

「移動平均線の検証ーゴールデクロス編ー」

JP法研究会 富士栄

トレンドフォロー分析の雄として移動平均線があげられます。

例えば、株価が5日平均を上回った、25日平均を下回った、ゴールデクロスした、75日平均、200日平均などを使ったものです。

テレビでもよく評論家が使っています。また、ネットのニュース記事ばかりです。

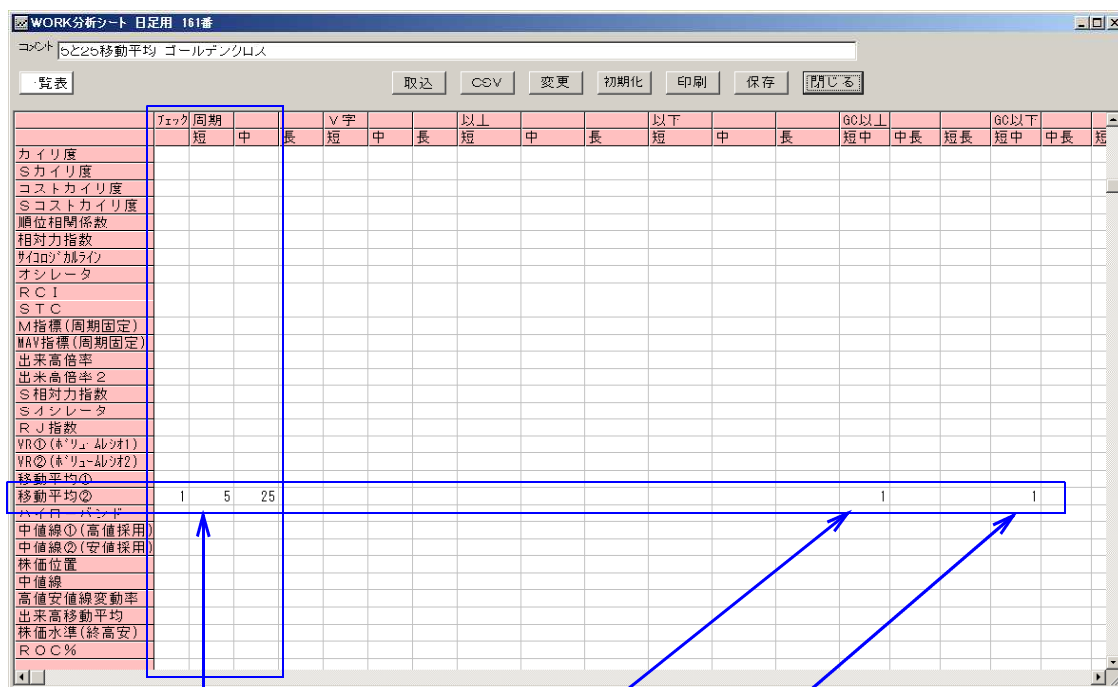
では、皆が注目していると思われる移動平均線を使って、実際はどのくらい儲かるのでしょうか？

今回は、5日平均と25日平均がゴールデクロスした時に、個別銘柄を買ったらどのくらい儲かったのかを調べてみます。

こうした移動平均線の分析は、JP法ソフトの「WORK分析」で可能です。

「JP2000」ソフトを使い2015年のみについて検証してみました。

■使うシート



移動平均②を使います。

チェックに「1」

周期 短に「5」 中に「25」

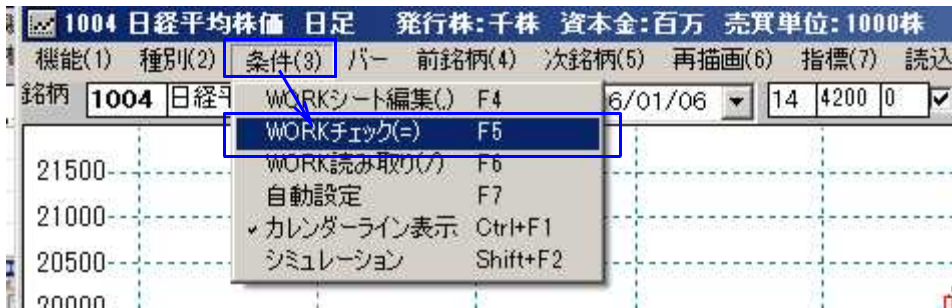
GC以上 短中に「1」 GC以下 短中に「1」

※ 161 番シートに保存しました。

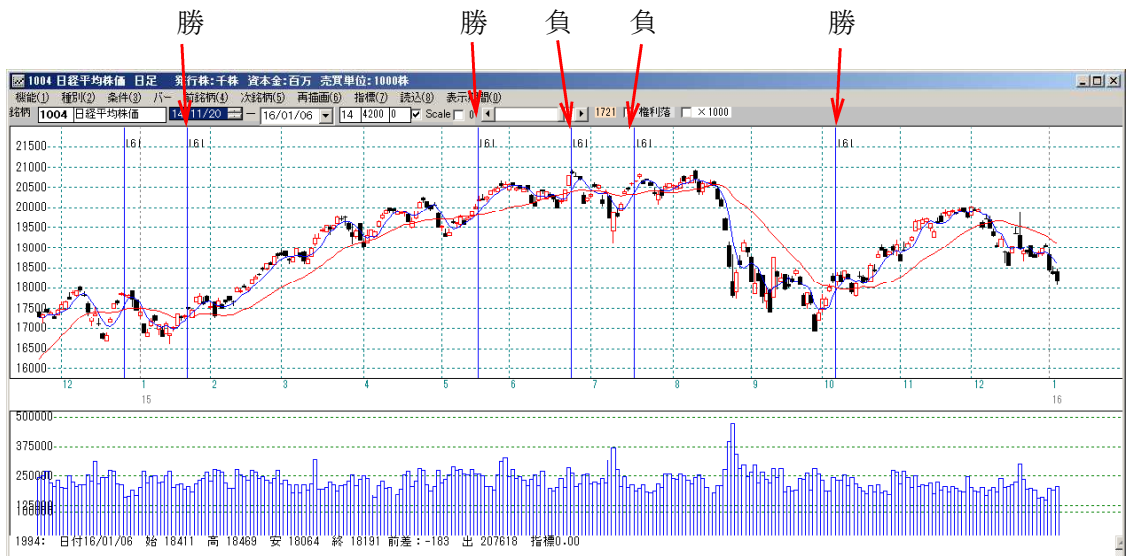
5日と25日移動平均線がゴールデンクロスした日に縦線を引く

WORK分析メニューの「チャート」から

「条件」 - 「WORKチェック」 - 「161」 - 「161」



この条件を日経平均上で調べると下記の縦線の日がそれにあたります。



2015年は、5回ありました。

ぱっと見、5回のうち、3回は勝って2回は負けといったところでしょうか・・・。

次に、日経平均がこの条件に合致した時のみ、買い出動した場合の検証をみてみましょう。

■ 検証

日経平均（1004）の条件

仕掛けてから40日先までみる

個別銘柄の条件

2015年のみ

対象はJPX400銘柄について

結果

WORK 検証結果			
検証期間	2015/01/06 ~ 2015/12/30	建玉期間	40
シート番号	161 ~ 161		
30%以上上昇の件数	6件	30%以上上昇の確率	3.77%
20%以上上昇の件数	18件	20%以上上昇の確率	11.32%
10%以上上昇の件数	52件	10%以上上昇の確率	32.70%
5%以上上昇の件数	34件	5%以上上昇の確率	21.38%
ダメ の件数	49件	ダメ の確率	30.82%
30%上昇に要した日数平均	35.50日	30%以上の平均上昇率	34.27%
20%上昇に要した日数平均	33.78日	20%以上の平均上昇率	23.92%
10%上昇に要した日数平均	29.38日	10%以上の平均上昇率	14.23%
5%上昇に要した日数平均	18.03日	5%以上の平均上昇率	7.67%
		ダメ の平均上昇率	2.44%
		全体平均上昇率	11.05%

+5%以上、儲かる確率は、全体のおよそ69%です。

いわゆる失敗、ダメの場合はおよそ31%。

上昇率の平均値は、11%です。

10銘柄仕掛けて、内7銘柄は、まあ儲かった。利益率は平均で+11%アップといったところです。

実戦では、+10%を超えたあたりで、手仕舞いでしょうか。

この検証結果からでは分からない事もあります。
ダメの場合の詳細です。仕掛けてから、いいところなく下降してしまったものは、この画面では、分かりません。

単に、ダメの場合の平均上昇率、2.44%と表示しているだけですから・・・。

1銘柄ごとの詳細を知りたい場合は、検証結果ファイルをご覧ください。

**今回だと、[C:\¥JPDATA2000]フォルダ中にある[WorkKenshoDay1-161-161.csv]、
[WorkKenshoDay2-161-161.csv]です。**

このファイルはCSV形式なので、EXCELから読み込ませる事が出来ます。

続けて、日経平均の条件は無視、つまりいつでもOK。個別銘柄がこの条件に合致したら、買い出動する場合の検証をみてみましょう。

日経平均の条件は考慮しない

WORK検証[JP2000]

実行 中止

上昇率検証
 下降率検証

日足検証
 週足検証
 月足検証

シート編集 ユーザー銘柄管理

シート一覧表 最長周期 52

大局条件の設定

設定しない
 設定する

基準となる銘柄が設定したシートに合格した日のみ検証をします。合格しない日については検証しません。例えば、日経平均がある条件に合格した日のみ検証をしたい場合などに設定します。

シート 161 番 ~ 161 番 建玉期間 40 経過を印刷

検証開始日付 検証終了日付

2014/12/22	2015/12/08
2014/12/24	2015/12/09
2014/12/25	2015/12/10
2014/12/26	2015/12/11
2014/12/29	2015/12/14
2014/12/30	2015/12/15
2015/01/05	2015/12/16
2015/01/06	2015/12/17
2015/01/07	2015/12/18
2015/01/08	2015/12/21
2015/01/09	2015/12/22
2015/01/13	2015/12/24
2015/01/14	2015/12/25
2015/01/15	2015/12/28
2015/01/16	2015/12/29
2015/01/19	2015/12/30
2015/01/20	2016/01/04
2015/01/21	2016/01/05
2015/01/22	2016/01/06

検証結果に採用する株価(権利落ち)

修正前 修正後

全銘柄
 東証
 東証1部
 東証2部
 大証
 大証1部
 大証2部
 名証
 JASDAQ
 日経平均採用
 JPX日経400採用
 信用銘柄
 貸借銘柄
 ユーザー銘柄(1~9999)

※他の設定は先と同じです。

結果

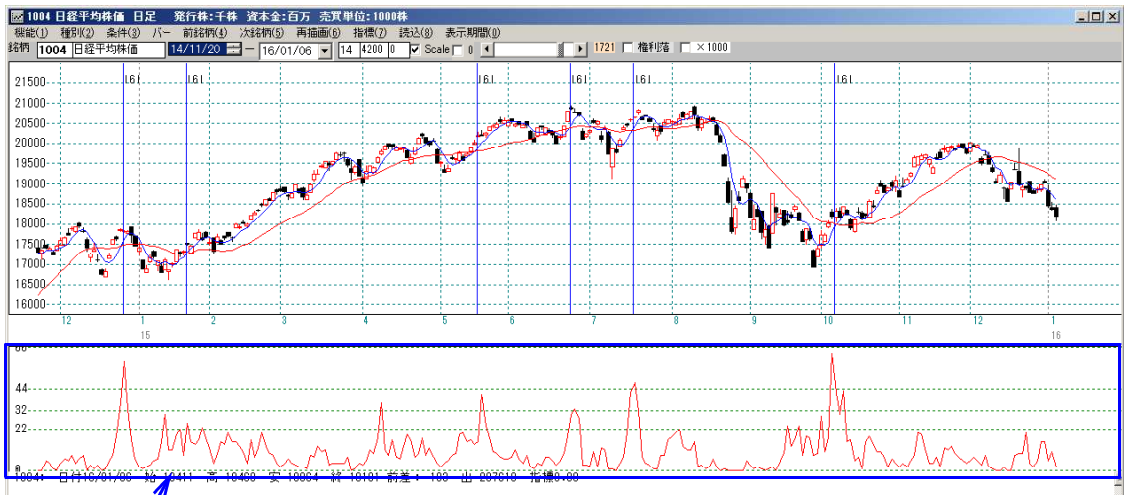
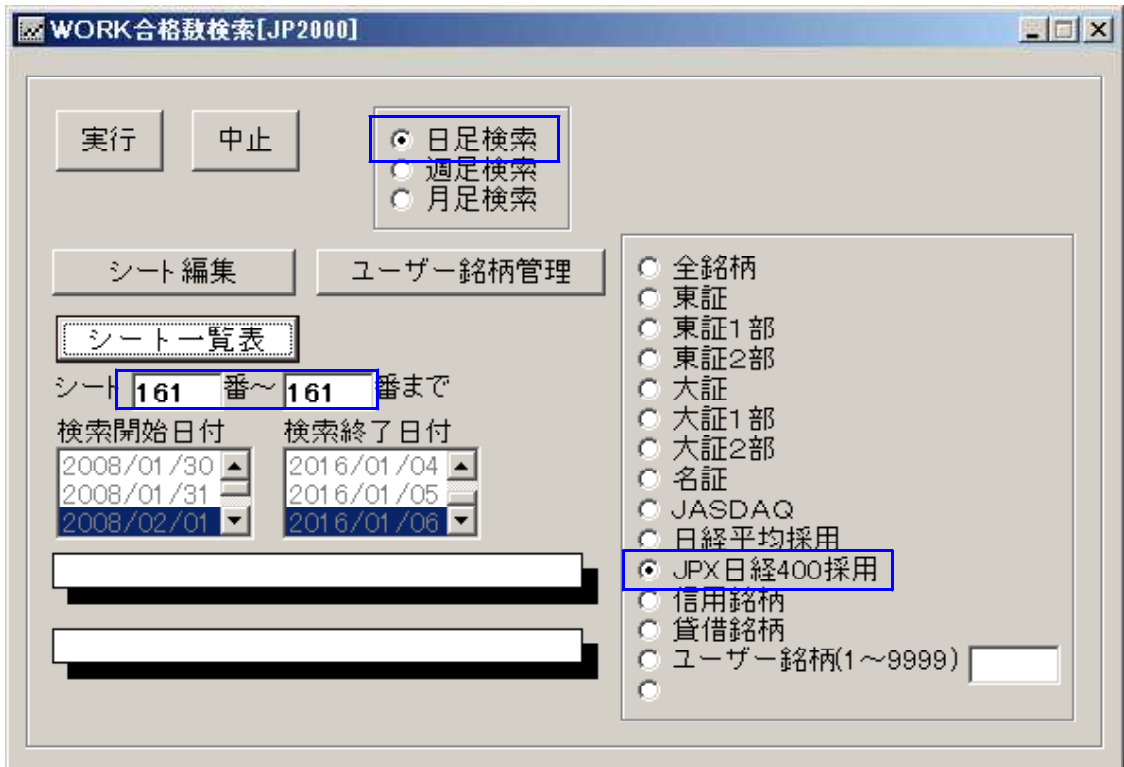
WORK検証結果			
検証期間	2015/01/06 ~ 2015/12/30	建玉期間	40
シート番号	161 ~ 161		
30%以上上昇の件数	78件	30%以上上昇の確率	3.23%
20%以上上昇の件数	326件	20%以上上昇の確率	13.49%
10%以上上昇の件数	691件	10%以上上昇の確率	28.60%
5%以上上昇の件数	572件	5%以上上昇の確率	23.68%
ダメの件数	749件	ダメの確率	31.00%
30%上昇に要した日数平均	35.21日	30%以上の平均上昇率	38.02%
20%上昇に要した日数平均	32.89日	20%以上の平均上昇率	24.07%
10%上昇に要した日数平均	28.13日	10%以上の平均上昇率	14.42%
5%上昇に要した日数平均	19.98日	5%以上の平均上昇率	7.53%
		ダメの平均上昇率	2.39%
		全体平均上昇率	11.12%

合格してくる銘柄数は、桁違いに増加しましたが、儲かる確率は大体同じような感じですね。

日経平均がゴールデンクロスしようがしまいが、関係はない。という事です。

条件に合格した銘柄数のグラフを見てみましょう。

■合格数検索



5日平均と25日平均がゴールデンクロスした銘柄数のグラフ

日経平均が、ゴールデンクロスした日を含め前後が突出している事が多いです。かといって、それが何？といったところでしょうか。天井圏でも突出しているので、合格数分析だと、ここでの仕掛けを避けるわけには行きません。

いかに天井圏に出るゴールデンクロスを避け仕掛けるかが、課題といえます。