

「テクニカル分析を疑え」

株価変動を予測する方法としてファンダメンタル、テクニカル、アノマリー、外部環境などいくつかあげられます。

その中で株価分析ソフトを使う私たちは、テクニカル分析に基づいて行動している事が多いと思われます。

さて、そのテクニカル分析ですが、書籍やネットの記事から学んだ事が儲けにつながるかというところでもありません。

盲目的に、載っている事を信じて行動すると痛い目に遭います。

一般論に惑わされない事が必要となります。

鵜呑みにせず、本当にそうなのかと疑ってみましょう。

J P法ソフトには、検証という機能がありこれを使えば、各種テクニカルを丸裸にすることが出来ます。

特にJ P 2 0 0 0ソフトでは、絞り込み検索の項目について検証する事が出来ますので、一般的なノウハウが果たして役に立つのか、立たないのかを調べる事が可能です。

テクニカル指標のはじめの一步として、移動平均線やRSI、RCI、MACD、ストキャスティクスなどがあげられます。

それらの指標は、こうなったら買い、こうなったら売りと基本的にいわれていますが、本当にそうなのでしょうか？

例えば、RSI。相対力指数です。

株価は、上がったたり下がったりするものですが、指定した期間の中で、こうしたアップダウンの値動きの内、上昇幅は何%なのか？というものです。

これが、上昇幅ではなく、上昇した日数だと、サイコロジカルラインとなります。

よく使われる期間は14日です。

そして、30以下で買い、70以上で売りといわれています。

では、30以下で買った場合、どのくらい儲かる可能性があるのでしょうか？

それを調べる事が出来るのがJ P法ソフトです。

WORK分析メニューから検証を使います。

■RSI（相対力指数）を調べる

周期14日 30以下で買ったらどうなるの？

WORKシートだということ設定となります。

	フェック			V字			以上			以下			C	
	短	中	長	短	中	長	短	中	長	短	中	長		
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	1	14									30			
サイコロジカルライ														
オシレータ														
R C I														
S T C														
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														
Sオシレータ														
R J 指数														
VR①(ホリキュールソ1)														
VR②(ホリキュールソ2)														
移動平均①														
移動平均②														
ハイローバンド														

※71番シートに作りました。

アベノミクス以降、順調に上昇しているJASDAQ市場について調べてみます。

検証画面の設定

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 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。
 設定する

シート 71番 ~ 71番 売買期間 20 経過を印刷

検証開始日付	検証終了日付
20161005	20170915
20161006	20170919
20161007	20170920
20161011	20170921
20161012	20170922
20161013	20170925
20161014	20170926
20161017	20170927
20161018	20170928
20161019	20170929
20161020	20171002
20161021	20171003
20161024	20171004
20161025	20171005
20161026	20171006

- 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)

仕掛けてから、およそ一ヶ月である20日先までの値動きを調べてみました。

結果

WORK検証結果					
検証期間	20161026 ~ 20171006	建玉期間	20	閉じる	
シート番号	71 ~ 71	まで	白	印刷	
30%以上上昇の件数	818	件	30%以上上昇の確率	5.52%	
20%以上上昇の件数	1007	件	20%以上上昇の確率	6.80%	
10%以上上昇の件数	2968	件	10%以上上昇の確率	20.04%	
5%以上上昇の件数	3658	件	5%以上上昇の確率	24.70%	
ダメ	の件数	6361	ダメ	の確率	42.94%
30%上昇に要した日数平均	13.69	日	30%以上の平均上昇率	55.45%	
20%上昇に要した日数平均	13.66	日	20%以上の平均上昇率	24.27%	
10%上昇に要した日数平均	12.44	日	10%以上の平均上昇率	13.99%	
5%上昇に要した日数平均	11.86	日	5%以上の平均上昇率	7.20%	
			ダメ	の平均上昇率	2.30%
			全体平均上昇率	10.28%	

※検証プログラムは、5%未満の上昇率については、ダメと表示しています。

仕掛けたものの内、およそ43%については、ダメでした。

確率的には、良くないといっていでしょう。

この1年間右肩上がり、押し目をつくりながら上昇しているJASDAQ銘柄でも、芳しくない結果です。

では、30以下ではなく、30以下で上向いたという条件ではどうでしょうか？

周期 14日 30以下で上向いた

WORK分析シート 日足用 071番

コメント

一覧表 取込 CSV 変更 初期化 印刷 保存 閉じる

	フェック	周期			V字			以上			以下			
		短	中	長	短	中	長	短	中	長	短	中	長	
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		1	14		1						30			
サイコロジカルライ														
オシレータ														
R C I														

結果

WORK検証結果

検証期間 20161026 ~ 20171006 建玉期間 20 閉じる

シート番号 71 ~ 71 まで 白 印刷

30%以上上昇の件数	187件	30%以上上昇の確率	5.47%
20%以上上昇の件数	245件	20%以上上昇の確率	7.17%
10%以上上昇の件数	670件	10%以上上昇の確率	19.60%
5%以上上昇の件数	869件	5%以上上昇の確率	25.42%
ダメ の件数	1447件	ダメ の確率	42.33%
30%上昇に要した日数平均	13.82日	30%以上の平均上昇率	54.73%
20%上昇に要した日数平均	13.80日	20%以上の平均上昇率	24.16%
10%上昇に要した日数平均	12.48日	10%以上の平均上昇率	13.95%
5%上昇に要した日数平均	11.83日	5%以上の平均上昇率	7.23%
		ダメ の平均上昇率	2.37%
		全体平均上昇率	10.30%

合格してくる銘柄は、一気に減少しましたが、結果は同じくらいです。

条件を色々に変更してみましょう。

周期 1 4 日 20 以下

WORK検証結果				
検証期間	20161026 ~ 20171006	建玉期間	20	閉じる
シート番号	71 ~ 71 まで		白	印刷
30%以上上昇の件数	265 件	30%以上上昇の確率	5.71 %	
20%以上上昇の件数	315 件	20%以上上昇の確率	6.79 %	
10%以上上昇の件数	949 件	10%以上上昇の確率	20.46 %	
5%以上上昇の件数	1104 件	5%以上上昇の確率	23.80 %	
ダメ の件数	2006 件	ダメ の確率	43.24 %	
30%上昇に要した日数平均	13.82 日	30%以上の平均上昇率	57.53 %	
20%上昇に要した日数平均	14.46 日	20%以上の平均上昇率	24.11 %	
10%上昇に要した日数平均	12.95 日	10%以上の平均上昇率	13.95 %	
5%上昇に要した日数平均	11.82 日	5%以上の平均上昇率	7.23 %	
		ダメ の平均上昇率	2.25 %	
		全体平均上昇率	10.47 %	

周期 1 4 日 20 以下で上向いた

WORK検証結果				
検証期間	20161026 ~ 20171006	建玉期間	20	閉じる
シート番号	71 ~ 71 まで		白	印刷
30%以上上昇の件数	55 件	30%以上上昇の確率	5.64 %	
20%以上上昇の件数	81 件	20%以上上昇の確率	8.30 %	
10%以上上昇の件数	187 件	10%以上上昇の確率	19.16 %	
5%以上上昇の件数	253 件	5%以上上昇の確率	25.92 %	
ダメ の件数	400 件	ダメ の確率	40.98 %	
30%上昇に要した日数平均	13.93 日	30%以上の平均上昇率	59.29 %	
20%上昇に要した日数平均	14.02 日	20%以上の平均上昇率	23.87 %	
10%上昇に要した日数平均	12.91 日	10%以上の平均上昇率	14.02 %	
5%上昇に要した日数平均	11.94 日	5%以上の平均上昇率	7.23 %	
		ダメ の平均上昇率	2.30 %	
		全体平均上昇率	10.83 %	

周期 28日 30以下で上向いた

WORK検証結果			
検証期間	20161026 ~ 20171006	建玉期間	20 閉じる
シート番号	71 ~ 71 まで		白 印刷
30%以上上昇の件数	64件	30%以上上昇の確率	5.52%
20%以上上昇の件数	69件	20%以上上昇の確率	5.95%
10%以上上昇の件数	262件	10%以上上昇の確率	22.61%
5%以上上昇の件数	271件	5%以上上昇の確率	23.38%
ダメ の件数	493件	ダメ の確率	42.54%
30%上昇に要した日数平均	12.77日	30%以上の平均上昇率	53.24%
20%上昇に要した日数平均	13.57日	20%以上の平均上昇率	24.11%
10%上昇に要した日数平均	12.57日	10%以上の平均上昇率	13.98%
5%上昇に要した日数平均	11.80日	5%以上の平均上昇率	7.40%
		ダメ の平均上昇率	2.38%
		全体平均上昇率	10.28%

周期 28日 20以下で上向いた

WORK検証結果			
検証期間	20161026 ~ 20171006	建玉期間	20 閉じる
シート番号	71 ~ 71 まで		白 印刷
30%以上上昇の件数	3件	30%以上上昇の確率	2.01%
20%以上上昇の件数	7件	20%以上上昇の確率	4.70%
10%以上上昇の件数	36件	10%以上上昇の確率	24.16%
5%以上上昇の件数	46件	5%以上上昇の確率	30.87%
ダメ の件数	57件	ダメ の確率	38.26%
30%上昇に要した日数平均	10.67日	30%以上の平均上昇率	58.79%
20%上昇に要した日数平均	13.71日	20%以上の平均上昇率	24.59%
10%上昇に要した日数平均	14.22日	10%以上の平均上昇率	13.65%
5%上昇に要した日数平均	14.20日	5%以上の平均上昇率	7.38%
		ダメ の平均上昇率	2.52%
		全体平均上昇率	8.88%

周期 7日 30以下で上向いた

WORK検証結果				
検証期間	20161026 ~ 20171006	建玉期間	20	閉じる
シート番号	71 ~ 71	まで	白	印刷
30%以上上昇の件数	406件	30%以上上昇の確率	6.39%	
20%以上上昇の件数	427件	20%以上上昇の確率	6.72%	
10%以上上昇の件数	1243件	10%以上上昇の確率	19.55%	
5%以上上昇の件数	1527件	5%以上上昇の確率	24.02%	
ダメの件数	2754件	ダメの確率	43.32%	
30%上昇に要した日数平均	13.67日	30%以上の平均上昇率	58.37%	
20%上昇に要した日数平均	13.11日	20%以上の平均上昇率	24.33%	
10%上昇に要した日数平均	12.15日	10%以上の平均上昇率	14.03%	
5%上昇に要した日数平均	11.58日	5%以上の平均上昇率	7.24%	
		ダメの平均上昇率	2.25%	
		全体平均上昇率	10.82%	

周期 7日 20以下で上向いた

WORK検証結果				
検証期間	20161026 ~ 20171006	建玉期間	20	閉じる
シート番号	71 ~ 71	まで	白	印刷
30%以上上昇の件数	197件	30%以上上昇の確率	6.47%	
20%以上上昇の件数	223件	20%以上上昇の確率	7.32%	
10%以上上昇の件数	581件	10%以上上昇の確率	19.07%	
5%以上上昇の件数	781件	5%以上上昇の確率	25.64%	
ダメの件数	1264件	ダメの確率	41.50%	
30%上昇に要した日数平均	13.50日	30%以上の平均上昇率	59.51%	
20%上昇に要した日数平均	13.15日	20%以上の平均上昇率	24.36%	
10%上昇に要した日数平均	12.19日	10%以上の平均上昇率	14.03%	
5%上昇に要した日数平均	11.59日	5%以上の平均上昇率	7.29%	
		ダメの平均上昇率	2.28%	
		全体平均上昇率	11.12%	

「周期 28日 20以下で上向いた」という条件のダメが、およそ38%なので、わずかに改善したといったところですが、褒めたものではありません。

●結論 RSIでXX以下から上向いて買いという条件だけでは使えません。

使えない・・・という事を知っただけでも役立つはずですが。こういう検証結果を知らない投資家達は、RSIが30以下だから買おうか。となっている向きも多いはずですから。

検証プログラムはこのように使います。お試しください。
絞り込み検索について、検証したい向きはJP2000ソフトをご利用下さい。

■弾性値 周期13日 -10以下で上向いた

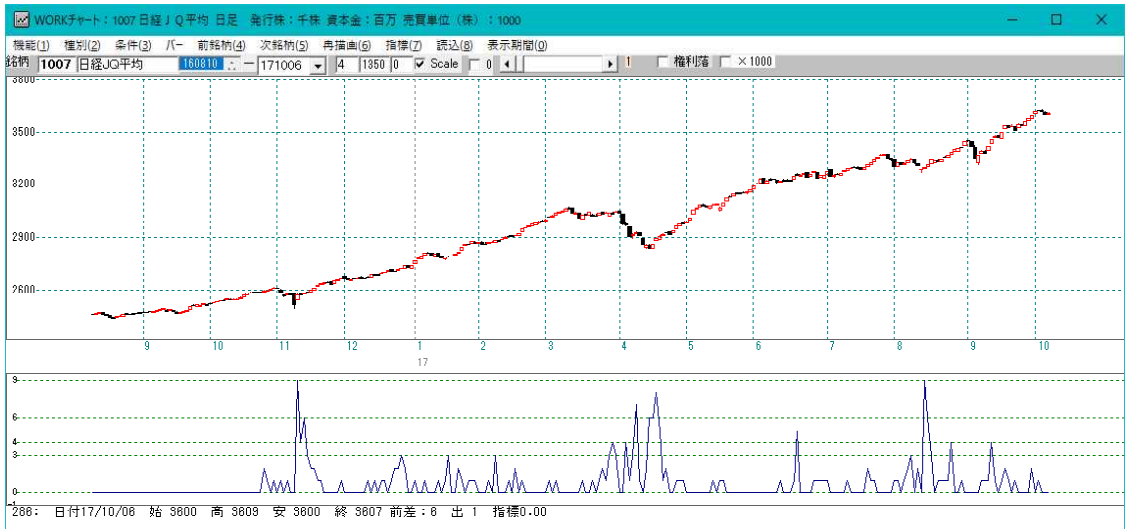
	フェック			周期			V字			以上			以下		
	短	中	長	短	中	長	短	中	長	短	中	長	短	中	長
弾性値	1	13		1									-10		
カイリ度															
Sカイリ度															
コストカイリ度															
Sコストカイリ度															
順位相関係数															
相対力指数															
サイコロジカルライ															
オシレータ															
RCI															
STC															

※72番シートを使いました。

結果

検証期間	20161026	20171006	建玉期間	20	閉じる
シート番号	72	72	白		印刷
30%以上上昇の件数	35件	30%以上上昇の確率	17.86%		
20%以上上昇の件数	23件	20%以上上昇の確率	11.73%		
10%以上上昇の件数	58件	10%以上上昇の確率	29.59%		
5%以上上昇の件数	41件	5%以上上昇の確率	20.92%		
ダメの件数	39件	ダメの確率	19.90%		
30%上昇に要した日数平均	13.00日	30%以上の平均上昇率	57.20%		
20%上昇に要した日数平均	13.04日	20%以上の平均上昇率	24.10%		
10%上昇に要した日数平均	9.83日	10%以上の平均上昇率	14.13%		
5%上昇に要した日数平均	7.32日	5%以上の平均上昇率	7.65%		
		ダメの平均上昇率	2.72%		
		全体平均上昇率	19.37%		

合格数グラフ



合格数が5銘柄以上の時のみに仕掛けたらどうなるか？

J P 2 0 0 0ソフトを使用

■ J P 分析検証

実行 中止

ユーザー銘柄管理

シート編集 シート一覧表

シート 721 番 ~ 721 番 建玉期間 20 経過を印刷

検証開始日付	検証終了日付
2016/10/13	2017/09/14
2016/10/14	2017/09/15
2016/10/17	2017/09/19
2016/10/18	2017/09/20
2016/10/19	2017/09/21
2016/10/20	2017/09/22
2016/10/21	2017/09/25
2016/10/24	2017/09/26
2016/10/25	2017/09/27
2016/10/26	2017/09/28
2016/10/27	2017/09/29
2016/10/28	2017/10/02
2016/10/31	2017/10/03
2016/11/01	2017/10/04
2016/11/02	2017/10/05
2016/11/04	2017/10/06

検証方法はこちら？

OR検証 AND検証

検証結果に採用する株価(権利落ち)

修正前 修正後

大局条件の設定

設定しない 設定する

「合格数検索」結果の設定

設定しない 設定する

合格数が保存されているシートの設定

JPシート合格数

WORKシート合格数

シート番号 72

条件

移動平均期間 1

合格数で判断 5 以上

前日合格数>本日合格数

移動平均期間 1

倍率で判断

検証を実行する前に、下記のことをしておく。

- ・ J P シート日足 7 2 1 番に短弾 - 1 0 以下でV字という条件をセット。
- ・ WORK分析の合格数検索で、あらかじめ72番を実行

結果

J P分析検証結果

検証期間 2016/10/26 ~ 2017/10/06 建玉期間 20 閉じる

シート番号 721 ~ 721 まで 白 印刷

30%以上上昇の件数	14 件	30%以上上昇の確率	22.58 %
20%以上上昇の件数	9 件	20%以上上昇の確率	14.52 %
10%以上上昇の件数	26 件	10%以上上昇の確率	41.94 %
5%以上上昇の件数	10 件	5%以上上昇の確率	16.13 %
ダメ の件数	3 件	ダメ の確率	4.84 %
30%上昇に要した日数平均	12.36 日	30%以上の平均上昇率	57.74 %
20%上昇に要した日数平均	14.00 日	20%以上の平均上昇率	23.67 %
10%上昇に要した日数平均	10.38 日	10%以上の平均上昇率	14.10 %
5%上昇に要した日数平均	9.40 日	5%以上の平均上昇率	8.15 %
		ダメ の平均上昇率	4.03 %
		全体平均上昇率	23.90 %

仕掛けてからおおよそ95%の銘柄は、+5%以上上昇した事が分かります。

仕掛けるタイミング、数は少ないですが、実際はこれくらいに絞ったほうがいいでしょう。