

仮想通貨の時間のクセ

MACアセットマネジメント株式会社

時間のクセを分析することは重要

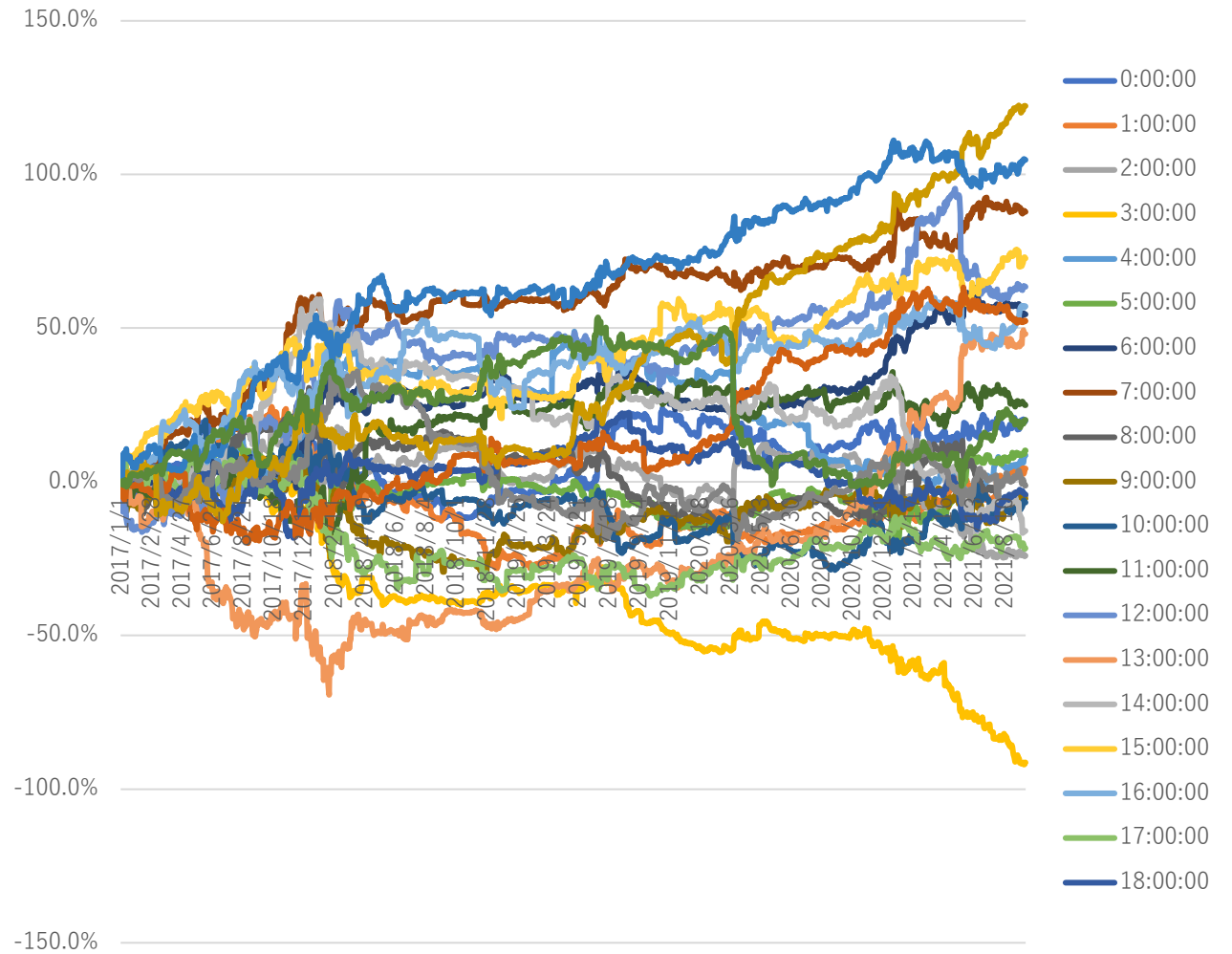
- マーケットは一見ランダムな動きに見えるが、実際には時間による値動きのクセが至る所に見られる。
- 仮想通貨や外国為替市場（FX）などのように24時間取引されているマーケットにおいては、特にその傾向が強いと感じる。
- 今回の時間分析が少しでもあなたのお役に立てれば幸いだ。

ビットコインの時間別の値動き

右のグラフは1時間毎に、ビットコインの値動きを示したものの。

黎明期より大きく値を上げてきたビットコインなので、全体的に上昇している時間帯が多い。

上昇している時間は、全体の6割を超えているのが特徴。



時間帯のクセ

- 仮想通貨の過去の値動きを時間別に調べると、値動きのクセが見られる。
- 大きく分けて以下のような2つの特徴がある
 - 早朝から深夜にかけて概ね上昇する傾向がある。
 - 深夜（3時～4時）に一時的に下落する傾向がある。

上昇する傾向のある 時間帯（日本時間）

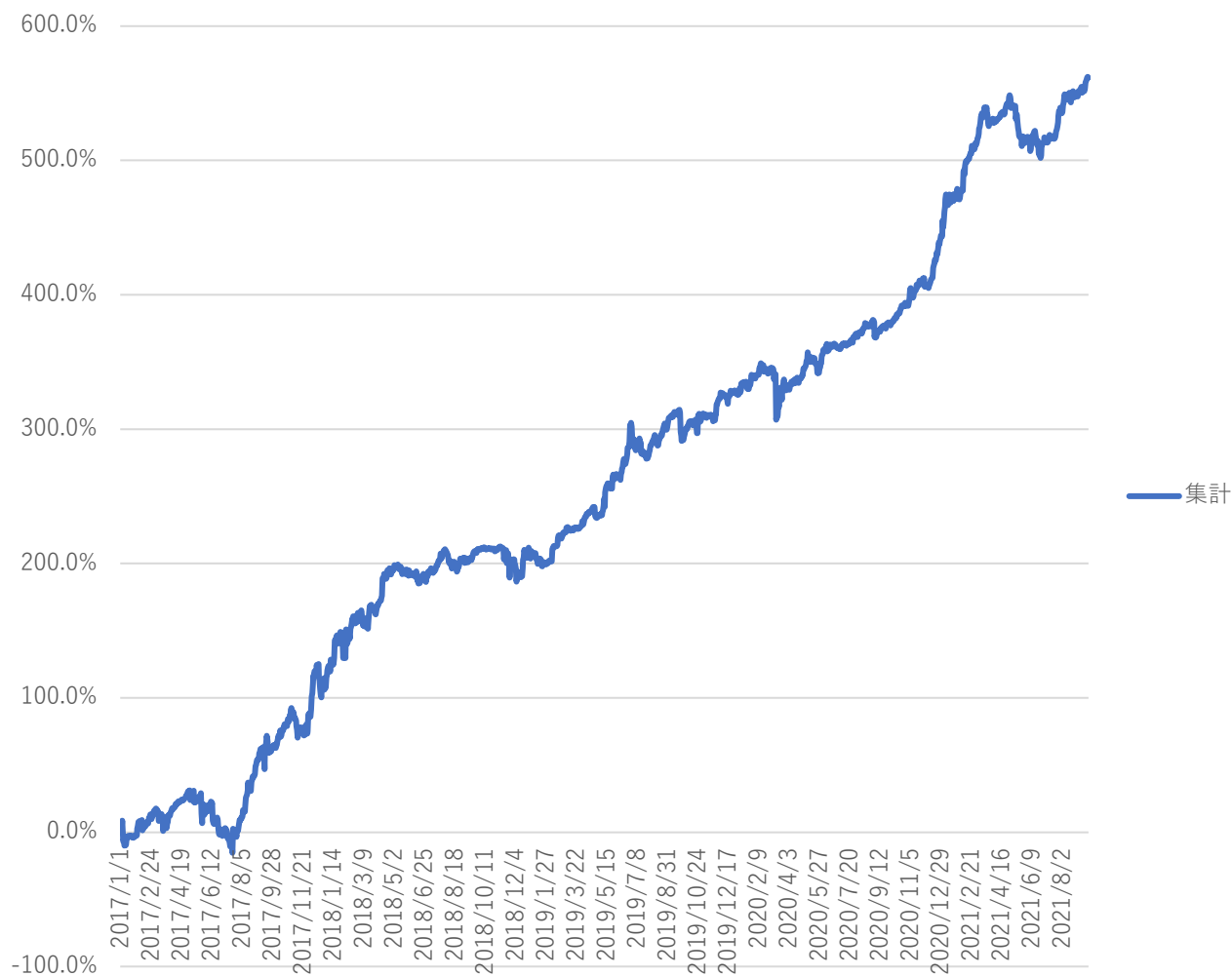
6：00～8：00

11：00～14：00

15：00～17：00

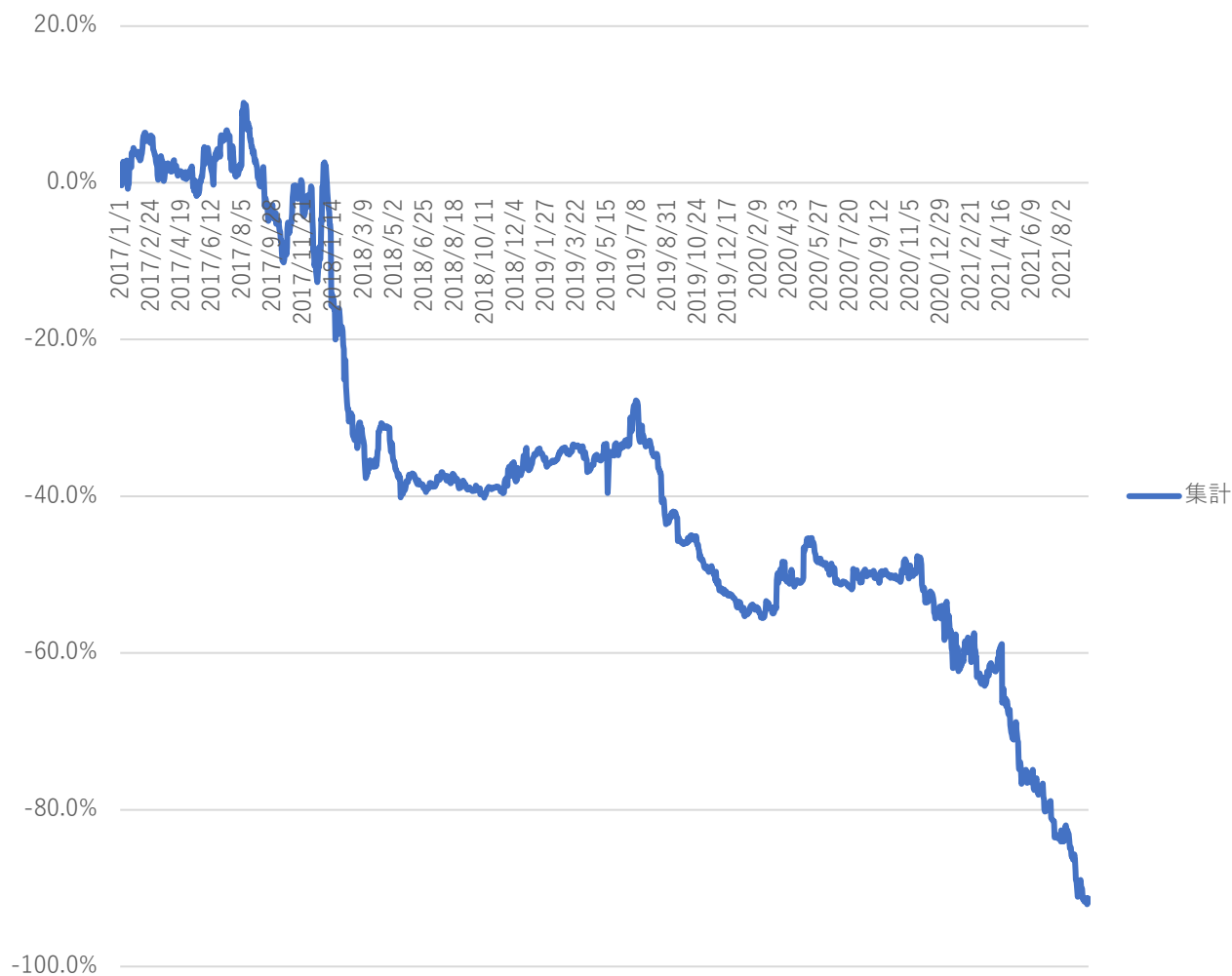
19：00～20：00

21：00～23：00



下落する傾向のある 時間帯（日本時間）

3:00~4:00



上昇する時間にビットコインを買う

- フラットベット（枚数固定）の場合
- スタート資金500ドル→+3,441ドル（+688%）

- 「Pの公式」を使った複利運用の場合
- スタート資金500ドル→+1,218,795ドル（+243,759%）
+2437倍

下落する時間にビットコインを売る

- フラットベット（枚数固定）の場合
- スタート資金500ドル→+458ドル（+92%）

- 「Pの公式」を使った複利運用の場合
- スタート資金500ドル→+1,212ドル（+242%）

上昇する時間にビットコインを買う

ロット フラットベット (固定)
単位ドル

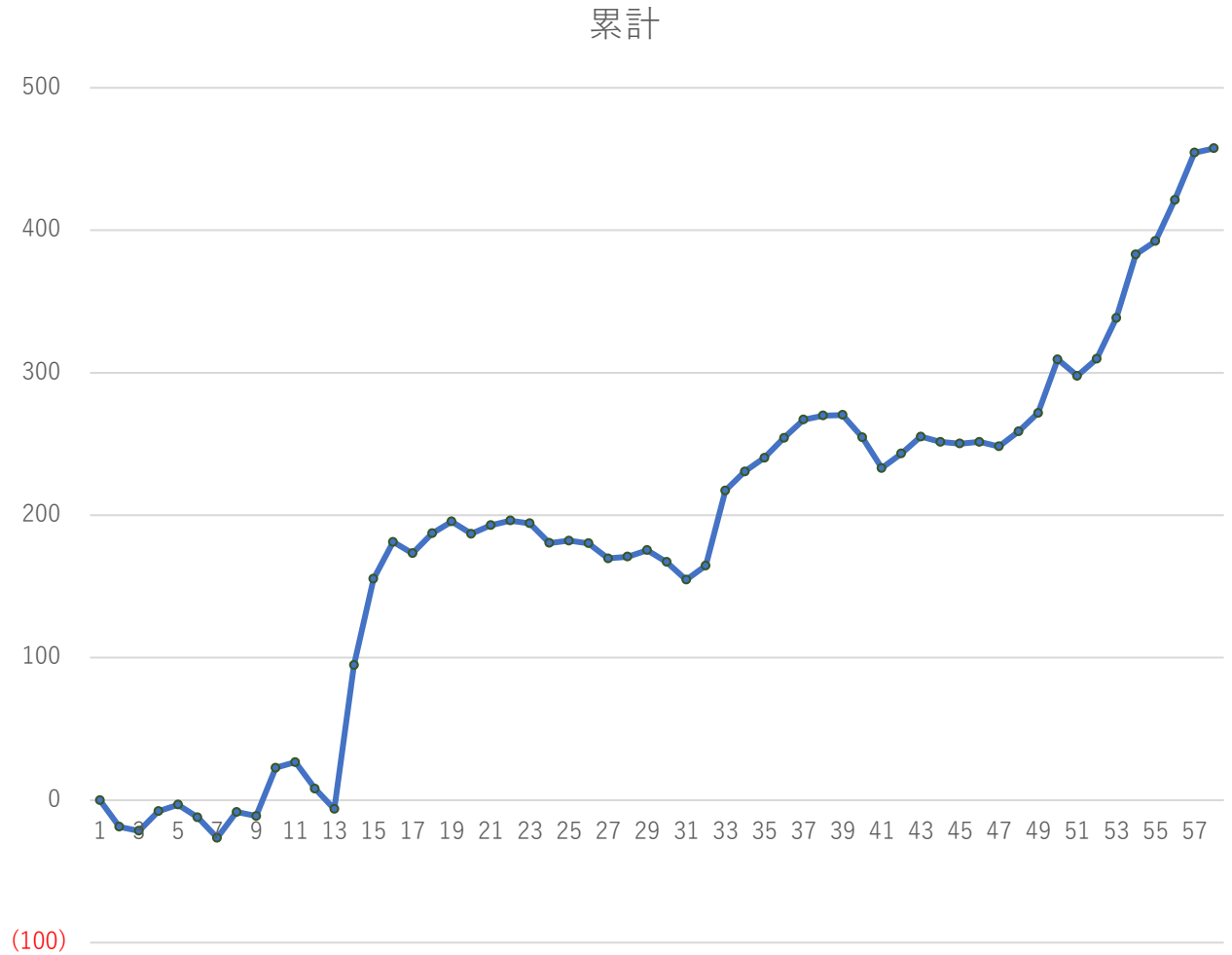
日別成績	フラット
損益	3,441
勝ち	998
負け	724
勝率	58.0%
総利益	9,965
総損失	-6,524
PR	1.11
最長DD期間	
最大損失	-85
最大枚数	
MDD	-193
MDD%	-26.8%
#レシオ	0.138
損益率	688%
最大損益	3,449
トレード率	100%
PMレシオ	17.8
最低残高	443
月利	12%
年利	144.9%



下落する時間にビットコインを売る

ロット フラットベット (枚数固定)
単位ドル

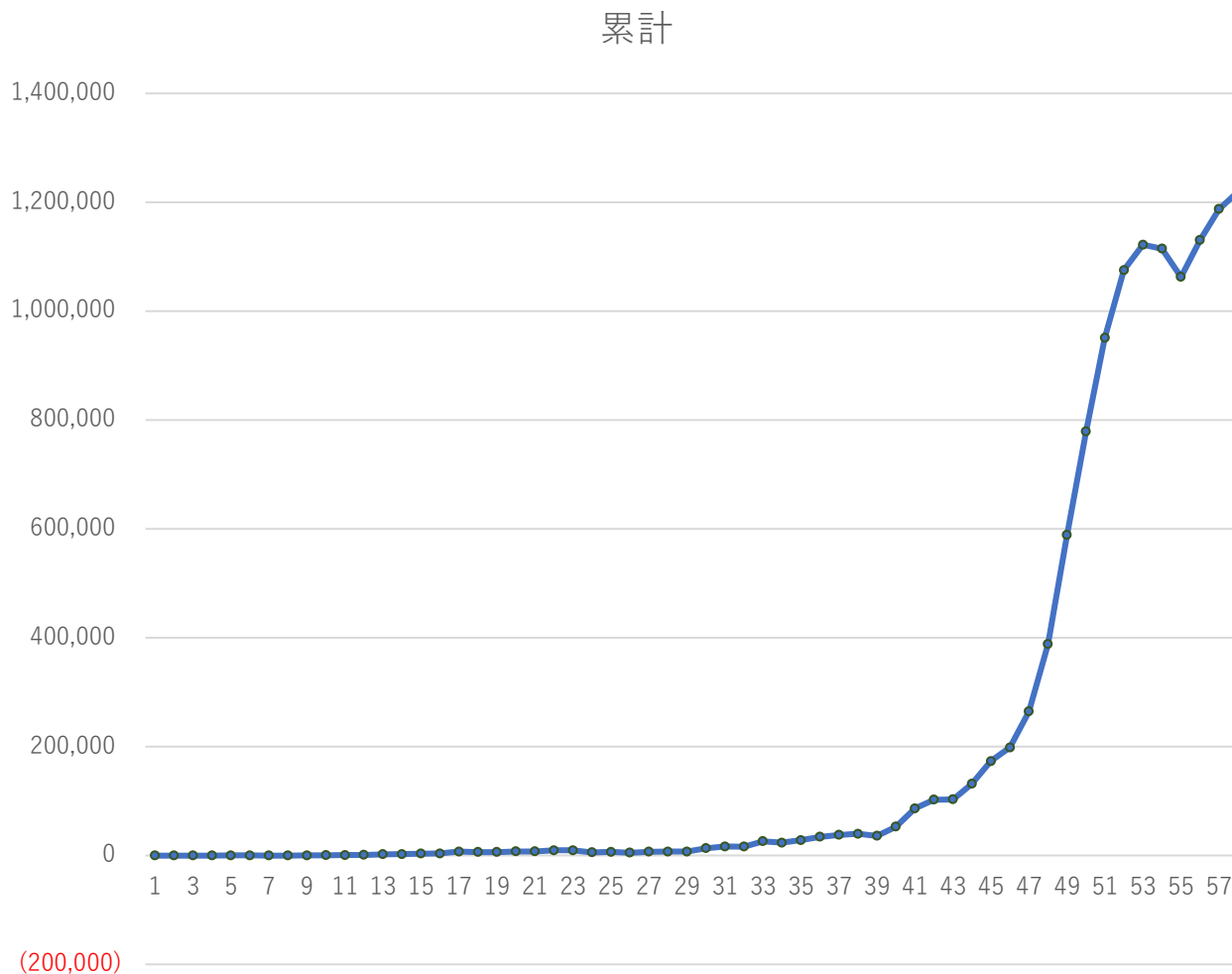
日別成績	フラット
損益	458
勝ち	918
負け	779
勝率	54.1%
総利益	2,210
総損失	-1,752
PR	1.07
最長DD期間	
最大損失	-35
最大枚数	
MDD	-76
MDD%	-13.6%
#レシオ	0.067
損益率	92%
最大損益	461
トレード率	99%
PMレシオ	6.0
最低残高	449
月利	2%
年利	19.3%



上昇する時間にビットコインを買う

ロット Pの公式を使った複利運用
単位ドル

日別成績	Pの公式
損益	1,218,795
勝ち	998
負け	724
勝率	58.0%
総利益	2,851,347
総損失	-1,632,552
PR	1.27
最長DD期間	186
最大損失	
最大枚数	1,000
MDD	-155,076
MDD%	-53.8%
#レシオ	0.104
損益率	243759%
最大損益	1,226,078
トレード率	
PMレシオ	7.9
最低残高	332
月利	
年利	

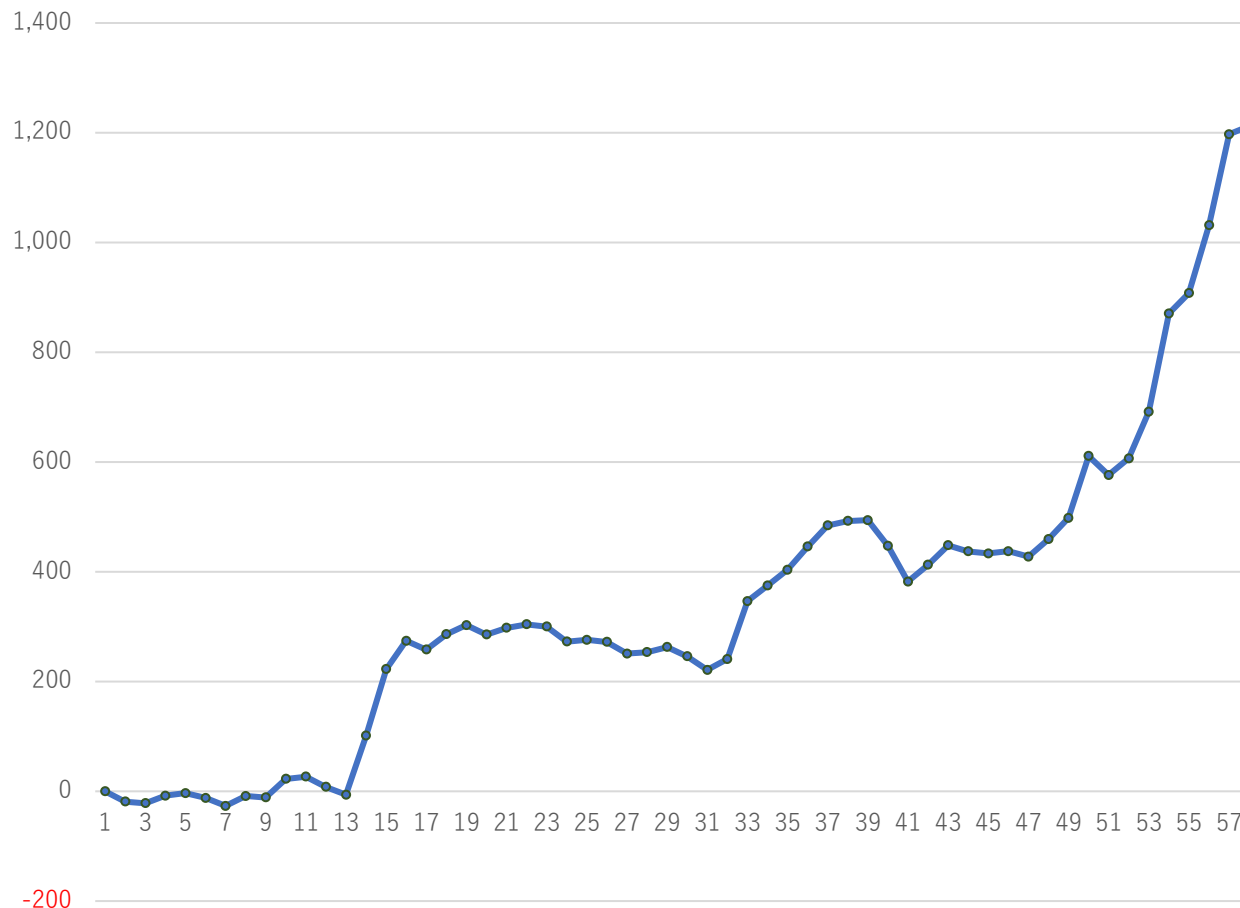


下落する時間にビットコインを売る

ロット Pの公式を使った複利運用
単位ドル

日別成績	Pの公式
損益	1,212
勝ち	918
負け	779
勝率	54.1%
総利益	4,984
総損失	-3,772
PR	1.12
最長DD期間	314
最大損失	
最大枚数	6
MDD	-153
MDD%	-15.3%
#レシオ	0.078
損益率	242%
最大損益	1,236
トレード率	
PMレシオ	7.9
最低残高	449
月利	
年利	

累計



時間帯分析のまとめ

- 時間帯の分析より、60%以上の時間帯で上昇のバイアスがある。
- 圧倒的に買いポジションの損益が大きくなっているが、今後の値動きにより、このバイアスがどの程度継続されるのかわからない。
- ただ、3時～4時のスポットの時間帯に大きく下落していることから、この時間における買いは避けた方が良さそうだ。

損益のまとめ

- 買いにおいてとても大きなリターンがあった。
- 特に「Pの公式」を使った複利運用においては、天文学的な数字になっている。
- フラット運用（ロット固定）でも十分なパフォーマンスだが、少額運用と割り切れば、リスクをとった複利運用も面白い。

※Pの公式について

<https://macasset.com/2016/08/31/p/>

注意事項

- 本資料は将来の傾向、数値、運用結果等を保証もしくは示唆するものではありません。
- 提供する情報及び投資方法は利益を保障するものでなく、あくまでも個人の判断と責任に依存します。投資の判断は個人の責任においてなさいますようお願い申し上げます。