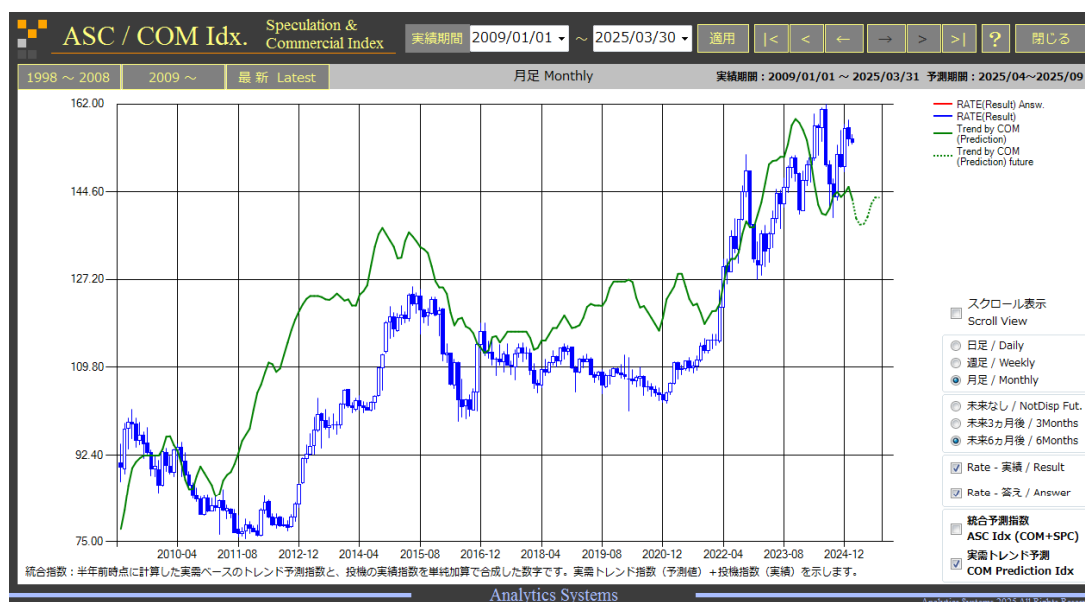


実需指数（実需予測）の短期的な予測有効性を評価する指標として、
「損失回避率」を計算しております。この指標は、
FX取引など短期の予測が必要な場面で参考になるものです。

本資料では、その計算方法と各年の結果をご案内いたします。

FXSEの実需予測が皆様のお役に立つものかどうか、
ご判断いただく材料になれば幸いです。

2009年から2025年2月までの、半年前時点に算出していた実需予測（緑のライン）と
結果のドル円為替レート（青の口ウソク足）です。
実需予測のみですので、他の要素（投機や外債投資等）が考慮されていない予測ですが、
一定の予測効果があることが分かります。



巻末の「当資料をご利用にあたっての注意事項等」を必ずお読みください。

Analytics Systems Laboratories

日本アナシス合同会社
Nihon AnaSys LLC



損失回避率について (計算方法・判定方法)

計算方法

損失回避率は、各週ごとに計算した、週足ベースの予測OK比率です。

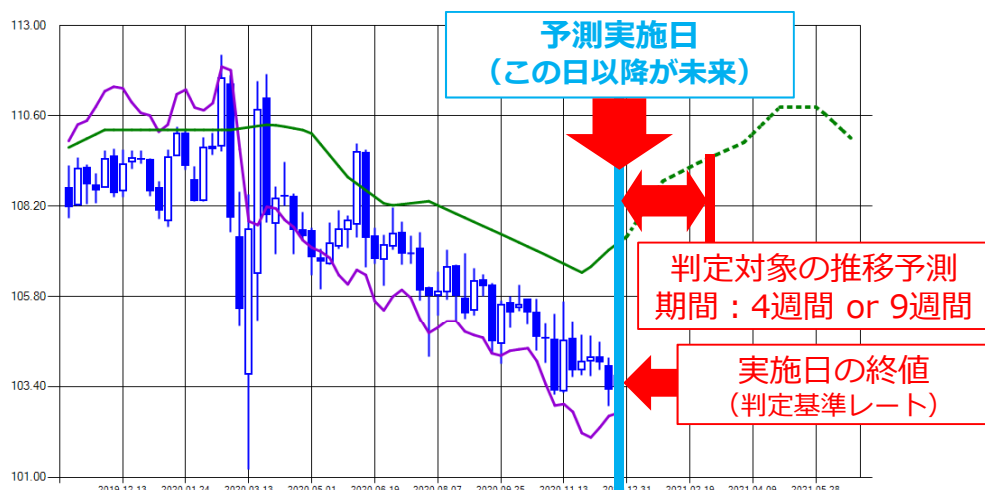
予測OKの判定は、上昇・横ばい・下落 という実需予測に対し、予測実施時点の終値から、判定期間中に、下記「予測OK判定の条件」を満たす値動きがあったかどうかで行っています。

予測実施日は、週の最終日に設定されています。

判定期間は、予測実施日の翌週から開始しています。

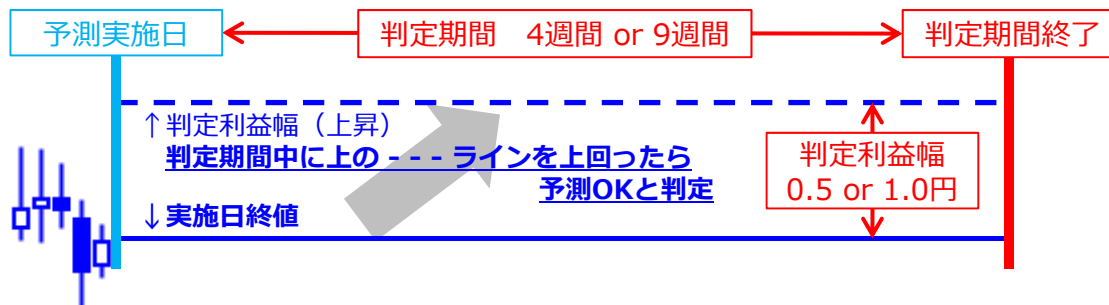
判定の基準となるレートは予測実施日の終値です。

⇒為替市場の休場日以外、「金曜日の終値を用い、翌月曜日が判定期間の開始日」になります。

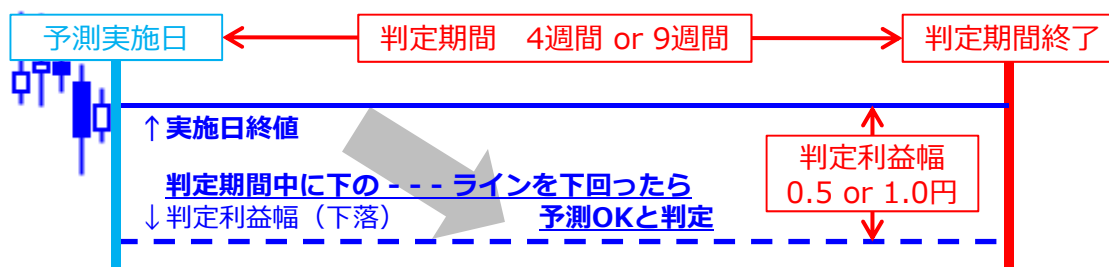


予測OK判定の条件

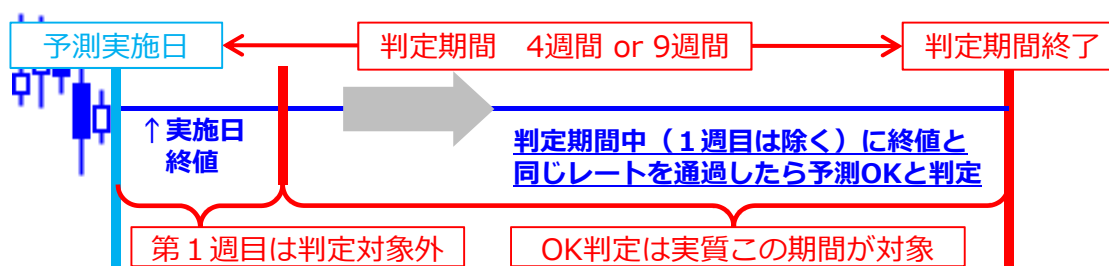
実需予測が
上昇 ↗
予測の場合



実需予測が
下落 ↘
予測の場合



実需予測が
横ばい →
予測の場合



※翌週の始値は前週終値に近い事が多く、ほとんどのケースで「横ばい予測OK」と判定されてしまいます。そこで、有用性を厳しく評価するために、翌週は横ばい判定から除外しています。



損失回避率・改善効果一覧表【1】

判定期間：4週間（約1ヶ月）

<表の凡例>

FXSE使用・・・FXSEの実需予測を使用して、予測OKになった週の割合です。この数字を「**損失回避率**」と呼称しております。**自然達成**・・・判定期間に判定利益幅分の上昇&下落の両方が起きた場合、FXSE予測が上昇・下落・横ばいのいずれであっても予測OKの判定になります。その様なケースが発生した週の割合が「**自然達成**」の値です。**FXSE使用による改善効果**・・・損失回避率－自然達成率です。FXSEの使用で、自然任せよりどれだけ改善できたかの値です。損失回避率70%、自然達成率40%の場合、FXSEの使用で30%の改善効果があった事になりますので（+30%）と表示されます。

	判定利益幅：50pips/0.5円幅 自然達成 → FXSE使用（改善効果）	判定利益幅：100pips/1.0円幅 自然達成 → FXSE使用（改善効果）
1999年	55.8 → 86.5% （+30.7 %）	46.2 → 80.8% （+34.6 %）
2000年	51.9 → 84.6% （+32.7 %）	42.3 → 78.8% （+36.5 %）
2001年	56.6 → 94.3% （+37.7 %）	49.1 → 84.9% （+35.8 %）
2002年	54.7 → 88.7% （+34.0 %）	39.6 → 81.1% （+41.5 %）
2003年	60.4 → 81.1% （+20.7 %）	37.7 → 75.5% （+37.8 %）
2004年	58.5 → 79.2% （+20.7 %）	39.6 → 66.0% （+26.4 %）
2005年	46.2 → 78.8% （+32.6 %）	36.5 → 78.8% （+42.3 %）
2006年	63.5 → 80.8% （+17.3 %）	28.8 → 65.4% （+36.6 %）
2007年	56.6 → 88.7% （+32.1 %）	39.6 → 79.2% （+39.6 %）
2008年	49.1 → 84.9% （+35.8 %）	43.4 → 79.2% （+35.8 %）
2009年	56.6 → 79.2% （+22.6 %）	47.2 → 71.7% （+24.5 %）
2010年	50.0 → 84.6% （+34.6 %）	32.7 → 69.2% （+36.5 %）
2011年	63.5 → 80.8% （+17.3 %）	25.0 → 59.6% （+34.6 %）
2012年	47.2 → 83.0% （+35.8 %）	11.3 → 67.9% （+56.6 %）
2013年	50.9 → 75.5% （+24.6 %）	35.8 → 60.4% （+24.6 %）
2014年	49.1 → 90.6% （+41.5 %）	22.6 → 66.0% （+43.4 %）
2015年	62.3 → 88.7% （+26.4 %）	34.0 → 73.6% （+39.6 %）
2016年	59.6 → 88.5% （+28.9 %）	50.0 → 73.1% （+23.1 %）
2017年	51.9 → 78.8% （+26.9 %）	38.5 → 75.0% （+36.5 %）
2018年	49.1 → 98.1% （+49.0 %）	22.6 → 84.9% （+62.3 %）
2019年	49.1 → 81.1% （+32.0 %）	13.2 → 56.6% （+43.4 %）
2020年	60.4 → 86.8% （+26.4 %）	22.6 → 66.0% （+43.4 %）
2021年	51.9 → 82.7% （+30.8 %）	11.5 → 65.4% （+53.9 %）
2022年	53.8 → 94.2% （+40.4 %）	38.5 → 92.3% （+53.8 %）
2023年	57.7 → 90.4% （+32.7 %）	50.0 → 84.6% （+34.6 %）
2024年	52.8 → 88.7% （+35.9 %）	45.3 → 79.2% （+33.9 %）
25年間総合	54.6 → 85.4% （+30.8 %）	34.8 → 73.7% （+38.9 %）



損失回避率・改善効果一覧表【2】

判定期間：9週間（約2ヶ月）

<表の凡例>

FXSE使用・・・FXSEの実需予測を使用して、予測OKになった週の割合です。この数字を「**損失回避率**」と呼称しております。**自然達成**・・・判定期間に判定利益幅分の上昇&下落の両方が起きた場合、FXSE予測が上昇・下落・横ばいのいずれであっても予測OKの判定になります。その様なケースが発生した週の割合が「**自然達成**」の値です。**FXSE使用による改善効果**・・・損失回避率－自然達成率です。FXSEの使用で、自然任せよりどれだけ改善できたかの値です。損失回避率70%、自然達成率40%の場合、FXSEの使用で30%の改善効果があった事になりますので（+30%）と表示されます。

	判定利益幅：50pips/0.5円幅 自然達成 → FXSE使用 (改善効果)	判定利益幅：100pips/1.0円幅 自然達成 → FXSE使用 (改善効果)
1999年	67.3 → 92.3% (+25.0 %)	57.7 → 88.5% (+30.8 %)
2000年	71.2 → 92.3% (+21.1 %)	65.4 → 86.5% (+21.1 %)
2001年	67.9 → 98.1% (+30.2 %)	60.4 → 90.6% (+30.2 %)
2002年	73.6 → 92.5% (+18.9 %)	66.0 → 86.8% (+20.8 %)
2003年	79.2 → 92.5% (+13.3 %)	66.0 → 84.9% (+18.9 %)
2004年	77.4 → 86.8% (+ 9.4 %)	64.2 → 77.4% (+13.2 %)
2005年	65.4 → 90.4% (+25.0 %)	53.8 → 88.5% (+34.7 %)
2006年	73.1 → 84.6% (+11.5 %)	50.0 → 73.1% (+23.1 %)
2007年	67.9 → 92.5% (+24.6 %)	52.8 → 84.9% (+32.1 %)
2008年	64.2 → 90.6% (+26.4 %)	62.3 → 86.8% (+24.5 %)
2009年	69.8 → 81.1% (+11.3 %)	66.0 → 75.5% (+ 9.5 %)
2010年	61.5 → 88.5% (+27.0 %)	51.9 → 86.5% (+34.6 %)
2011年	84.6 → 88.5% (+ 3.9 %)	57.7 → 76.9% (+19.2 %)
2012年	54.7 → 84.9% (+30.2 %)	28.3 → 77.4% (+49.1 %)
2013年	71.7 → 90.6% (+18.9 %)	62.3 → 84.9% (+22.6 %)
2014年	66.0 → 98.1% (+32.1 %)	34.0 → 75.5% (+41.5 %)
2015年	75.5 → 96.2% (+20.7 %)	52.8 → 83.0% (+30.2 %)
2016年	71.2 → 92.3% (+21.1 %)	63.5 → 84.6% (+21.1 %)
2017年	75.0 → 90.4% (+15.4 %)	71.2 → 88.5% (+17.3 %)
2018年	66.0 → 100.0% (+34.0 %)	39.6 → 92.5% (+52.9 %)
2019年	69.8 → 84.9% (+15.1 %)	32.1 → 67.9% (+35.8 %)
2020年	77.4 → 100.0% (+22.6 %)	54.7 → 88.7% (+34.0 %)
2021年	63.5 → 88.5% (+25.0 %)	21.2 → 69.2% (+48.0 %)
2022年	65.4 → 98.1% (+32.7 %)	55.8 → 98.1% (+42.3 %)
2023年	75.0 → 92.3% (+17.3 %)	67.3 → 92.3% (+25.0 %)
2024年	67.9 → 92.5% (+24.6 %)	62.3 → 84.9% (+22.6 %)
25年間総合	70.1 → 91.5% (+21.4 %)	54.5 → 83.6% (+29.1 %)



重要事項

Important Notice

当資料をご利用にあたっての注意事項等

当資料は、日本アナシス合同会社および私設研究所「Analytics Systems Laboratories」（以下、両組織を総称して「アナリティクス・システムズ」といいます）が提供しています。

当資料に掲載されている情報には、予測など将来の見通しに関する事項が含まれている場合があります。こうした事項には一定のリスクや不確実性などが含まれており、経済情勢や市場の動向の変化等により、実際の結果とは必ずしも一致するものではありません。

当資料には過去の実績精度について具体的な数字を示している箇所がありますが、今現在および未来の精度を保証するものではありません。

当資料に掲載されている情報には、アナリティクス・システムズ独自または一般的に認知されていない見解が含まれている場合があります。見解の掲載に際して、アナリティクス・システムズではその信頼性を客観的な根拠となるデータで確認し情報提供する様に努めておりますが、見解が事実である事を証明する義務はありません。

当資料掲載の情報は、利用者に特定の取引を行うことを推奨するものではありません。当資料掲載の情報は、有価証券、金融商品の推奨もしくはその売買の申込み・申込みの勧誘、または特定の投資戦略をとる・ヘッジ含む投資行為を行うことの勧誘とみなされてはならないものとします。

当資料に掲載している情報には細心の注意を払っておりますが、アナリティクス・システムズは、情報の内容の正確性、完全性、現在の情勢・状況に対応していること（アップ・ツー・デート）、特定目的への適合性、権利の不侵害について、明示・黙示を問わず、一切保証せず責任を負わないものとします。

さらに、アナリティクス・システムズは、いかなる場合においても、その可能性について告知されていたかどうかを問わず、特別損害、間接損害、付随損害、結果損害を賠償する義務を負いません。当資料の内容に関して、アナリティクス・システムズに賠償責任は存在せず、使用についての賠償責任もアナリティクス・システムズにはありません。利用者は、利用者が当資料掲載の内容を依拠とされた場合でも、アナリティクス・システムズは一切の責任・賠償義務を負わない事をご承知おきください。

当資料に含まれる著作物（図解・チャート図・文章等の情報の全てを含みますが、これらに限るものではありません）は、特に明示された場合を除いて、アナリティクス・システムズが所有しております。

当資料に掲載されているアナリティクス・システムズの商品・サービス名称はアナリティクス・システムズの商標または登録商標です。その他の社名、商品名、サービス名などは、各社の商号、商標または登録商標です。

Analytics Systemsについて

About Our Company

当社および研究所のご案内

下記ウェブサイト「Analytics Systems について」ページをご覧ください。
また、「資料ダウンロード」ページより、当社・研究所のご案内をダウンロード頂けます。

<https://nihon-anasys.co.jp/company-overview/>

お問い合わせは・・・

下記ウェブサイト「Analytics Systems お問い合わせ」ページから、お問い合わせください。

<https://nihon-anasys.co.jp/inquiry/>