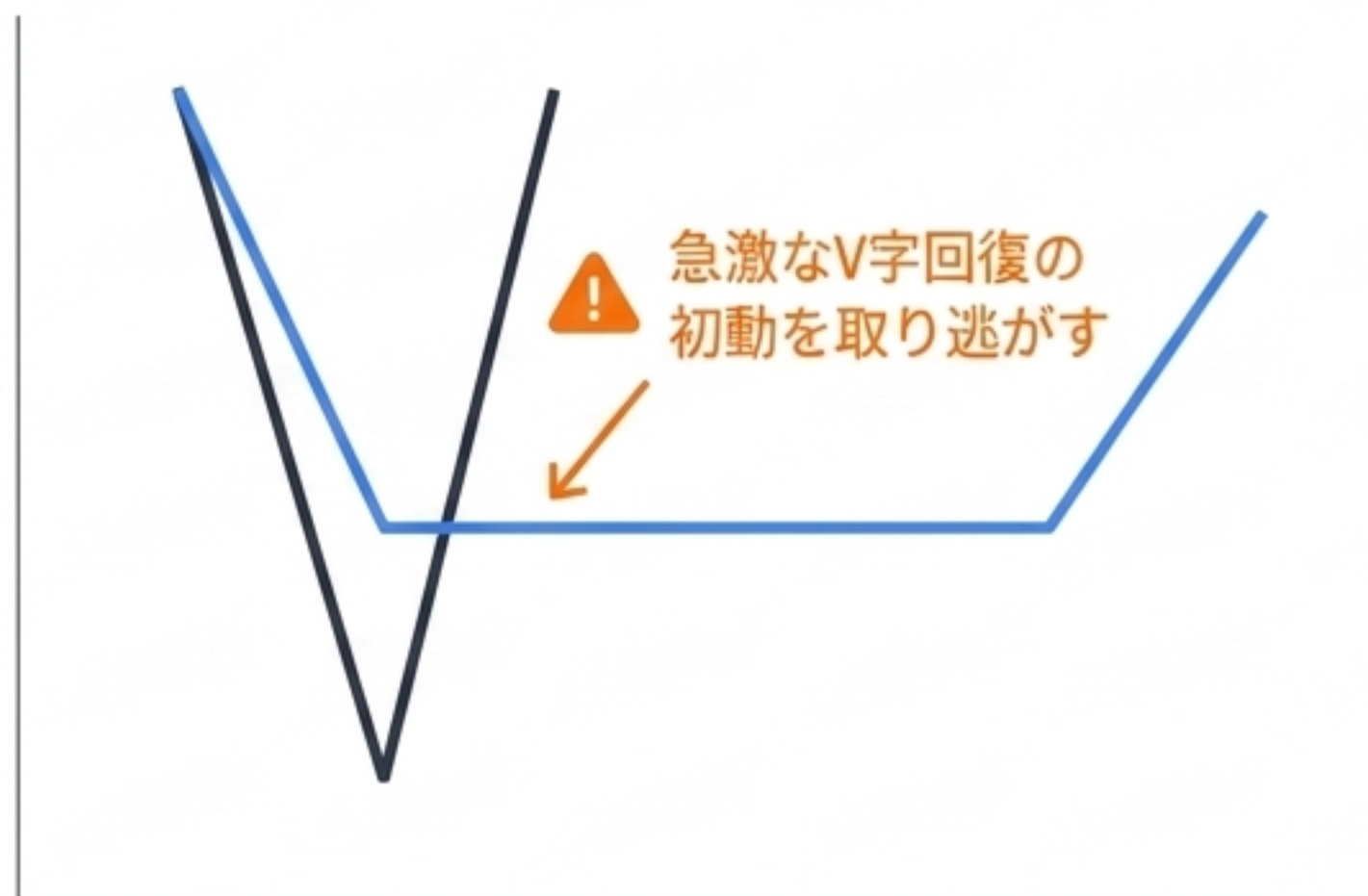
歴史的暴落の回避実績

(Strengths: Historical Crash Avoidance)



モメンタム・クラッシュ

(Weakness: Momentum Crash)



感情を排除し、 規律を完遂する

「上がるから買い、下がるから逃げる」

極めてシンプルな基本原則をルール化し、月に一度、機械的に判定を行う。群衆心理に流されない規律こそが、最大の優位性となる。

