

「似たような銘柄をスクリーニングする」

JP法研究会 富士栄

絞り込み検索には、似たような銘柄をスクリーニングしてくる「20. 相関係数」があります。

相関係数についてはこちらをご覧ください。

<http://myindex.jp/study/glossary/correlation.html>

範囲は「-1」～「1」の間をとります。

- 0.8・・・非常に似ている、強い正の相関がある
- 0.04・・・ほとんど関係が無い動き、相関なし
- 0.8・・・ほぼ反対の値動き、強い負の相関がある

例. 7203トヨタと同じような銘柄をスクリーニングしてくる

20. 相関係数

検索条件

検索種別・日付

実行 中止 登録 閉じる

基準銘柄コード 7203

相関係数値 0.8 以上～ 1 以下 相関係数

※注意点

株価データは全て埋まっていないと正確な数値が出てきません。例えば、新規銘柄が合格した場合、データが足りず、正確ではありません。

■手順

対象は信用銘柄で、ETF、リートを抜かす ※一般個別銘柄のみ

「61. 検索対象銘柄選択」で、「信用銘柄」を選択した後、

「44. 業種区分」で「その他」をはずす

「20. 相関係数」を実行

44 業種区分

検索条件 | 検索種別・日付

実行 中止 登録 閉じる

業種選択(チェックして下さい。)

水産・農林 医薬品 機械 海運業 証券業
 鉱業 石油・石炭 電気機器 空運業 保険業
 建設業 ゴム製品 輸送用機器 倉庫・運輸 他金融
 食料品 硝子・土石 精密機器 情報通信 不動産業
 繊維製品 鉄鋼 その他製品 卸売業 サービス
 パルプ・紙 非鉄金属 電力・ガス 小売業 その他
 化学 金属製品 陸運業 銀行業

チェックしない

「80. 検索結果」

80 絞り込み検索結果

検索日 2016/06/10 読込 書込 印刷 終了

合格数 22

分析チャート BOONDチャート WORKチャート エクスパートチャート JPチャート

[No.]	コード	銘柄名	上場区分	終値	出来高	売買単位	業種区分	検索日付	直前の検索
1	5991	ニッパツ	東1	896	996.7	100	金属製品	2016/06/10	20.相関係数
2	6201	豊田自動織機製	東1	4490	640.7	100	輸送用機器	2016/06/10	20.相関係数
3	6326	クボタ	東1	1473.5	6708.5	100	機械	2016/06/10	20.相関係数
4	6584	三菱工業	東1	569	52.8	100	輸送用機器	2016/06/10	20.相関係数
5	6902	デンソー	東1	3909	3388.8	100	輸送用機器	2016/06/10	20.相関係数
6	6995	東海理化	東1	1752	550.3	100	輸送用機器	2016/06/10	20.相関係数
7	7186	コンコルディアF	東1	459.3	7029.7	100	銀行業	2016/06/10	20.相関係数
8	7201	日産自動車	東1	1053	13775.5	100	輸送用機器	2016/06/10	20.相関係数
9	7203	トヨタ自動車	東1	5627	11613.9	100	輸送用機器	2016/06/10	20.相関係数
10	7261	マツダ	東1	1759.5	4339	100	輸送用機器	2016/06/10	20.相関係数
11	7270	富士重工	東1	3909	3453.6	100	輸送用機器	2016/06/10	20.相関係数
12	7272	ヤマハ発動機	東1	1711	3003.1	100	輸送用機器	2016/06/10	20.相関係数
13	7278	エクセディ	東1	2458	122.1	100	輸送用機器	2016/06/10	20.相関係数
14	7282	豊田合成	東1	1985	279.8	100	輸送用機器	2016/06/10	20.相関係数
15	7283	愛三工業	東1	826	154.1	100	輸送用機器	2016/06/10	20.相関係数
16	8012	長瀬産業	東1	1222	277.6	100	卸売業	2016/06/10	20.相関係数
17	8593	三菱UFJリース	東1	435	3413.3	100	その他金融業	2016/06/10	20.相関係数
18	8601	大和証券グルー	東1	601.9	9952	1000	証券業	2016/06/10	20.相関係数

22銘柄合格してきましたが、検索結果では、どれが一番似ているかは分かりません。

そこで、詳細な検索結果を見ることとします。

「20. 相関係数」を実行するとデータフォルダである[C:\¥WinJPDta]中に相関係数の数値が書かれたファイルが自動で作成されます。

ファイル名は、[20. 相関係数.csv]です。

これをEXCELから開いてみましょう。各々の数値が分かります。

No.	コード	銘柄名	相関係数
1	20160610		
2	1	5991 ニッパツ	0.819
3	2	6201 豊田自動織	0.884
4	3	6326 クボタ	0.811
5	4	6584 三桜工業	0.807
6	5	6902 デンソー	0.846
7	6	6995 東海理化	0.81
8	7	7186 コンコルデ	0.832
9	8	7201 日産自動車	0.827
10	9	7203 トヨタ自動車	1
11	10	7261 マツダ	0.836
12	11	7270 富士重工業	0.873
13	12	7272 ヤマハ発動	0.81
14	13	7278 エクセディ	0.808
15	14	7282 豊田合成	0.81
16	15	7283 愛三工業	0.84
17	16	8012 長瀬産業	0.857
18	17	8593 三菱UFJリ	0.81
19	18	8601 大和証券	0.802
20	19	8604 野村HLDG	0.822
21	20	8609 岡三証券	0.813
22	21	8628 松井証券	0.807
23	22	8766 東京海上H	0.821

相関係数の大きい順に並び替える

20.相関係数.csv - Microsoft Excel

	A	B	C	D	E
	No.	コード	銘柄名	相関係数	
1	20160610				
2	No.	コード	銘柄名	相関係数	
3	9	7203	トヨタ自動車	1	
4	2	6201	豊田自動織機製作	0.884	
5	11	7270	富士重工業	0.873	
6	16	8012	長瀬産業	0.857	
7	5	6902	デンソー	0.846	
8	15	7283	愛三工業	0.84	
9	10	7261	マツダ	0.836	
10	7	7186	コンコルディアF	0.832	
11	8	7201	日産自動車	0.827	
12	19	8604	野村HLDG	0.822	
13	22	8766	東京海上HLDG	0.821	
14	1	5991	ニッパツ	0.819	
15	20	8609	岡三証券グループ	0.813	
16	3	6326	クボタ	0.811	
17	6	6995	東海理化	0.81	
18	12	7272	ヤマハ発動機	0.81	
19	14	7282	豊田合成	0.81	
20	17	8593	三菱UFJリース	0.81	
21	13	7278	エクセディ	0.808	
22	4	6584	三桜工業	0.807	
23	21	8628	松井証券	0.807	
24	18	8601	大和証券グループ	0.802	
25					
26					

7203トヨタは、基準銘柄なので当然「1」です。

似ている順番は、以降6201、7270、8012・・・と続きます。

トヨタは上がりそうだけど、軍資金がない。といった場合、他の銘柄で代用する、という方法もあることでしょう。