

「絞り込みシミュレーションの使い方」

J P 2 0 0 0 ソフトの「絞り込み検索」には、「連続検索」、「検証」、「シミュレーション」が付いています。

シミュレーション機能とは、どういうものかということ、仕掛ける条件と手仕舞い条件を作成し、これを繰り返していった場合、利益となるのか、損失となるのかを調べるものです。

J P 法株価分析システムでいうところの「投資シミュレーションメニュー」と似ています。

例えば、5日と25日の移動平均線がゴールデンクロスしたら仕掛けて、デッドクロスしたら手仕舞う。これを繰り返していったら、儲かるのか？が分かります。

今回は、この「シミュレーション機能」について解説していきます。

仕掛ける条件、手仕舞う条件は、共に連続検索シートで作成しておきます。

ここをクリックすると「連続検索」画面が表示されます。

1.移動平均GC・DC	21.ベータ値	41.資本金	61.検索対象銘柄選択	81.回帰直線
2.移動平均日柄	22.ホリゾンタルバンド上下抜	42.発行株・浮動株	62.最安値本数検索	82.PBR・BPS
3.株価と移動平均	23.JP法検索	43.出来高発行株比率	63.1株配当金	83.6本値比較
4.十字線	24.一日均衡表検索	44.業種区分	64.MACD検索	84.転換検索
5.窓空け	25.連続 陽線・陰線	45.上場区分	65.DMI検索	85.新波動検索
6.株価指定	26.酒田五法	46.1株当たり売上高	66.最大株価変化率	86.最大出来高・高安抜け
7.足取り	27.RJ指数	47.売上高経常利益率	67.複移動平均線	87.業績コメント検索
8.当日株価変化率	28.最大出来高	48.EPS黒字・赤字転換	68.P&F転換検索	88.売買代金検索
9.期間指定変化率	29.生弾&弾性値クロス	49.経常利益黒・赤字転換	69.売買単位(単元株数)	89.移動平均線バンド検索
10.ボックス圏抜け	30.ストキャスティクス(GC・DC)	50.利益黒字・赤字転換	70.買付金額	90.ホリゾンタルバンドクロス
11.新値N本足・足取り	31.ハラホリックライシステム	51.PER・PEG	71.ローソク足型	91.前比足取り
12.株価位置	32.超逆張り検索	52.経常利益伸び率	72.RCI(加速度指数)	92.ホリゾンタルバンド前比
13.株価日柄	33.ORLシオ	53.売上高伸び率	73.ユーザー銘柄管理	93.連続窓空け
14.出来高連続増加・減少	34.総合分析検索	54.EPS伸び率	74.検索結果→銘柄シート	94.RJクロス
15.出来高水準	35.ハイ・ローバンド検索	55.利益伸び率		95.Sカイリクロス
	36.高値・安値線検索	56.株価売上高倍率(PSR)	76.業績相場欄計算	96.運行線とボリバン
17.WORK検索	37.相対的弱気指数検索	57.1株利益(EPS)	77.業績相場欄表示	97.ROE(株主資本利益率)
	38.ストップ高・安銘柄検索	58.信用残検索	78.相場欄計算	
19.株価と移動平均(2)	39.上CMガ・下CMガ検索	59.移動平均間カイリ	79.相場欄表示	
20.相関係数	40.テクニカル評価検索	60.出来高移動平均	80.検索結果	

■仕掛ける条件 買い 1051番

25日ボリンジャーバンド +1シグマを上抜けたら買う

The screenshot shows a window titled "22.ボリンジャーバンド上下抜け" (22. Bollinger Bands Upper/Lower Break). The window is divided into two main sections: "検索条件" (Search Conditions) and "検索種別・日付" (Search Type/Date).

検索条件 (Search Conditions):

- Buttons: 実行 (Execute), 中止 (Cancel), 登録 (Register), 挿入 (Insert), 閉じる (Close).
- ボリンジャーバンド 周期入力 (Bollinger Bands Period Input):
 - 移動平均周期入力 (MA Period Input): 25
 - 標準偏差周期入力 (Std Dev Period Input): 25
 - δ 入力 [1~3] (delta input): 1
- 採用するボリンジャーバンド (Use Bollinger Bands):
 - 上バンド (Upper Band)
 - 下バンド (Lower Band)
- バンドの収束を調べる (周期に「0」を入力すると調べない) (Check for band convergence (do not check if '0' is entered for period)):
 - 周期(×日間) (Period (x days)): 0
 - 5 %以内に収束 (Converge within 5%)
- 上バンド (UPPERバンド) の向き (Upper Band Direction):
 - 上 (Up)
 - 下 (Down)
 - V字 (V-shape)
 - 逆V (Inverse V)
 - 無視 (Ignore)
- 下バンド (LOWERバンド) の向き (Lower Band Direction):
 - 上 (Up)
 - 下 (Down)
 - V字 (V-shape)
 - 逆V (Inverse V)
 - 無視 (Ignore)

検索種別・日付 (Search Type/Date):

- 採用株価 (Use Stock Price):
 - 始値 (Open)
 - 高値 (High)
 - 安値 (Low)
 - 終値 (Close)
- 採用株価がボリンジャーバンドを (Use Stock Price that breaks Bollinger Bands):
 - 上抜けた (Broke upper band)
 - 下抜けた (Broke lower band)
 - 無視 (Ignore)
 - 上にある (Above)
 - 下にある (Below)
- ××日間連続して (Consecutive days): 1
- 上にある (Above)
- 下にある (Below)

+1シグマを超えたから、さらに続伸を期待した順張りの仕掛け

■手仕舞い条件 売り 1052番

25日ボリンジャーバンド +1シグマを下抜けたら売る

22.ボリンジャーバンド上下抜け

検索条件

実行 中止 登録 挿入 閉じる

ボリンジャーバンド 周期入力

移動平均周期入力 25

標準偏差周期入力 25

δ入力[1~3] 1

採用するボリンジャーバンド

上バンド 下バンド

採用株価

始値 高値

安値 終値

採用株価がボリンジャーバンドを

上抜けた 下抜けた

無視

上にある 下にある

××日間連続して 1

上にある 下にある

バンドの収束を調べる(周期に「0」を入力すると調べない)

周期(××日間) 0 5 %以内に収束

上バンド(UPPERバンド)の向き

上 下 V字 逆V 無視

下バンド(LOWERバンド)の向き

上 下 V字 逆V 無視

順調なら、+1シグマに沿うように株価も上昇。
そして、天井打ちで+1シグマを下抜けると予想。

連続検索画面

連続検索設定画面 シート番号：1052

検索 0001 番から 0001 番まで 実行 します。 [一覧] [閉じる]

検証

仕掛け条件 1051 番から 1051 番まで 開始日付 2018/01/04 ~ 終了日付 2018/10/05 建玉期間 20

手仕舞条件 1052 番から 1052 番まで 実行 します。

日足検証 週足検証 月足検証

手仕舞い条件について

手仕舞い条件を使わずに検証を実行する。

大局条件の設定

設定しない 設定する

仕掛け・手仕舞い補助条件の設定 検証の確率表示に最高値・最安値を含める **シミュレーション**

シート設定

読込 書込 1052番

検索順番	検索No.	検索名	日週月	直近	検索日	前日数	項目01	項目02	項目03	項目04
1	22	22. ホリンジャーバンド上	1	0	18/06/22	0	25	25	1	

19. 株価と移動平均(2)
20. 相関係数
21. ベータ値
22. ホリンジャーバンド上ト抜ナ
23. JP分析検索
24. 一目均衡表
25. 連続陽線・陰線
26. 酒田五法
27. RJI指数
28. 最大出来高
29. 生弾&弾性値クロス
30. ストキャスティクスGC・DC
31. パラボリックプライスシステム
32. 超逆張り
33. CRレゾナ
34. 総合分析
35. ハイ・ローバンド

ここをクリックすると実行します。

対象は225採用銘柄

日足

シミュレーション期間は、2018年

仕掛けてから持続する期間は20日

としました。

この条件に深い意味はありません。

時間が掛かるので、銘柄数を少なく、期間も2018年のみとしました。

検証結果画面

進行状況		銘柄数:225/225		仕掛け→手仕舞い総件数		
対象銘柄		銘柄9984 ソフトバンクグループ		2101		
				印刷		
+30%以上の確率	0.14 %	+30%以上の件数	3 件			
+20%以上の確率	0.29 %	+20%以上の件数	6 件			
+10%以上の確率	2.52 %	+10%以上の件数	53 件			
5~+10%の確率	30.03 %	5~+10%の件数	631 件			
0~+5%の確率	6.04 %	0~+5%の件数	127 件			
0~-5%の確率	57.83 %	0~-5%の件数	1215 件			
-5~-10%の確率	2.90 %	-5~-10%の件数	61 件			
-10%以下の確率	0.19 %	-10%以下の件数	4 件			
-20%以下の確率	0.05 %	-20%以下の件数	1 件			
-30%以下の確率	0.00 %	-30%以下の件数	273 件			
コード	仕掛け条件	条件合格日	合格日終値	仕掛け日付	仕掛値	仕掛日日柄
9984	1051	20181004	11200	20181005	11105	1
	手仕舞条件	条件合格日	合格日終値	手仕舞日付	手仕舞寄付	手仕舞日柄
	1052	20181005	11075	20181005	11105	0
掛→舞高値日	最高値	最高値日柄	上昇率	仕掛仕舞日柄		
20181005	11145	0	0.36	0		
掛→舞安値日	最安値	最安値日柄	下降率	上昇下降率		
20181005	10985	0	-1.08	0.00		
検証期間高値日	最高値	最高値日柄	上昇率			
20181005	11145	0	0.36			
検証期間安値日	最安値	最安値日柄	下降率			
20181005	10985	0	-1.08			

0 から + 1 0 % の上昇確率は、合計して 30.03+6.04=36.07%

0 から - 1 0 % の下降確率は、合計して 57.83+2.90=60.73%

仕掛けてから下がる確率のほうがやや有利のようです。
5%以内の下落が多い。

目論見は、上昇相場において、ボリンジャーバンド+1シグマを上抜けたから、高値追いのつもりで買った訳ですが、検証結果からだと芳しくありません。

シミュレーションの詳細結果はどうなっているのでしょうか？

結果は[csv]ファイルで保存されており、EXCEL などの表計算ソフトから見ると出てきます。
保存場所は[C:\¥JPDATA2000¥KenSho]フォルダです。

ファイル名は[JPRKenSym1051-1051-1052-1052Day.csv]

このファイルをEXCELから表示させてみましょう。

内容はこのように大きいです。

注目するところは、一番右です。

AG	AH	AI	AJ
損益	コメント		
41	時間切れ	補助条件に合格	
1	手仕舞条件	補助条件に合格	
-9	手仕舞条件	補助条件に合格	
-5	手仕舞条件	補助条件に合格	
38	時間切れ	補助条件に合格	
73	時間切れ	補助条件に合格	
30	手仕舞条件	補助条件に合格	
-95	手仕舞条件	補助条件に合格	
15	手仕舞条件	補助条件に合格	
-30	手仕舞条件	補助条件に合格	
300	手仕舞条件	補助条件に合格	
105	手仕舞条件	補助条件に合格	
50	手仕舞条件	補助条件に合格	
15	手仕舞条件	補助条件に合格	
-55	手仕舞条件	補助条件に合格	
-130	手仕舞条件	補助条件に合格	
230	時間切れ	補助条件に合格	

「AG」のセルが実際の損益となります。

ここがマイナスだらけだと、買いでは失敗の条件といえますが、反対の売りでは良しとなります。

今回の合計値は、6702.6円です。

仕掛けてから20日経過していないものもあり、ピタリと正確ではありませんが、繰り返し仕掛ければ、利益という事が分かります。

※建玉期間が20日なので、実際のシミュレーションは直近から20日前にさかのぼって実行したほうがより正確となります。
その代わり直近20日間については、どうなっているか分かりません。

検証結果では、下落が有利だったのですが、これは5%も下がらなかったからでしょう。

検証結果画面では、「0から-5%の下降率」というくりなので、-1%台が多かったという事などが考えられます。

「P」のセルが上昇下降率なので、ここを調べれば分かります。

「AH」のセルのコメントの意味は下記の通りです。

「時間切れ 補助条件に合格」

→時間内で手仕舞い条件である+1シグマ下抜けが来なかった。
20日間ずーっと上昇していたと考えられる。

「手仕舞条件・補助条件に合格」

→+1シグマ下抜けに合格した。

絞り込み検索で、毎日の実行する検索があって、それが利益となるのか、ならないのかは、シミュレーション機能で分かります。

ただ、手仕舞いの条件もきちんと決めておかないといけません。

仕掛けの条件はあるが、手仕舞いは用意していない。という場合は、「検証」を使って下さい。

こちらにもシミュレーション機能同様に、詳細な内容のファイルが[csv]で保存されています。

「絞り込み検証の解説」サイト

<http://www.neuralnet.co.jp/user/jp2000/shibori-kensho/index.html>

この機能を使うと、頭の中で、儲かるだろうと思っていた検索条件や、チャートをいくつか眺めて、儲かるタイミングのテクニカル分析の条件を見つけ出した場合、果たしてそれが有効なのかどうか分かります。

検証が好きな方以外だと、とっつきにくいかもしれません。
ご不明な点は、ご連絡下さい。