「WORK分析検証の使い方」 ニューラルネットシステム㈱ 富士栄

WORK分析検証はWORKシートにあるテクニカル指標についての検証することがで きます。使いこなすには、テクニカル指標についてある程度知っていないといけません が、比較的簡単に使えるものも登録されています。

※検証とは、簡単にいいますと「Aという手法で過去どのくらい儲かったのか」を調べるためのものです。

今回は、よく見かける分析手法を使い実際どのくらい儲かるのかを調べてみることにし ます。また、日経平均の条件を追加した場合も検証します。

条件は、「5日移動平均線が25日移動平均線を上回った時」とし、その時買いを仕掛 けたら儲かるのかを調べます。

これを簡単にいうと、5と25移動平均のゴールデンクロスとなります。 皆様も十分にご承知でしょう。

WORKシートでは下記のようにセットします。

※M指標、MAV指標の周期に数値が入っていますが、これは固定情報なので無視して ください。

■WORKシートの設定内容

例として日足の56番シートに登録しました。

「JP法メインメニュー」-「WORK分析メニュー」を使います。 「検証」から「日足検証」を選択-「シート編集」-「56」-「初期化」です。

チェックに「1」、周期 短に「5」、中に「25」を入力します。

WORK分析シート 日	足用	56番	0.0	4	/					100	1			x
					/									
一覧表							取込	CSV		初期	化血尿	1 【保存	字 閉じ	3
	チェック	周期			∨字			以上			以下			(.
		短	中	Ł	短	中	長	短	中	長	短	中	長	7
サイコロジカルライ														
オシレータ			/	_	_					-	_	-	-	
RCI							_					_		-
		4.10	0.00		_							_	_	-
MII信(同期固定)		4.13	0.20											-
中本宣位家		4.13	3.20		-					-				-
出来高倍率 2		- 1	-		-								-	-
S相対力指数		- /												-
<u>Sオシレータ</u>														
RJ指数		1												_
VR①(ボリュームレシオ1)		/												
VR@(ボリュームレシオ2)		,												
移動平均①				_				_		_		-	_	-
移動平均②	1	5	25									_	_	_
ハイローハント 市体組の (宣体採用					-					_		-	_	-
<u>中値線の(</u> 同値休用 由値線の(完値採用														-
株価位置				-	-								-	-
中值線										_				-
高値安値線変動率														-
出来高移動平均														
														-
•														• //

シートを横にスクロールさせ、

·覧表					取込	csv	愛	更	7期化	印刷	」 [係	存	閉じる
		以下		-	GC以上			GC以下			DCULL		
	長	短	中	長	短中	中長	短長	短中	中長	短長	短中	中長	短長
イコロジカルライ			1<0A	1		MI-RACE						1	
シレータ													
CI													
ТС													
皆標(周期固定)													
/指標(周期固定)	-												
来高倍率													
来高倍率 2													
相対力指数													
オシレータ	-												
J指数													
D(ボリュームレシオ1)													
②(ボリュームレシオ2)													
動平均の													
動平均②					1			1					
イロ・パンド -					1			1					
値線①(高値採用					/			1			-		
値線②(安値採用				/							_		_
価位置													
値線													
値安値線変動率													
来高移動平均													

GC以上 短中に「1」、GC以下 短中に「1」を入力します。

ここまでの入力で、「5日移動平均線が25日移動平均線を上回った時」が完成しました。

続けて、「保存」をクリック、

「56」-「OK」です。

×
(
山
_

■WORK検証

下記のようにセットします。

個別銘柄の買い条件は、56番シートに登録しました。

サインが表示されてから、どのくらい先までを調べるかは20日(およそ一ヶ月)、 対象は225採用銘柄です。

最長周期「52」はそのままで構いません。



※検証開始日付、検証終了日付はそのままで構いません。

ここまで出来たら、「実行」をクリックし検証をスタートさせます。

検証中の画面が表示されます。銘柄、数値などがクルクルと変わっていっていることが 見てとれることでしょう。

9984ソフトバンクまでいくと、下記のように数値が止まります。 これは、検証が終了したことを表しています。



ダメの確率(5%未満の上昇率)が52.82%ですから、仕掛けた銘柄が5%以上、 上昇した確率は、およそ47%です。

大ざっぱにいうと、この条件で仕掛けて儲かる確率は半分です。

5と25の移動平均線がゴールデンクロスしたからといって、仕掛けることは得策では ないようです。

それでは、次に日経平均の条件を加味した場合の検証をしてみましょう。

個別銘柄がゴールデンクロスしたタイミングで仕掛けても、儲からないことは分かった。

それでは、全体相場の指標である日経平均が買い場のタイミングの時、仕掛けたらどう なのだろうか・・・。

※今までは、日経平均が下降であっても上昇であっても、個別銘柄にサインが点灯したら仕掛けるという検証でした。

この検証をするためには、「日経平均の買い場」という条件を決めないといけません。

何をもって日経平均の買い場とするかです。

あまり難しく考えずに、こちらも個別銘柄同様、移動平均線を使ってみることにします。

■日経平均の買い場設定

買い場の条件はこのようにします。

「5日移動平均線が25日移動平均線の上にある時」、買い場とする。

WORKシートでは下記のようにセットします。※55番シートを使いました。

	000					1						-		<u> </u>	
						/									
一覧表								取込	csv	変更	初期化	; 印刷	保存	2 閉し	る
	1- nh	画曲	1	1	1	/空	-		NE			1115	1		6
-	1111	10 次	ф	長	1 ¥		ф	長	- 坂工	φ	Ē	短	ф	長	4
サイコロジカルライ		1/14	201	x	\square°	¥	200 R.		1/14	a letter		1.44	1.1		
オシレータ															-
RCI		-		1											
STC				1											
M指標(周期固定)				/											
MAV指標(周期固定)															
出来高倍率			/												
出来高倍率 2															
S相対力指数										-				-	
<u> </u>															
R J 指数															
<u>VR①(ボリュームレシオ1)</u>			./												
VR@(#*リュームレシオ2)			y		_										
移動半均(1)			0.5	<u>n</u>	_										
移動平均②	1	5	25	<u> </u>	_										
ハイローハント		-			_								-		
<u> 中間線</u> (高値採用) 市体組の(完体が円)	-				-									-	
中値線して可能用															
山佔領				-	_			_		-					
<u></u> 直值安值線変動家					_										
出来高移動平均															-
					-				-			-			
1			1	-			1	1	1	4	1	1	<u> </u>	1	
	-	-													_ //

シートを横にスクロールさせ、大小、短中の項目に「1」です。

WORKシート 日足用	055番	8.1	1.000					1				1.0		
1						1			1				(investore	1
覧表						取込	CS	<u> </u>	変更	初期	化	印刷	保存	閉じる
	DC以上			DC以下			大小			昇降			基準値	
	短中	中長	短長	短中	中長	短長	短中	中長	短長	短	中	長	短	中
サイコロジカルライ														
オシレータ														
RCI														
STC														
M指標(周期固定)											_			
MAV指標(周期固定)														
出来高倍率											_			
出来高倍率 2														
S相対力指数														
<u> </u>			_	-										
R J 指数														
VR①(ボリュームレシオ1)														
VR@(ボリュームレシオ2)				-			V			-	_			
移動平均の			-						_		_	_		
移動半均②							1				_			
ハイローハンド				_			_	_		_				
<u>中値線①(高値採用</u>		-							-	-				
<u>中値線②(安値採用</u>			-	-				-		-	_	_		
林価位面							_			-		_		
<u>甲値線</u>			_	_			_		_			_		
<u>局値安値線変動率</u>		-				_		-		-	-			
出米高移動半均			-	-			-	-		-	-	-		
						-								-
<u> </u>														► //.

■全体条件を組み込む

「大局条件の設定」を下記のようにします。

この意味は、1004日経平均が55番のシートに合格した時のみ、個別銘柄の検証を する、という内容です。

よって、日経平均が55番に1回も合格しない場合は、検証をしません。 ※見た目は、動いていますが、結果はゼロです。



※大局の条件は、何も日経平均でなくても構いません。TOPIXでも東証一部単純平 均でも、場合によっては、日経JQ平均ということもありえます。 各自、自由にセット出来ます。

ここまで入力出来たら、「実行」をクリックし検証を開始しましょう。

結果は下記の通りです。



ダメの確率が、54.46%。よって5%以上上昇する確率はおよそ45%です。

日経平均が買い場の時のみ出動するという検証をしたのに、良くなっていると思いきや、 逆に少し悪くなっています。

このことから、一ヶ月という期間においては、5と25のゴールデンクロスは使えないということになります。

よくインターネットの株式ニュースで書いていることは、アテにはならない。というこ とです。

しっかりと各自検証をしてみましょう。

それでは、三ヶ月という期間ではどうでしょうか?

この場合の検証はこのように設定します。

売買期間に「60」と入力します。厳密に三ヶ月ではありませんが、仕掛けてから60 日先までみるという意味です。



結果は各自、お試し下さい。また「JP1000」ソフトユーザー各位も同じようにしてみてください。直近1年間(JP法ソフト)と4年間(JP1000)の違いが分かるかと思います。

- ・今回は、移動平均線で試しましたが、WORKシートには移動平均線からの離れ具合 をみる「カイリ度」や相対力指数(RSI)、サイコロジカルラインなどが入ってい ます。
- ・お気に入りのテクニカルがあれば試してみましょう。

■2月限 225オプション参考メールの結果

下記の実績は、1月限から継続されている方のプランと2月限新規のプランです。今月 もボラティリティが低く、そのためプレミアムが安い。という時期でしたが、2月限は 共に+15万円ほどとなりました。

最近は、儲けにくい時期が続いており、枚数を増やしがちです。用心しましょう。 投機、投資に100%はありませんから・・・。 |2011年2月限 継続分

種別	限月	行使価格	プレミアム	枚数	現値	損益	仕掛日付	決済日付	日柄
1 コール買い	2011年2月	10750	115	1	40	-75	2011/1/7	2011/1/21	14
1 コール買い	2011年2月	10750	115	1	20	-95	2011/1/7	2011/1/24	17
2 コール売り	2011年2月	11000	55	2	0	110	2011/1/7	2011/2/10	34
2 コール売り	2011年2月	11250	18	4	0	72	2011/1/12	2011/2/10	29
4 ブット 売り	2011年2月	9750	12	4	0	48	2011/1/18	2011/2/10	23
2 コール売り	2011年2月	10750	20	1	25	-5	2011/1/24	2011/1/26	2
2 コール売り	2011年2月	10750	20	3	0	60	2011/1/24	2011/2/10	17
4 ブット 売り	2011年2月	1 0000	20	2	0	40	2011/1/26	2011/2/10	15
						Δ 155	(1000円単位)		

2011年2月限 新規分

種別	限月	行使価格	プルミアム	枚数	現値	損益	仕掛日付	決済日付	日柄
2 コール売り	2011年2月	11250	5	7	0	35	2011/1/18	2011/2/10	23
4 ブット 売り	2011年2月	9750	12	2	19	-14	2011/1/18	2011/1/24	6
4 ブット 売り	2011年2月	9750	12	3	0	36	2011/1/18	2011/2/10	23
2 コール売り	2011年2月	10750	20	3	0	60	2011/1/24	2011/2/10	17
4 ブット 売り	2011年2月	10000	20	2	0	40	2011/1/26	2011/2/10	15
						Δ 157	(1000円単位)		

■継続中の損益累積グラフ

日経225オプション取引実績



過去の実績はこちらです。

http://www.neuralnet.co.jp/225option-prog/mail/index.html