

「絞り込み検証 はじめの一步」

J P 法株価分析システムには、「絞り込み検索」の検証はありませんが、J P 2 0 0 0 のそれにはあり、「絞り込み検証」と言っています。

過去の原稿で、いくつか解説してありますので、そちらもご覧下さい。

ソフト利用事例集 第379回 「絞り込み検証を使う」

<http://www.neuralnet.co.jp/howjp/index.html>

「絞り込み検証」解説サイト

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

「絞り込み検証」はとっつきにくい機能ですが、過去検証をするにあたってはとても重要するものです。

今回は、はじめの一步という事で、基本的な使い方、そして結果のファイルについて解説していきます。

まず、「絞り込み検証」を使う前に、「絞り込み検索」の「連続検索」の使い方を知っておかなければいけません。

「絞り込み検証」は連続検索のシートを過去検証するためのものだからです。

ここでは、連続検索について解説はしません。

ホームページや動画で度々紹介しておりますので、そちらをご覧下さい。

J P 分析、WORK 分析にそれぞれ「検索」、「検証」があるのと同じ考え方です。

それぞれ、J P シート、WORK シートについて検索、検証が出来ます。

絞り込み検索では、連続検索シートを使って、検索、検証をします。

「連続検索」の画面に「検証」があります。

「検証」機能はここです。

絞り込み検索・連続検索用シート設定・実行 2024/03

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 1000 番から 1000 番まで 実行 します。 開始日付 2017/03/28 ~ 終了日付 2025/03/07 建玉期間

手仕舞条件 2000 番から 2000 番まで

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

読み 書き コメントを入力

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
1.		移動平均GC・DC								
2.		移動平均GC・DC後日柄								
3.		株価と移動平均								
4.		十字線								
5.		窓空け								
6.		株価指定								
7.		足取り								
8.		当日株価変化率								
9.		期間指定変化率								
10.		ボックス圏抜け								
11.		新値N本・足取り								
12.		株価位置								
13.		株価日柄								
14.		出来高連続増加・減少								
15.		出来高水準								
16.										
17.		WORK分析検索								

検証するにあたり仕掛ける連続検索シート、手仕舞う連続検索シートを用意しておきます。

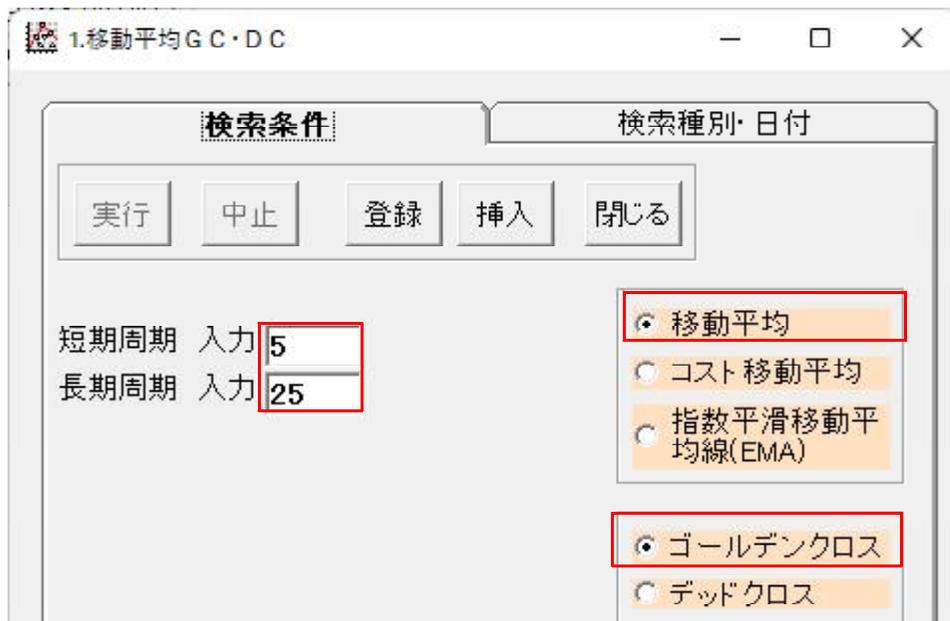
この手仕舞うシートがある、という事が J P 分析、WORK 分析と違います。

手仕舞うシートを用意していなくても、「検証」は出来ませんが、今回は入りと出を決めてやっていきます。

ここでは、3080番を仕掛けるシート、3081番を手仕舞うシートとしました。

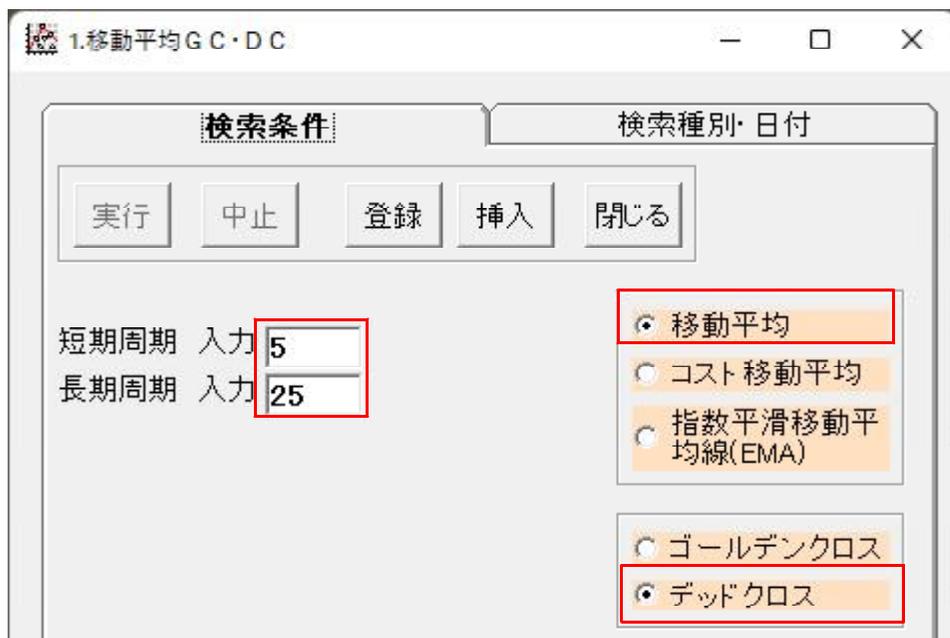
仕掛けシート 3080番シートの内容

5日と25日の移動平均線がゴールデンクロスした



手仕舞いシート 3081番シートの内容

5日と25日の移動平均線がデッドクロスした

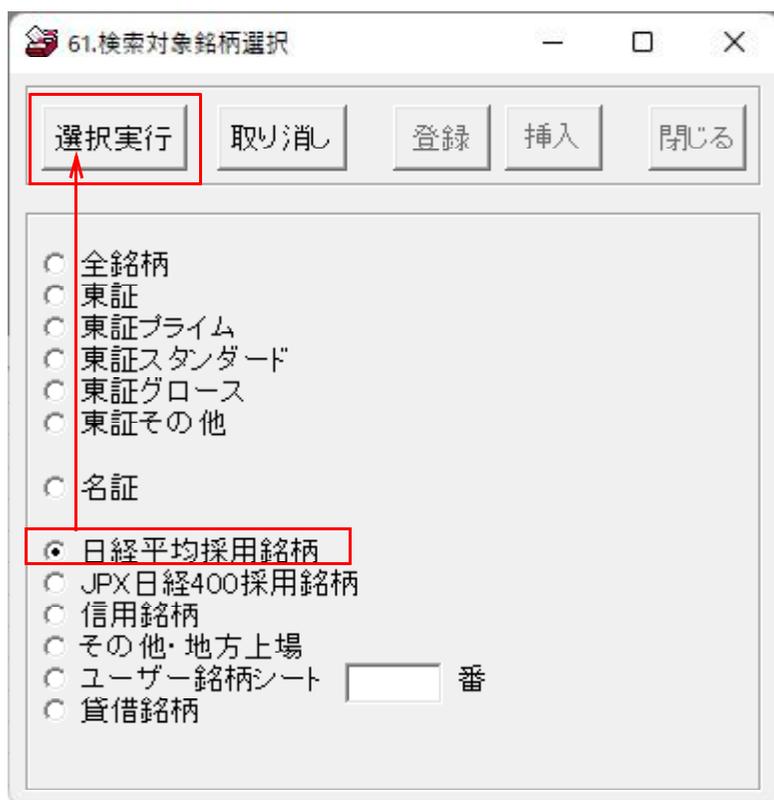


簡単にいうと、ゴールデンクロスしたら、仕掛けて、デッドクロスしたら手仕舞う。というものです。

「検証」を実行する前に、しておかなければいけない事があります。

この手順は忘れがちなので、しっかり覚えておいてください。

6 1. 検索対象銘柄選択をしておく事。



ここでは「日経平均採用銘柄」とします。

「検証」は、まずどの銘柄群について調べるのかを設定します。

そのため、6 1. 検索対象銘柄選択をあらかじめ実行しておきます。

※連続検索シートでは、一番最初に6 1. 検索対象銘柄選択を登録しておきますが、「検証」は、シートに登録した6 1. 検索対象銘柄選択を実行しません。無視します。なので、上述の処理が必要なのです。

では、もし6 1. 検索対象銘柄選択をしなかったらどうなるのかというと、8 0. 検索結果に残っている銘柄について「検証」します。

つまりは、前回検索した結果について、「検証」してしまうという事です。

このあたりは、実際に「検証」を実行すれば分かりますので、

覚えることは、検証するには、最初に6 1. 検索対象銘柄選択をする。とだけ覚えておいてください。

このように設定します。

連続検索設定画面 シート番号: 3081

検索 0001 番から 0001 番まで 実行 します。

検証

仕掛け条件 3080 番から 3080 番まで 実行 します。 開始日付 2024/01/04 ~ 終了日付 2024/12/30 建玉期間 40

手仕舞条件 3081 番から 3081 番まで

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

仕掛ける条件は、3080番のみ

手仕舞う条件は、3081番のみ

日足検証で、期間は2024年の1年間のみとします。
※時間がとてもかかるので、こうしました。

そして、建玉期間は40日です。

仕掛けてから40日先までを調べます。

手仕舞い条件を使わない検証は、後日解説します。

仕掛ける条件、手仕舞う条件が複数のシートにまたがっている場合は、
例えば、10番シートから15番シートなどという設定も出来ます。

連続検索設定画面 シート番号: 10

検索 10 番から 15 番まで 実行 します。

検証

仕掛け条件 10 番から 15 番まで 実行 します。 開始日付 2024/01/04 ~ 終了日付 2024/12/30 建玉期間 40

手仕舞条件 20 番から 25 番まで

日足検証 週足検証 月足検証

ただし、この場合、10番シート、11番シート・・・15番シートと検証を実行していきますので、13番シートは、手仕舞い条件がある場合、この設定は出来ません。

必ず、10番シートから15番シートは仕掛ける条件を作成しておいてください。

手仕舞うシートは20番シートから25番シートです。途中のシート番号で仕掛ける条件を入れておかなくてください。

続けて、パソコン画面右側に「補助条件」が表示されています。

ここでは、仕掛けるシート、手仕舞うシートに合格した時、すぐ行動するのか、少し待つのか、といった事を決めます。

J P分析の検証、WORK分析の検証では、シートに合格した翌日の始値で仕掛けるしていますが、絞り込み検証では、柔軟に設定出来ます。

例えば、シートに合格してから、2日後に仕掛ける、1%下がったら仕掛ける、

シートに合格してから、2日後以降に1%上昇したら仕掛ける、または1%下がったら仕掛けるといった細かい設定が出来ます。

今回は、一番簡単な設定である「通常の仕掛け、通常の手仕舞い」を採用します。

「補助条件」画面

仕掛け補助条件 仕掛け条件に合格した日が基準日、終値が基準価格

- 条件1 通常の仕掛け(翌日寄付で仕掛ける)
- 条件2 1 日後に仕掛ける
- 条件3 9999 %または -10 % (マイナス値) になったら仕掛ける
- 条件4 1 日以降に 9999 %または -9999 % (マイナス値) になったら仕掛ける
- 条件5 合格日終値で仕掛ける(当日終値)

手仕舞補助条件 手仕舞条件に合格した日が基準日、終値が基準価格

- 条件1 通常の手仕舞(翌日寄付で手仕舞う)
- 条件2 1 日後に手仕舞う
- 条件3 9999 %または -9999 % (マイナス値) になったら手仕舞う
- 条件4 1 日以降に 9999 %または -9999 % (マイナス値) になったら手仕舞う

手仕舞条件を使わない場合の補助条件 仕掛け日が基準日、仕掛値が基準価格

- 条件1 9999 %または -9999 % (マイナス値) になったら手仕舞う
- 条件2 1 日後に手仕舞う
- 条件3 1 日以降に 9999 %または -9999 % (マイナス値) になったら手仕舞う

ここまでセットしたら「実行」します。

検証実行中の画面が表示されます。

検証実行中 1952/1952
閉じる

進行状況	銘柄数:225/225		仕掛け→手仕舞い総件数	1478
対象銘柄	銘柄 9984 ソフトバンクG		印刷	

+30%以上の確率	0.07 %	+30%以上の件数	1 件
+20%以上の確率	0.34 %	+20%以上の件数	5 件
+10%以上の確率	2.10 %	+10%以上の件数	31 件
5~+10%の確率	18.67 %	5~+10%の件数	276 件
0~+5%の確率	5.14 %	0~+5%の件数	76 件
0~-5%の確率	50.95 %	0~-5%の件数	753 件
-5~-10%の確率	18.54 %	-5~-10%の件数	274 件
-10%以下の確率	4.19 %	-10%以下の件数	62 件
-20%以下の確率	0.00 %	-20%以下の件数	0 件
-30%以下の確率	0.00 %	-30%以下の件数	0 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	3080	20241205	9096	20241206	9100	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
3081	20241224	8809	20241225	8914	1

掛→舞高値日	最高値	最高値日柄	上昇率	仕掛仕舞日柄
20241217	9837	7	8.10	13

掛→舞安値日	最安値	最安値日柄	下降率	上昇下降率
20241220	8760	10	-3.74	-2.04

検証期間高値日	最高値	最高値日柄	上昇率
20250123	10890	29	19.67

検証期間安値日	最安値	最安値日柄	下降率
20241220	8760	10	-3.74

仕掛ける条件は、買い条件だと思いがちですが、ここでは買い条件でも空売り条件でもあります。

今回は、ゴールデンクロスが仕掛け条件ですから、買い条件となります。

仕掛け条件を3081番とした場合、デッドクロスですから、売り条件となります。

J P分析検証、WORK分析検証でいうところの「上昇率検証」、「下降率検証」です。

上昇率検証を選択したら、仕掛け条件は買いです。下降率検証を選択したら仕掛け条件は売りです。

※本当はそうともいえないのですが、話がややこしくなるので省きます。

仕掛ける条件が買いの場合の考え方

上昇率検証なので、こちらに注目するわけですが、

+30%以上の確率	0.07 %	+30%以上の件数	1 件
+20%以上の確率	0.34 %	+20%以上の件数	5 件
+10%以上の確率	2.10 %	+10%以上の件数	31 件
5~+10%の確率	18.67 %	5~+10%の件数	276 件
0~+5%の確率	5.14 %	0~+5%の件数	76 件
0~-5%の確率	50.95 %	0~-5%の件数	753 件
-5~-10%の確率	18.54 %	-5~-10%の件数	274 件
-10%以下の確率	4.19 %	-10%以下の件数	62 件
-20%以下の確率	0.00 %	-20%以下の件数	0 件
-30%以下の確率	0.00 %	-30%以下の件数	0 件

J P分析検証、WORK分析検証でいうところの「ダメの確率」の詳細がここで分かります。

仕掛ける条件が売りの場合は、反対です。

下降率検証なので、下側に注目します。

+30%以上の確率	0.07 %	+30%以上の件数	1 件
+20%以上の確率	0.34 %	+20%以上の件数	5 件
+10%以上の確率	2.10 %	+10%以上の件数	31 件
5~+10%の確率	18.67 %	5~+10%の件数	276 件
0~+5%の確率	5.14 %	0~+5%の件数	76 件
0~-5%の確率	50.95 %	0~-5%の件数	753 件
-5~-10%の確率	18.54 %	-5~-10%の件数	274 件
-10%以下の確率	4.19 %	-10%以下の件数	62 件
-20%以下の確率	0.00 %	-20%以下の件数	0 件
-30%以下の確率	0.00 %	-30%以下の件数	0 件

上側は「ダメの確率」となります。

この検証結果から、大雑把に仕掛けてから手仕舞うまでの上昇率は、+10%以内が、23.81%となります。

+30%以上の確率	0.07 %	+30%以上の件数	1 件
+20%以上の確率	0.34 %	+20%以上の件数	5 件
+10%以上の確率	2.10 %	+10%以上の件数	31 件
5~+10%の確率	18.67 %	5~+10%の件数	276 件
0~+5%の確率	5.14 %	0~+5%の件数	76 件
0~-5%の確率	50.95 %	0~-5%の件数	753 件
-5~-10%の確率	18.54 %	-5~-10%の件数	274 件
-10%以下の確率	4.19 %	-10%以下の件数	62 件
-20%以下の確率	0.00 %	-20%以下の件数	0 件
-30%以下の確率	0.00 %	-30%以下の件数	0 件

そして、仕掛けてから手仕舞うまで-10%まで下がる確率が、69.49%です。

■結果の考え方

「ゴールデンクロスで買って、デッドクロスで売る」という条件で検証したわけですが、この結果から2024年の225採用銘柄では、下がる確率、損をする確率のほうが高いという事が分かります。

逆に、ゴールデンクロスで売って、デッドクロスで買ったほうが儲かるという結果になりました。

この事が、先にちょっと書いた「仕掛ける条件は買いでも売りでもない」につながります。

結果を見て、この条件は買いのほうに儲かるから買い、空売りしたほうが儲かるから売りとなります。

本来、買いと思っていた条件が空売りしたほうが儲かった。という事です。

J P分析検証、WORK分析検証でいうところの、買い条件として作ったけど、「下降率検証」をしたら、逆に儲かったという意味合いです。

絞り込み検証はこの「上昇率検証」+「下降率検証」を同時に実行します。

※ J P分析検証、WORK分析検証で、買い条件なのに「下降率検証」、売り条件なのに「上昇率検証」は思いつかない事かもしれませんが、実際やってみると、意外な結果が分かるかもしれません。

こちら是非、実行してみてください。例えば、逆張り買いの条件を「下降率検証」してみる、とかです。

大雑把に見た目は分かった。

では、1つ1つ合格した銘柄を知りたい。

この場合は、結果ファイルを直接EXCELなどの表計算ソフトで見ます。

絞り込み検証の結果ファイルは、

[C:¥JPDATA2000¥KenSho] フォルダに入っています。

今回実行した検証結果のファイル名は、下記です。

JPRKenSho3080-3080-3081-3081Day.csv

このファイル名作成には、ルールがあります。

分解すると

JPRKenSho 絞り込み検証という意味

3080-3080 仕掛け 始めと終わりのシート
- 区切り

3081-3081 手仕舞 始めと終わりのシート

Day 日足検証 **Wek**・・週足 **Mon**・・月足
.csv CSVファイル

例. 下記のファイル名なら、

JPRKenSho0010-0015-0020-0025Wek.csv

週足検証 仕掛けシートは10番から15番、手仕舞いシートは20番から25番と
いう意味です。

表が大きいので、削って表示させてみました。

表の右側にある「損益」が実際の結果です。



コード	銘柄名	仕掛け条件	条件合格日	合格日終値	仕掛け日付	仕掛け値	損益	コメント
1332	ニッセイ	3080	20240424	965.1	20240425	965.8	-45.2	手仕舞条件・補助条件に合格
1332	ニッセイ	3080	20240424	965.1	20240425	965.8		最高値・最安値項目
1332	ニッセイ	3080	20240702	870.9	20240703	870.9	-19.9	手仕舞条件・補助条件に合格
1332	ニッセイ	3080	20240702	870.9	20240703	870.9		最高値・最安値項目
1332	ニッセイ	3080	20240717	876.4	20240718	885	-85	手仕舞条件・補助条件に合格
1332	ニッセイ	3080	20240717	876.4	20240718	885		最高値・最安値項目
1332	ニッセイ	3080	20240820	864.8	20240821	855.7	66.5	手仕舞条件・補助条件に合格
1332	ニッセイ	3080	20240820	864.8	20240821	855.7		最高値・最安値項目
1332	ニッセイ	3080	20241009	937.8	20241010	944	-54	手仕舞条件・補助条件に合格
1332	ニッセイ	3080	20241009	937.8	20241010	944		最高値・最安値項目
1332	ニッセイ	3080	20241105	932	20241106	940	-22	手仕舞条件・補助条件に合格
1332	ニッセイ	3080	20241105	932	20241106	940		最高値・最安値項目
1332	ニッセイ	3080	20241202	938.9	20241203	936.1	-14.9	手仕舞条件・補助条件に合格
1332	ニッセイ	3080	20241202	938.9	20241203	936.1		最高値・最安値項目

コメント部分には、簡単に手仕舞った詳細が書かれています。

いかがでしたでしょうか？

今回ははじめの一步という事で、簡単な設定方法を紹介しました。

やろうと思えば結構、複雑な事が出来、検証を主体とされている方には、もってこいの機能だと考えます。

作成した連続検索シートが過去においても利益を出しているものとなれば、お宝シートとなる事でしょう。

連続検索は、1日、1日の合格銘柄は分かりますが、これら合格銘柄がその後、どうなったのか、上がったのか、下がったのか。を見るにはチャートとにらめっこしないといけません。

しかし、この絞り込み検証を使えば、上述の結果ファイルを見て分かる通り、一発で利益が出ているのか、いないのかが判明します。

検証を実行すると時間がかかるのが難点ではありますが、実際にテクニカル分析で利益を出していくには、過去検証が重要です。

連続検索を使っている方は、是非チャレンジしてみてください。

分からない事がありましたら、ご連絡ください。

解説を動画で作成し、J P法の YouTube にアップします。