

「WORK分析を使おう 検証編」

WORK分析の検証について解説します。

検証機能とは、過去にさかのぼって合格銘柄を調べ、それらがどのくらい儲かっているのか（買いなら上昇しているか、空売りなら下降しているか）を表示させるものです。

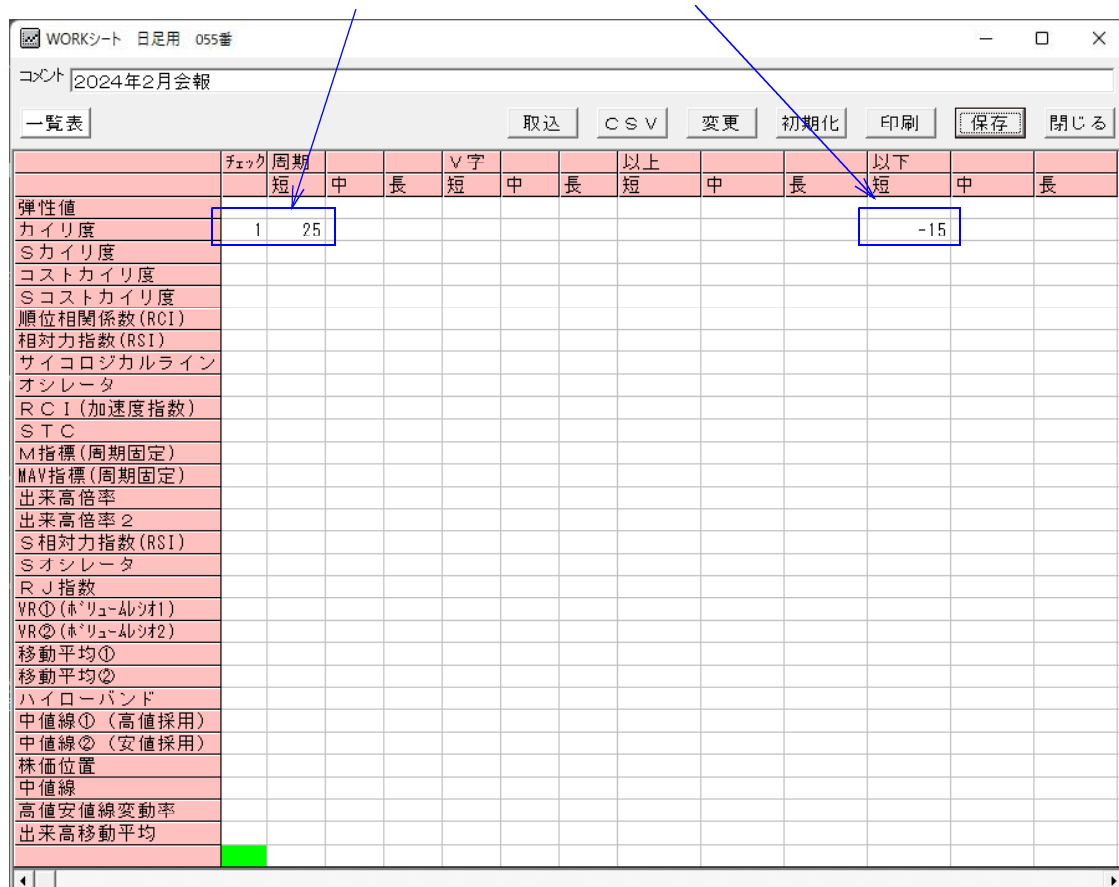
WORKシートを作りました。では、このシートは過去においてどのくらい儲かったのでしょうか？それを調べることが出来ます。

例． 25日移動平均線からの下方乖離が15%以上ある。この条件の検証をしてみましょう。

■WORKシートの内容

ここでは日足の55番シートを使います。

カイリ度を使います。周期は「25」、以下の項目に「-15」



チェック	周期	中	長	V字	短	中	長	短	中	長	短	中	長
弾性値													
カイリ度	1	25										-15	
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(RCI)													
相対力指数(RSI)													
サイコロジカルライン													
オシレータ													
RCI(加速度指数)													
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(RSI)													
Sオシレータ													
RJ指数													
VR①(ボリューム①)													
VR②(ボリューム②)													
移動平均①													
移動平均②													
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													

■検証画面

下記のように設定して「実行」をクリックします。

最長周期とは、WORKシートで使用した一番長い周期の事です。

初期値は「52」ですが、これより長い周期を使う場合は変更してください。
例えば、「75」など。

今回のように「52」より短い周期の場合は、このまま「52」で構いません。
一番古いデータから「52」日間は計算エリアとして使う事が多いのでそうしています。

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 55 番～ 55 番 売買期間 40 経過を印刷

検証開始日付 検証終了日付

20230127 20240115

20230130 20240116

20230131 20240117

20230201 20240118

20230202 20240119

20230203 20240122

20230206 20240123

20230207 20240124

20230208 20240125

20230209 20240126

20230210 20240129

20230213 20240130

20230214 20240131

20230215 20240201

20230216 20240202

全銘柄 東証 東証プライム 東証スタンダード 東証グロース 東証その他

名証

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)

売買期間とは、合格してから将来に渡ってどのくらい先まで調べるか。という意味です。

ここでは「40」なので、40日先までの株価の推移を調べます。

※厳密に検証をするのであれば、検証終了日付を40日前へとさかのぼらせます。

今回、合格してから「40」日先まで見ていますから、直近から40日以内に合格したものは、まだ「40」日経過していませんので、正確ではありません。

昨日、合格した銘柄はまだ結果が分かりませんよね。ある程度日にちが経過していないと正確ではない。という事です。

40日前は、2023年12月4日です。

こうすれば、厳密な検証となりますが、例えば、20日前に合格して、大きく上昇している。

この銘柄は、この検証では、含まれない事になります。

一長一短です。

今までの経緯、吉村先生の検証の使い方ではここまで厳密にはしていませんでした。わたしも、検証終了日付は通常、直近にしています。

こだわりがあるかたは、この厳密な設定を用いてください。

今回は、「日経平均採用銘柄」で検証しています。

「実行」をクリックすると銘柄が回り出し、止まります。
止まったら検証終了です。このようになりました。

■検証結果

30%以上の上昇の項目の意味は、合格した翌日の寄り付きと、以降40日間の最高値を比較して、30%以上合格している場合です。

この中には、30%以上ですから、50%以上、100%以上も含まれます。

「3.08」と表示されていますが、これは全ての合格ポイントの内の%です。

件数を見てください。「2」件となっています。

全ての合格件数は、「65」です。

$$2 + 15 + 30 + 12 + 6 = 65$$

$$20 \div 65 \times 100 = 3.076 \div 3.08$$

という具合です。

20%以上の上昇は、30%未満、20%以上の意味です。

ダメの場合は、5%未満の上昇です。3%も含まれますし、マイナスも含まれます。
-10%や、-50%。

合格してから、真逆さまに下落していき、戻ってこなかった場合がマイナス値となります。

右上の「結果」をクリックするとこうなります。

先の画面に追加して、平均値が下に表示されます。

検証期間		20230216 ~ 20240202		建玉期間		40		閉じる	
シート番号		55 ~ 55		白		印刷			
30%以上上昇の件数	2	件	30%以上上昇の確率	3.08	%				
20%以上上昇の件数	15	件	20%以上上昇の確率	23.08	%				
10%以上上昇の件数	30	件	10%以上上昇の確率	46.15	%				
5%以上上昇の件数	12	件	5%以上上昇の確率	18.46	%				
ダメ	の件数	6	件	ダメ	の確率	9.23	%		
30%上昇に要した日数平均	26.50	日	30%以上の平均上昇率	32.54	%				
20%上昇に要した日数平均	30.87	日	20%以上の平均上昇率	23.88	%				
10%上昇に要した日数平均	24.37	日	10%以上の平均上昇率	14.46	%				
5%上昇に要した日数平均	23.17	日	5%以上の平均上昇率	7.34	%				
				ダメ	の平均上昇率	3.16	%		
				全体平均上昇率	14.83	%			

20%以上の平均上昇率に注目してみます。

「23.88」%となっています。

30%未満、20%以上の上昇率に入った銘柄の平均上昇率が「23.88」という意味です。

件数は、「15」件。この15件の平均上昇率の事です。

20%上昇に要した平均日数は「30.87」日。

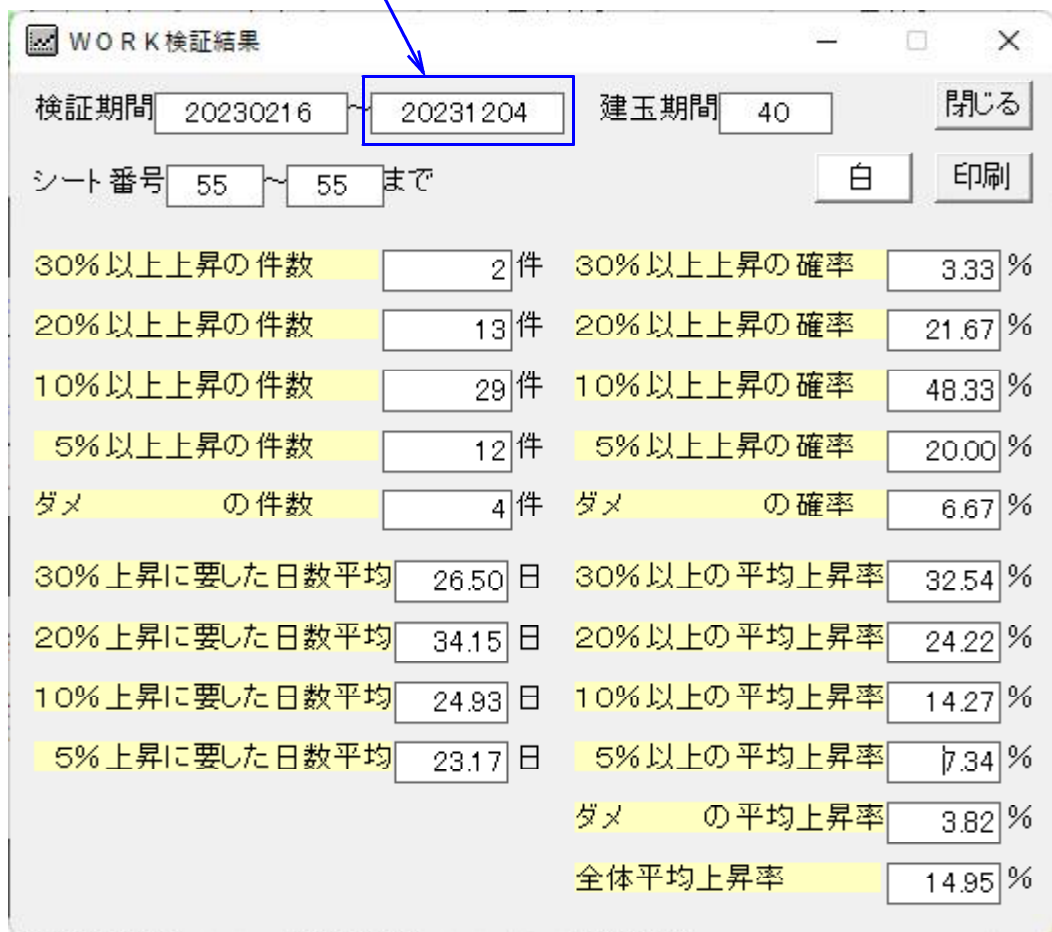
合格してから将来へ「40」日先までみています。

当然、40日より少ない日数です。合格した「15」件が20%以上に到達した平均日数の事となります。

検証を厳密にした場合はこうなります。

検証終了日付が2023年12月4日

検証結果



WORK 検証結果

検証期間 20230216 ~ 20231204 建玉期間 40 閉じる

シート番号 55 ~ 55 まで 白 印刷

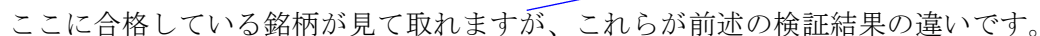
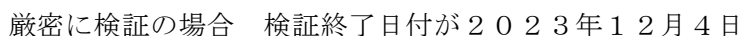
30%以上上昇の件数	2 件	30%以上上昇の確率	3.33 %
20%以上上昇の件数	13 件	20%以上上昇の確率	21.67 %
10%以上上昇の件数	29 件	10%以上上昇の確率	48.33 %
5%以上上昇の件数	12 件	5%以上上昇の確率	20.00 %
ダメ の件数	4 件	ダメ の確率	6.67 %
30%上昇に要した日数平均	26.50 日	30%以上の平均上昇率	32.54 %
20%上昇に要した日数平均	34.15 日	20%以上の平均上昇率	24.22 %
10%上昇に要した日数平均	24.93 日	10%以上の平均上昇率	14.27 %
5%上昇に要した日数平均	23.17 日	5%以上の平均上昇率	7.34 %
		ダメ の平均上昇率	3.82 %
		全体平均上昇率	14.95 %

先の結果と少し違います。

この違いは、40日前+1日から直近までに合格した銘柄がある。という事を意味します。

それらの違いをチャートを表示させ比較してみます。

この範囲に合格した銘柄について検証しています。



もし40日前+1日から直近まで合格した銘柄がないと、検証結果は同じとなります。

これらの検証結果の詳細を見たい場合は、前号（１月号）で紹介した検証結果のCSVファイルをご覧ください。
かなり詳細な事まで分かります。

データフォルダ中にあります。[C:¥WinJPDta]の中

ファイル名 **[WorkKenshoDay1-55-55.csv]**と**[WorkKenshoDay2-55-55.csv]**です。