

テンプレートを使ったロジック作成の手順

1 解説資料(または動画講座)を確認する

まずは、解説資料(または動画)でシステムトレードとはどんなものか。基礎的なことから、実際のロジック作成の手順までを一通り学んでください。

お時間がない方は、下記2からお試しいてもよろしいかと思えます。

2 テンプレートを使ってロジックを作成してみる

このテンプレートに表示されている数字は、解説資料(または動画)の中でも使われている、講座用 KENSHIRO-225 ソフト※1 で検証された数字です。

ご自身の正規版 KENSHIRO-225 ソフトの検証画面で、テンプレートの手順に沿って、数値を入力し、この値を基準にして、前後の数字で検証を試してみてください。

この手順を条件文(フィルタ)ごとに一つずつ行っていけば、簡単にできあがります。

3 正規版の KENSHIRO-225 で作った参考結果と比べてみる

ご参考までに正規版で作成してみたサンプルの結果と、ご自身で作成して頂いた損益結果を見比べてみてください。

4 解説資料(または動画講座)を活用する

この売買ロジックが、どのような優位性をもとに成り立っているのか？
活躍するのは、そして苦手としているのはどのような相場なのか？

これらを十分理解した上で運用することは、

「毎日の売買を、迷わず自信をもって行う」ために重要です。

安定した運用を継続する為に、本ロジックの該当する「ロジック作成解説資料(または動画講座)」で復習をしましょう。

※1

投資助言業に抵触しないよう、

解説資料(または動画講座)では、講座用「KENSHIRO-225」を利用してロジック作成の手順を解説しています。

講座用の「KENSHIRO-225」では、日経 225 先物のデータについて

・2020年4月までのデータを利用

・傾向が変わらない程度にデータを修正

としたものを使用しています。

下落傾向狙い日中売り

～下がりやすいタイミングと、前日の値動きの2つを見極めながら売る検証例～

【仮説】

- ・株は、季節性・時季によって上がりやすい、下がりやすいタイミングがあるのではないかと
- ・大きく下がった翌日は、相場は買戻しされやすい（続落しづらい）のではないかと

【検証の手順】

① エントリー/エグジットの時間枠を設定します。

- 翌日の日中の始値で売りエントリー
- 翌日の日中の終値で買い決済

② 季節性・時季による偏りがあるかどうかを探しましょう！

週や曜日によって、買われやすい・売られやすい
偏りがあるかを探ってみましょう

- 年末年始、お盆、GW、月頭、月末、
特定の日、SQ前後 etc

③ 直近の値動きによる

優位性があるかどうかを検証してみましょう。

- ローソク足の条件を使って、前日に大きく下がった場合を検証してみましょう。
- ローソク足の条件を使って、前々日に大きく上がらなかった場合を検証してみましょう。
- 乖離の条件を使って、前々日から前日の値動きによる優位性を検証してみましょう

【設定例】

注文条件

【エントリー】
サイン表示の 翌日 の 日中 の 始値 で 売り

【エグジット】
サイン表示の 翌日 の 日中 の 終値 で 買い

エントリー期日設定

✓ エントリー期日設定

✓ 毎週 第1週 第2週 第3週 第4週 第5週
○ 日数基準 (1~7日:第1週) カレンダー基準

✓ 毎曜日 週頭 月 火 水 木 金 週末

✓ 毎月 1月 2月 3月 4月 5月 6月
 7月 8月 9月 10月 11月 12月

✓ 月頭 を省く 月末 を省く

8/15の前後 1 日営業日 を省く

12/31~1/3前後 0 日営業日 を省く

✓ 毎年 1月 13日 ~ 1月 14日 を省く

✓ 毎年	毎	月	第1	週	金	曜日	を省く
✓ 毎年	毎	月	第3	週	水	曜日	を省く
✓ 毎年	3	月	第4	週	毎	曜日	を省く
✓ 毎年	4	月	第4	週	毎	曜日	を省く
✓ 毎年	9	月	第2	週	毎	曜日	を省く
✓ 毎年	9	月	第4	週	毎	曜日	を省く
✓ 毎年	10	月	第2	週	毎	曜日	を省く
✓ 毎年	10	月	第5	週	毎	曜日	を省く

i.) ii.)

ローソク足

✓ 本日から過去 0 日前の 日経 の 『終値-始値』 が - である
150 円 超 である
※本日から過去「0」日前 = 本日が指定できます。

✓ 本日から過去 1 日前の ナイト の 『終値-始値』 が + である
200 円 以下 である
※本日から過去「0」日前 = 本日が指定できます。

iii.)

乖離

✓ 前日 の ナイト の 安値 が、前々日 の ナイト の 安値 から + 2.5% 以下 乖離している

④ 経済イベントによる優位性を検証しましょう！

- i. 特定の経済イベントの日の前後で、優位性があるかどうかを検証してみましょう。

(!) この検証には、有料オプション機能「イベントフィルタ」の購入が必要です。

オプション機能「イベントフィルタ」についてはこちら。

<https://kenshiro-jp.com/225op-extend02>

(!) このフィルタは「テンプレート読込」機能では読み込まれません。

有料オプション機能「イベントフィルタ」をお持ちの場合で

「テンプレート読込」機能ご利用時は、ご自身でフィルタを適用してください。

⑤ ロスカットの検証方法を学びましょう！

- i. ロスカットをうまく設定しておくことで1トレードのリスクを減らすことができます。ケンシロウではロスカット幅を設定することができますので、検証してみましょう

⑥ 最終確認をしましょう！

- i. グラフは右肩上がりになっているか？
- ii. 最大DDは、大きすぎないか？
- iii. 取引回数は少なすぎないか？ etc

ユーザーイベント

- 1:消費者物価指数(CPI) の 翌日 と、その前
0 日間、その後 0 日間 を省く
- 9:米国債償還 の 前日 と、その前
0 日間、その後 0 日間 を省く

特殊注文条件

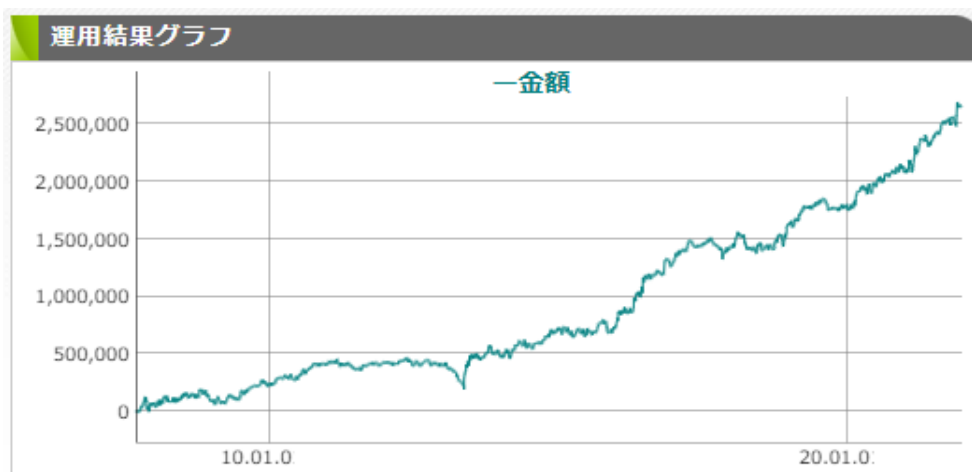
- ロスカット: エントリー価格から 350 円上がったら

講座版の KENSHIRO-225 で作ったサンプル結果

こちらのサンプルを目標にして、ご自身のロジックを完成させてみましょう！

検証に利用したデータ期間：～2021/12/30

1) 手順④ イベントフィルタ（有料）機能なしの場合

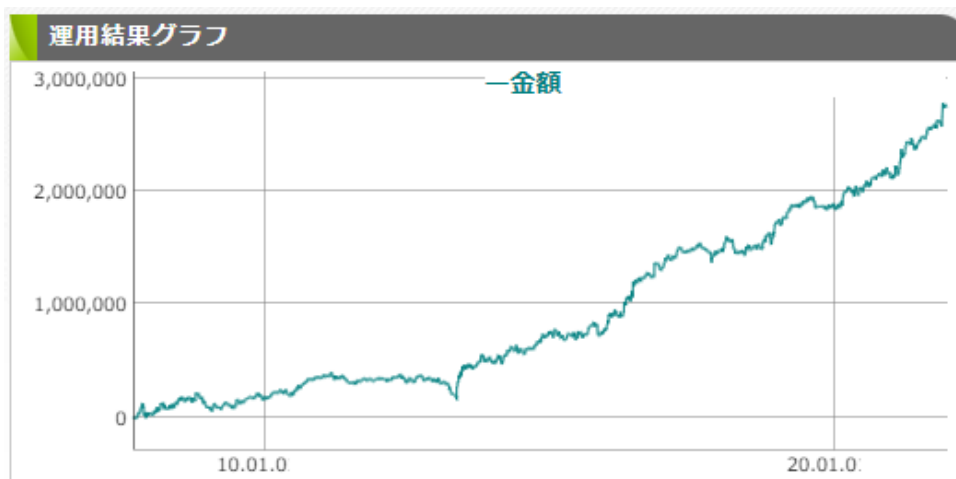


期間	運用実績	利回り	最大DD	トレード数	勝率
2007/09/18～2007/12/31	62,500	16.9%	-126,500	35	57.1%
2008/01/01～2008/12/31	27,000	7.3%	-98,000	129	52.8%
2009/01/01～2009/12/31	145,000	39.3%	-126,000	151	52.0%
2010/01/01～2010/12/31	176,000	47.7%	-51,500	171	55.2%
2011/01/01～2011/12/31	15,000	4.1%	-97,000	179	52.3%
2012/01/01～2012/12/31	-24,000	-6.5%	-81,000	183	50.0%
2013/01/01～2013/12/31	89,500	24.3%	-279,000	142	42.8%
2014/01/01～2014/12/31	219,000	59.3%	-106,000	149	56.1%
2015/01/01～2015/12/31	17,500	4.7%	-125,500	150	45.9%
2016/01/01～2016/12/31	567,000	153.7%	-67,500	135	53.4%
2017/01/01～2017/12/31	140,000	37.9%	-182,500	176	54.9%
2018/01/01～2018/12/31	195,000	52.8%	-184,500	142	51.8%
2019/01/01～2019/12/31	171,500	46.5%	-107,500	156	54.2%
2020/01/01～2020/12/31	285,500	77.4%	-101,500	134	53.8%
2021/01/01～2021/12/30	569,900	154.4%	-101,000	125	52.0%

総合運用実績	
最低運用資金	369,000
損益累計	2,656,400
利回り	719.9%
勝率	52.1%
最大ドローダウン(DD) 通知メール設定	-279,000

これは、講座用のKENSHIRO-225ソフトを使って作成したサンプルの成績です。
 講座用のソフトでは、4本値のデータは実際のデータとは異なる類似データを利用しています。
 ご自身で運用するための売買ロジックを作られる際には、正規版のKENSHIRO-225ソフトを使い、手順や作成方法を学びながら、必ずご自身で再検証を行い判断をして、ご自身に合った売買ロジックを構築されることをお願いいたします。

2) 手順④ イベントフィルタ (有料) 機能を利用した場合



期間別運用実績

期間	運用実績	利回り	最大DD	トレード数	勝率
2007/09/18~2007/12/31	40,500	12.2%	-126,500	34	55.9%
2008/01/01~2008/12/31	50,500	15.2%	-124,000	122	53.4%
2009/01/01~2009/12/31	83,000	25.0%	-157,000	137	50.7%
2010/01/01~2010/12/31	179,500	54.0%	-57,000	160	55.8%
2011/01/01~2011/12/31	-8,500	-2.6%	-106,500	167	51.9%
2012/01/01~2012/12/31	-18,500	-5.6%	-95,000	173	49.4%
2013/01/01~2013/12/31	171,500	51.6%	-242,500	137	44.4%
2014/01/01~2014/12/31	248,000	74.6%	-80,500	140	58.3%
2015/01/01~2015/12/31	28,500	8.6%	-125,500	143	46.8%
2016/01/01~2016/12/31	553,500	166.5%	-73,000	130	53.1%
2017/01/01~2017/12/31	150,000	45.1%	-165,500	165	56.2%
2018/01/01~2018/12/31	245,000	73.7%	-164,000	137	52.2%
2019/01/01~2019/12/31	164,000	49.3%	-118,000	150	54.4%
2020/01/01~2020/12/31	233,500	70.2%	-113,500	126	53.2%
2021/01/01~2021/12/30	626,950	188.6%	-100,900	118	52.6%

総合運用実績

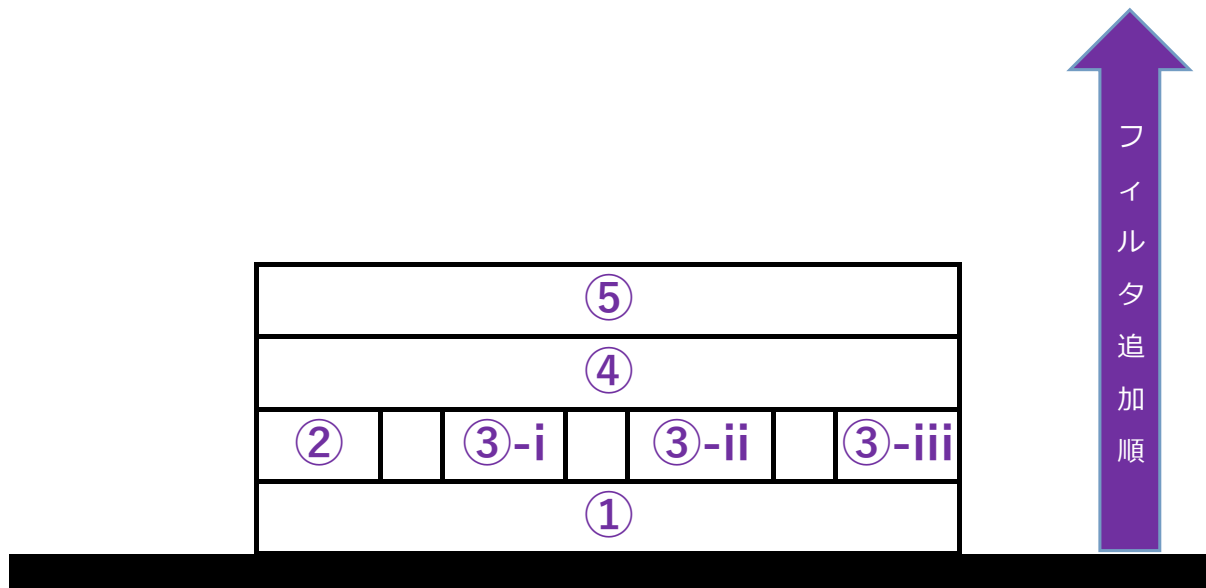
最低運用資金	332,500
損益累計	2,747,450
利回り	826.3%
勝率	52.4%
最大ドロウダウン(DD) 通知メール設定	-242,500

これは、講座用のKENSHIRO-225ソフトを使って作成したサンプルの成績です。
 講座用のソフトでは、4本値のデータは実際のデータとは異なる類似データを利用しています。
 ご自身で運用するための売買ロジックを作られる際には、正規版のKENSHIRO-225ソフトを使い、手順や作成方法を学びながら、必ずご自身で再検証を行い判断をして、ご自身に合った売買ロジックを構築されることをお願いいたします。

ロジック構築図

この売買ロジックのフィルタ構築図は以下の通りです。

※○番号は、手順内の番号に対応しています。



※フィルタ見直しをする際の注意点

見直し対象のフィルタを検証したタイミングで、まだ加えていなかったフィルタが入った状態で再検証をすると、カーブフィッティングの原因になります。

フィルタの見直し方については、以下の無料動画

「KENSHIRO-225トレード」

「フィルタの見直し方」

をご視聴になり、ご参考ください。