

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

・2022年12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。

上昇傾向狙い日中買い

～株価が上がりやすいタイミングを見極めて、買いを狙う検証例～

【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
- ・大きく売られる動きが出た後は、相場は偏りのある値動きをするのではないかと

【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買いエントリー
- 翌日の日中の終値で売り決済

② 検証する期間を設定しましょう。

- 2013/1/1～

③ 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、月によって、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

- 第1週～第5週、それぞれを検証。
- 月～金、それぞれを検証。
- 年末年始、お盆、GW、月頭、月末など、特殊な時期を検証してみましょう

メインフィルタ

【設定例】

注文条件	
【エントリー】	サイン表示の <input type="text" value="翌日"/> の <input type="text" value="日中"/> の <input type="text" value="始値"/> で <input type="text" value="買い"/>
【エグジット】	サイン表示の <input type="text" value="翌日"/> の <input type="text" value="日中"/> の <input type="text" value="終値"/> で <input type="text" value="売り"/>

検証期間指定	
<input checked="" type="checkbox"/>	2013/01/01 <input type="text" value=""/> ~ <input type="text" value=""/>

エントリー期日設定	
<input checked="" type="checkbox"/> エントリー期日設定	
<input checked="" type="checkbox"/> 毎週 <input type="checkbox"/> 第1週 <input type="checkbox"/> 第2週 <input type="checkbox"/> 第3週 <input type="checkbox"/> 第4週 <input type="checkbox"/> 第5週	
<input type="radio"/> 日数基準 (1~7日:第1週) <input checked="" type="radio"/> カレンダー基準	
<input type="checkbox"/> 毎曜日 <input type="checkbox"/> 週頭 <input checked="" type="checkbox"/> 月 <input checked="" type="checkbox"/> 火 <input checked="" type="checkbox"/> 水 <input type="checkbox"/> 木 <input checked="" type="checkbox"/> 金 <input type="checkbox"/> 週末	
<input checked="" type="checkbox"/> 毎月 <input type="checkbox"/> 1月 <input type="checkbox"/> 2月 <input type="checkbox"/> 3月 <input type="checkbox"/> 4月 <input type="checkbox"/> 5月 <input type="checkbox"/> 6月	
<input type="checkbox"/> 7月 <input type="checkbox"/> 8月 <input type="checkbox"/> 9月 <input type="checkbox"/> 10月 <input type="checkbox"/> 11月 <input type="checkbox"/> 12月	
<input type="checkbox"/> 月頭 <input type="text" value="を省く"/> <input checked="" type="checkbox"/> 月末 <input type="text" value="を省く"/>	
<input checked="" type="checkbox"/> 3/15の前後 <input type="text" value="5"/> 日営業日 <input type="text" value="を省く"/>	
<input type="checkbox"/> 12/31~1/3前後 <input type="text" value="0"/> 日営業日 <input type="text" value="を省く"/>	
<input checked="" type="checkbox"/> 毎年 <input type="text" value="5"/> 月 <input type="text" value="23"/> 日 ~ <input type="text" value="5"/> 月 <input type="text" value="25"/> 日 <input type="text" value="を省く"/>	
<input checked="" type="checkbox"/> 毎年 <input type="text" value="3"/> 月 <input type="text" value="19"/> 日 ~ <input type="text" value=""/> 月 <input type="text" value=""/> 日 <input type="text" value="を省く"/>	

<input checked="" type="checkbox"/>	毎年	<input type="text" value="3"/>	月	<input type="text" value="第3"/>	週	<input type="text" value="毎"/>	曜日	<input type="text" value="を省く"/>
<input checked="" type="checkbox"/>	毎年	<input type="text" value="7"/>	月	<input type="text" value="第5"/>	週	<input type="text" value="毎"/>	曜日	<input type="text" value="を省く"/>
<input checked="" type="checkbox"/>	毎年	<input type="text" value="毎"/>	月	<input type="text" value="第2"/>	週	<input type="text" value="月"/>	曜日	<input type="text" value="を省く"/>
<input checked="" type="checkbox"/>	毎年	<input type="text" value="毎"/>	月	<input type="text" value="第2"/>	週	<input type="text" value="火"/>	曜日	<input type="text" value="を省く"/>
<input checked="" type="checkbox"/>	毎年	<input type="text" value="毎"/>	月	<input type="text" value="第2"/>	週	<input type="text" value="水"/>	曜日	<input type="text" value="を省く"/>
<input type="checkbox"/>	毎年	<input type="text" value="毎"/>	月	<input type="text" value="毎"/>	週	<input type="text" value="毎"/>	曜日	<input type="text" value="を省く"/>
<input type="checkbox"/>	毎年	<input type="text" value="毎"/>	月	<input type="text" value="毎"/>	週	<input type="text" value="毎"/>	曜日	<input type="text" value="を省く"/>
<input type="checkbox"/>	毎年	<input type="text" value="毎"/>	月	<input type="text" value="毎"/>	週	<input type="text" value="毎"/>	曜日	<input type="text" value="を省く"/>
<input type="checkbox"/>	毎年	<input type="text" value="毎"/>	月	<input type="text" value="毎"/>	週	<input type="text" value="毎"/>	曜日	<input type="text" value="を省く"/>
<input checked="" type="checkbox"/>	毎年	<input type="text" value="3"/>	月の	<input type="text" value="第2"/>	営業日と、その前	<input type="text" value="0"/>	日間、その後	<input type="text" value="0"/> 日間 <input type="text" value="を省く"/>

<input type="checkbox"/>	メジャー	SQ	前日	と、その前	<input type="text" value="0"/>	日間、その後	<input type="text" value="0"/> 日間 <input type="text" value="を省く"/>
<input checked="" type="checkbox"/>	NY市場休場日の	前日	と、その前	<input type="text" value="0"/>	日間、その後	<input type="text" value="0"/> 日間 <input type="text" value="を省く"/>	

④ ナイト市場で大きく売られた場合の検証をしてみましょう

- i. 直前のナイト市場で大きく売られた場合
 どのような優位性があるかの検証をしてみましょう。

メインフィルタ

ローソク足

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

⑤ 前の週の値動きを検証してみましょう

- i. 前の週の、日通し週足のローソク足が、どれくらいの長さの上髭なら負けるのかを、高値と、実体の高値を比較して検証してみましょう。

メインフィルタ

乖離

本日の 日経 の 始値 が、前日の 日経 の 始値 から
 + 0% 超 乖離している

本日の 日経 の 始値 が 本日を含めた 過去 0 日 間の
 日経 の 始値 から + 0% 超 乖離している

本日の 日経 の 実体の高値 が、その日の 日通し の
 高値 から - 1.25% 以下 乖離して いない

本日から過去 0 日前 ~ 過去 0 日 前のうち、 0 % 以上
 の 日経 の 始値 が、その日の 日経 の
 始値 から + 0% 超 乖離して いる

本日から過去 1 週間 ~ 過去 1 週間 前のうち、 0 % 以上
 の 日経 週足の 始値 が、その週の 日経 週足の
 始値 から + 0% 超 乖離して いる
 ※ 本日から過去「0」週前 = 今週は指定できません。

本日から過去 1 週間 ~ 過去 1 週間 前のうち、 0 % 以上
 の 日経 週足の 始値 が、その週の 日経 週足の
 始値 から + 0% 超 乖離して いる
 ※ 本日から過去「0」週前 = 今週は指定できません。

本日から過去 1 週前の 日通し 週足の 実体の高値 が、本
 日から過去 1 週前の 日通し 週足の 高値 から
 - 1.5% 超 乖離している
 ※ 本日から過去「0」週前 = 今週は指定できません。

◆ ⑥は、サブフィルタの説明です。

サブフィルタは「悪い条件を除外する」ためのものであり、以下のように検証します。

- 【設定例】にある条件の「逆」を設定して検証します。
 (「〇〇以下」は「〇〇超」に、「〇〇を省く」は「〇〇を含む」にして検証します。)
- 最も悪い条件(グラフが右肩下がり)になる数値を見つけます。
1. の設定を元に戻すことで、悪い条件を除外できます。

⑥ 株価が中期的に高値圏にあるときに
 成績が悪くなる条件を省きましょう

サブフィルタ

- i. オシレータのRSI条件を利用して、検証してみましょう。

オシレータ

本日の過去 1 日 前から過去 9 日 間の 日中 の
 RSI(SMA)が 70 % 以下 である

⑦ ロスカットの検証方法を学びましょう！

- i. エントリーしてから、株価が大きく逆行してしまうこともあります。それに備え、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

⑧ 最終確認をしましょう！

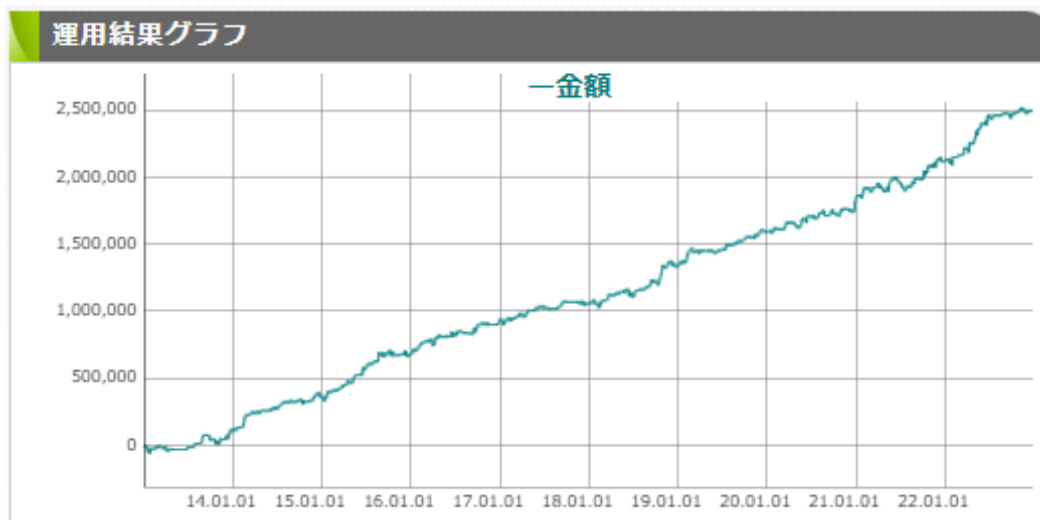
- i. グラフは右肩上がりになっているか？
- ii. 最大DDは、大きすぎないか？
- iii. 取引回数は少なすぎないか？

特殊注文条件	
<input checked="" type="checkbox"/> ロスカット：エントリー価格から	300円下がったら
<input type="checkbox"/> 利益確定：エントリー価格から	0円上がったたら

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：～2022/12/30



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
2013/01/01～2013/12/31	122,000	118.0%	-65,500	52	60.8%
2014/01/01～2014/12/31	247,500	239.5%	-38,000	81	66.7%
2015/01/01～2015/12/31	317,500	307.2%	-61,500	84	61.0%
2016/01/01～2016/12/31	222,500	215.3%	-43,500	69	63.2%
2017/01/01～2017/12/31	151,500	146.6%	-42,500	97	54.7%
2018/01/01～2018/12/31	276,000	267.1%	-60,500	66	68.2%
2019/01/01～2019/12/31	262,500	254.0%	-38,000	80	63.3%
2020/01/01～2020/12/31	222,000	214.8%	-48,500	72	62.0%
2021/01/01～2021/12/31	292,450	283.0%	-103,350	83	60.5%
2022/01/01～2022/12/30	380,950	368.6%	-55,300	63	65.1%

総合運用実績

最低運用資金	103,350
損益累計	2,494,900
利回り	2414.0%
勝率	62.3%
最大ドロウダウン(DD)  通知メール設定	-103,350

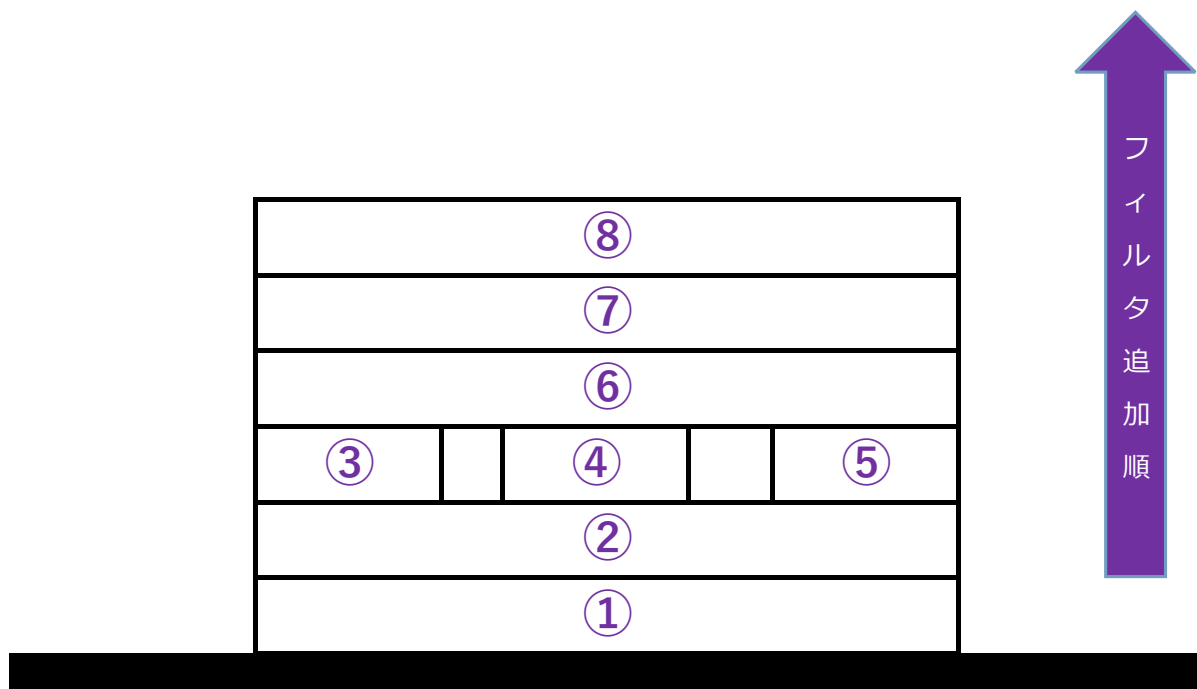
これは、講座用のKENSHIRO-225ソフトを使って作成したサンプルの成績です。

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。