

## 「検証機能を使いこなす」

JP法研究会 富士栄

J P 法株価分析システムの特長の1つとして、「検証」機能があげられます。

この機能は、過去の儲かった確率を調べるものです。

例えば、ネット証券のソフトでは、今日、移動平均線がG C（ゴールデンクロス）した銘柄は何か？というスクリーニングは可能ですが、過去G Cした銘柄は、その後上がったのか、下がったのか？といった事は分かりません。

テクニカル分析ですから、過去は重要です。これを否定してしまうと、テクニカル分析の土台が崩れますので、ここでは論題としません。

今日、G Cした。しかし、過去G Cしてから儲かったのか、損したのかが分からないと仕掛けにくいのではないのでしょうか。

本やネットに書いてあったから、評論家がそう言っていたから、という何となくG Cしたら上にいくだろう・・・という考えでは、儲かるわけがありません。

実際はどうなんだろう・・・？

それが分かるのが「検証」機能です。

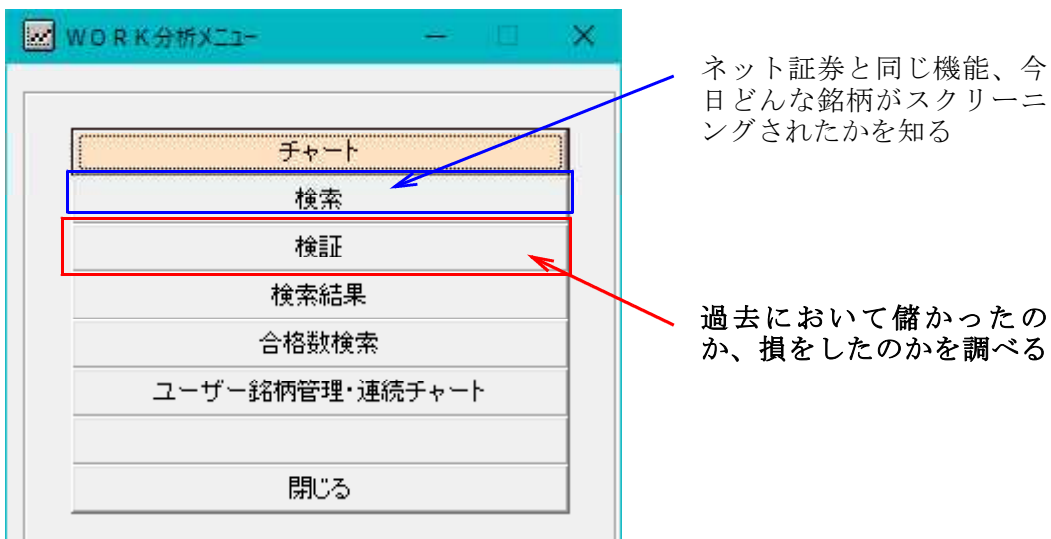
過去、儲かったのか、損をしたのかが分かっているならば、ネット証券のソフトのみを使っている投資家に比べ格段に有利なはずです。

彼らはある意味手探り状態ですが、我々は、その先の答えを知っているとも言えるからです。

このように「検証」機能はとても重要です。

そこで今回は、「検証」機能について解説したいと思います。

J P 法株価分析システムの「WORK分析メニュー」を使います。



## 例. 週足検証

13週と26週がGCした時、買いを仕掛けたらどのくらいの確率で儲かったのか？

WORKシートの条件 今回は26番シートに作成しました。

WORK分析シート 週足用 26番

コメント 13と26のGC

一覧表

取込 CSV 変更 初期化 印刷 保存 閉じる

チェック	周期			V字			以上			以下			GC以上			GC以下		
	短	中	長	短	中	長	短	中	長	短	中	長	短中	中長	短長	短中	中長	短中
弾性値																		
カイリ度																		
Sカイリ度																		
コストカイリ度																		
Sコストカイリ度																		
順位相関係数																		
相対力指数																		
サイロジカルライ																		
オシレータ																		
RCI																		
STC																		
M指標(周期固定)		4.13	9.26															
MAV指標(周期固定)		4.13	9.26															
出来高倍率																		
出来高倍率2																		
S相対力指数																		
Sオシレータ																		
RJ指数																		
VR①(*リュウツオ1)																		
VR②(*リュウツオ2)																		
移動平均①																		
移動平均②	1	13	26															
ハイローバンド																		
中値線①(高値採用)																		
中値線②(安値採用)																		
株価位置																		
中値線																		
高値安値線変動率																		
出来高移動平均																		

移動平均線②(権利落ち修正後)を使います。

チェックに「1」

周期 短に「13」 中に「26」

GC以上 短中に「1」 GC以下 短中に「1」

## ■上昇率検証 設定

13と26がGCしてからの上昇を調べます。

調べる銘柄グループは、「日経平均採用」。225銘柄としました。

GC後、いつまで調べるかは売買期間「13」。

これは、13週先まで調べる、という意味です。およそ3ヶ月間です。

■上昇率検証 結果

WORK 検証結果			
検証期間	20120318 ~ 20161204	建玉期間	13
シート番号	26 ~ 26 まで	白	印刷
30%以上上昇の件数	160 件	30%以上上昇の確率	13.45 %
20%以上上昇の件数	166 件	20%以上上昇の確率	13.95 %
10%以上上昇の件数	310 件	10%以上上昇の確率	26.05 %
5%以上上昇の件数	224 件	5%以上上昇の確率	18.82 %
ダメ の件数	330 件	ダメ の確率	27.73 %
30%上昇に要した日数平均	11.18 週	30%以上の平均上昇率	43.94 %
20%上昇に要した日数平均	9.83 週	20%以上の平均上昇率	24.39 %
10%上昇に要した日数平均	8.07 週	10%以上の平均上昇率	14.59 %
5%上昇に要した日数平均	5.94 週	5%以上の平均上昇率	7.24 %
		ダメ の平均上昇率	2.35 %
		全体平均上昇率	15.13 %

ダメの確率が、およそ28%。

これはGCした銘柄の内、72%は仕掛けてから+5%以上儲かったという事を示しています。

10銘柄仕掛けたら、7銘柄は+5%達成、3銘柄は失敗となった、という意味です。

※ここで採用している「ダメ」とは、GCしてからの上昇率が5%未満という事です。

5%上昇しなかったら、失敗とみなします。

皆様も色々シートを作成していると思いますが、7割儲かるシートは最低ラインです。

出来れば、8割以上が望ましいです。

「ふむふむ・・・7割の儲けか・・・」ここで納得したら普通の検証で終わってしまいます。

「裏の検証」、これが重要です。

## 「裏の検証」とは何か・・・？

それは、反対の事をする、という事です。 ん？反対の事って？？？

ここまでの検証は、「GCしたから上にいこう」という考えのもと上昇率を調べました。

でも実際は、「GCしてから下にいくこともある」。その確率を調べるのが「裏の検証」です。

皆様は、買い（上昇）、売り（下降）を決めてからシートを作っていると思われます。

わたしもそうです。買いのシートを作ろう、売りのシートを作ろうと決めてから取りかかっています。

でもこれは、自分の思い込みに過ぎません。

実は、買いのシートとして作ったものが、検証してみると売ったほうが儲かった、という場合もあります。

移動平均線がDC（デッドクロス）してから、買ったほうが儲かる確率が高い、RSIが30を下回ってから売ったほうが儲かりやすい。事もあるわけです。

作ったシートは買いと決めつけずに、売りかもしれないという考えは、持っておいて損はありません。

そこで「裏の検証」である「下降率」を調べてみましょう。

株は、上がるか、下がるかしかりません。※保ち合いもありますが・・・。

上がるだろうと思って作ったものは買いのシートとなり、上昇率検証が表です。

裏、つまり反対は、下がるだろう→売りのシートとなり、下降率検証です。

下がるだろうと思って作ったものは売りのシートとなり、下降率検証が表です。

裏、つまり反対は、上がるだろう→買いのシートとなり、上昇率率検証です。

GCしたら買いだと思っていた今回のシート・・・。

売って見たら（空売り）どういう結果となったのでしょうか？

## ■ 下降率検証 設定

※他の設定する項目は、上昇率検証と同じです。

## ■ 下降率検証 結果

30%以上下降の件数	38件	30%以上下降の確率	3.19%
20%以上下降の件数	127件	20%以上下降の確率	10.67%
10%以上下降の件数	337件	10%以上下降の確率	28.32%
5%以上下降の件数	304件	5%以上下降の確率	25.55%
ダメの件数	384件	ダメの確率	32.27%
30%下降に要した日数平均	9.58週	30%以上の平均下降率	36.26%
20%下降に要した日数平均	8.97週	20%以上の平均下降率	24.07%
10%下降に要した日数平均	7.40週	10%以上の平均下降率	13.93%
5%下降に要した日数平均	5.05週	5%以上の平均下降率	7.35%
		ダメの平均下降率	2.48%
		全体平均下降率	10.35%

ダメの確率は、32%ほどとなり、68%の銘柄は仕掛けてから、下へ5%以上下落し、儲かったといえます。

5%で利益を判断するなら、買いでも売りでも大きな違いはないといえます。

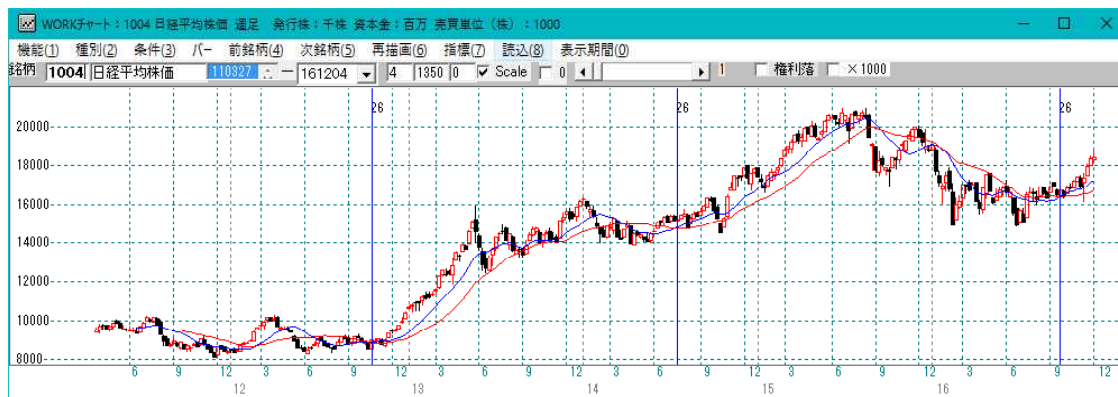
買いがやや有利という程度です。

ただ、30%以上に注目すると買ったほうが儲かります。

次に、日経平均がGCした時のみに買った場合を調べてみましょう。

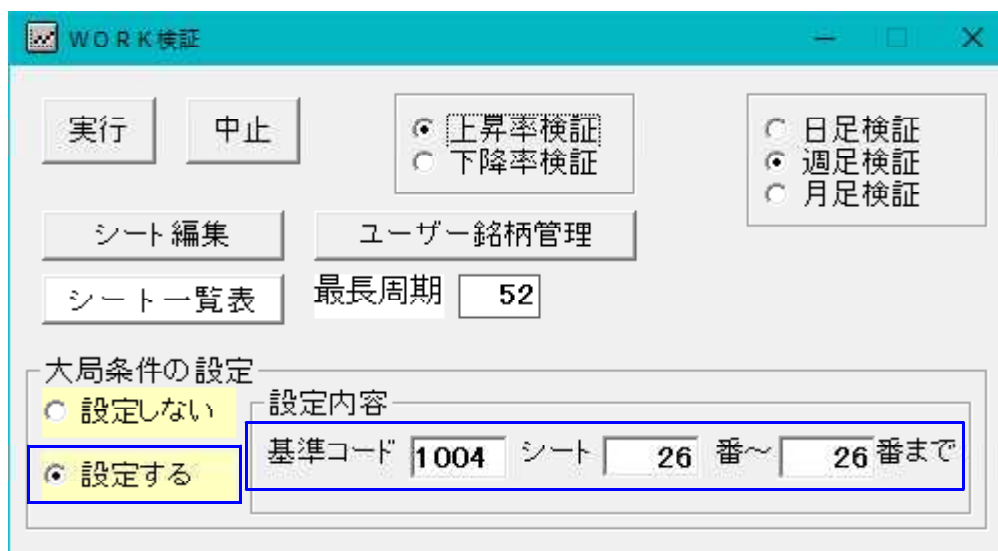
全体相場が上げ基調になったから、個別銘柄も同じように上昇するのではないか？という考えです。

日経平均がGCしたポイント



まずは、表の検証である「上昇率」を調べてみます。

#### ■上昇率検証 大局条件付き設定



「大局条件の設定」を使います。

「設定する」にして、日経平均の銘柄コード「1004」、シート番号は、個別銘柄と同じ「26」番を使います。

これで、「日経平均がGCした時」となります。

■上昇率検証 大局条件付き結果

WORK検証結果			
検証期間	20120318 ~ 20161204	建玉期間	13
シート番号	26 ~ 26 まで	白	印刷
30%以上上昇の件数	14 件	30%以上上昇の確率	31.11 %
20%以上上昇の件数	9 件	20%以上上昇の確率	20.00 %
10%以上上昇の件数	8 件	10%以上上昇の確率	17.78 %
5%以上上昇の件数	6 件	5%以上上昇の確率	13.33 %
ダメ の件数	8 件	ダメ の確率	17.78 %
30%上昇に要した日数平均	10.93 週	30%以上の平均上昇率	42.93 %
20%上昇に要した日数平均	10.11 週	20%以上の平均上昇率	24.02 %
10%上昇に要した日数平均	8.00 週	10%以上の平均上昇率	16.13 %
5%上昇に要した日数平均	6.17 週	5%以上の平均上昇率	7.43 %
		ダメ の平均上昇率	2.70 %
		全体平均上昇率	22.50 %

何とダメの確率がおよそ18%と激減しました。

日経平均がGCした時に絞って個別銘柄を買ったら、82%の確率で5%は儲かったという結果です。

そして半分の銘柄は20%以上儲かった事が分かります。(30%以上と20%以上の合計)

これはかなり高確率で儲かる条件といえます。

それでは続けて「裏の検証」もしてみましよう。

日経平均かGCした時に絞って個別銘柄を売ったらどうなったのでしょうか？



■ 下降率検証 大局条件付き設定

WORK検証

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

設定内容  
基準コード 1004 シート 26 番~ 26 番まで

■ 下降率検証 大局条件付き結果

WORK検証結果

検証期間 20120318 ~ 20161204 建玉期間 13 閉じる

シート番号 26 ~ 26 まで 白 印刷

30%以上下降の件数	0件	30%以上下降の確率	0.00%
20%以上下降の件数	2件	20%以上下降の確率	4.44%
10%以上下降の件数	15件	10%以上下降の確率	33.33%
5%以上下降の件数	10件	5%以上下降の確率	22.22%
ダメの件数	18件	ダメの確率	40.00%
30%下降に要した日数平均	週	30%以上の平均下降率	%
20%下降に要した日数平均	12.00週	20%以上の平均下降率	21.21%
10%下降に要した日数平均	7.73週	10%以上の平均下降率	11.60%
5%下降に要した日数平均	3.90週	5%以上の平均下降率	7.43%
		ダメの平均下降率	2.75%
		全体平均下降率	7.56%

ダメの確率が40%もあります。

日経平均がGCした時に絞って個別銘柄を売ったら、損をする確率が高いといえます。

森（日経平均）が動いたら、（個別銘柄）は、それに従ったほうがいいという事ですね。

## ■まとめ

シートを作って検証する場合は、上昇率検証・下降率検証、それぞれ大局条件付きを調べてみましょう。

## ■その他

検証は、主に銘柄グループに対しておこなうものです。今回のように、225採用銘柄とか、東証1部とか。1つ1つの個別銘柄にこだわるのではなく、全体を把握するために用います。

もちろん1銘柄の検証もユーザー銘柄管理シートに1銘柄だけ登録すれば出来ます。

通常、1銘柄に特化した検証であれば、チャート中の機能である「シミュレーション」を使います。

こちらの機能であれば、「買いの場合」、「売りの場合」と同時に結果が分かります。

全体の検証結果ではなく、それぞれ個別銘柄の結果を一気に見たいという場合は、そのファイルが保存されていますから、そちらをEXCELなど表計算ソフトからご覧下さい。

検証結果の詳細ファイルは、下記の通りです。

**保存されるフォルダ** 通常は[C:\¥WinJPDta]

ファイル名 WORK検証の場合

同時に2つ作成されます。

日足

WorkKenshoDay1-最初のシート番号-最後シート番号.csv

WorkKenshoDay2-最初のシート番号-最後シート番号.csv

週足

WorkKenshoWek1-最初のシート番号-最後シート番号.csv

WorkKenshoWek2-最初のシート番号-最後シート番号.csv

月足

WorkKenshoMon1-最初のシート番号-最後シート番号.csv

WorkKenshoMon2-最初のシート番号-最後シート番号.csv

今回は週足26番シートのみなのでこうなります。

WorkKenshoWek1-26-26.csv

WorkKenshoWek2-26-26.csv

## ■最後に・・・

日足日経平均のR J指数が75以上で逆V字したときの検証 225銘柄も同条件で一見すると、下がりそうに思えるが・・・。

### 下降率検証

項目	件数	確率
30%以上下降の件数	0	0.00%
20%以上下降の件数	2	0.61%
10%以上下降の件数	57	17.27%
5%以上下降の件数	102	30.91%
ダメの件数	169	51.21%
30%以上下降の平均下降率		
20%以上下降の平均下降率	23.50	20.76%
10%以上下降の平均下降率	10.82	13.50%
5%以上下降の平均下降率	8.84	7.31%
ダメの平均下降率		1.46%
全体平均下降率		5.46%

ダメが51%。

この条件は使えません。五分五分です。

## 上昇率検証 結果

WORK検証結果			
検証期間	20151202 ~ 20161202	建玉期間	40
シート番号	67 ~ 67 まで		印刷
30%以上上昇の件数	8 件	30%以上上昇の確率	2.42 %
20%以上上昇の件数	31 件	20%以上上昇の確率	9.39 %
10%以上上昇の件数	55 件	10%以上上昇の確率	16.67 %
5%以上上昇の件数	58 件	5%以上上昇の確率	17.58 %
ダメ の件数	178 件	ダメ の確率	53.94 %
30%上昇に要した日数平均	28.25 日	30%以上の平均上昇率	35.10 %
20%上昇に要した日数平均	27.61 日	20%以上の平均上昇率	23.48 %
10%上昇に要した日数平均	22.80 日	10%以上の平均上昇率	14.51 %
5%上昇に要した日数平均	18.22 日	5%以上の平均上昇率	7.25 %
		ダメ の平均上昇率	1.93 %
		全体平均上昇率	7.79 %

ダメが54%ほど。こちらも使えません。

下降も上昇もダメという事は、合格した銘柄の内、半分は保ち合いに入っていると考えられます。

また、下がると思われていましたが、下降率検証から20%以上下がった銘柄はごくわずかです。

上昇率検証から20%以上上昇した銘柄は、12%弱。

使えないシートではありますが、どちらに分があるかと言えば、買い、上昇です。