

検証方法の説明書を使ったロジック作成の手順

1 説明書の手順に沿って検証をして、ロジックを作成してみる

ご自身の正規版 KENSHIRO-225 ソフトの検証画面で、説明書の手順に沿って、数値を入力し、さまざまな数値で検証をしてみてください。

この手順どおりに条件文(フィルタ)ごとに一つずつ検証していき、ご自身で納得した数値を使って、ロジックを完成させましょう。

2 ロジックのアイデアを踏まえながら、過去のマーケットに照らし合わせて調子のよい時期と悪い時期を分析して、把握しましょう。

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、調子のよい時期と悪い時期を踏まえたうえで運用をしていきましょう。

※1

投資助言業に抵触しないよう、
本教材(説明書)を使ったロジック作成についての具体的なサポートは行っておりません。

ご自身で判断のうえ検証を行い数値を決定して、ロジックを完成してくださるようお願いいたします。

上昇傾向狙い日中買いの検証方法

～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～

*これはあくまでも検証例ですので、必ずご自身でパラメーター等を検証してお決めになり判断をしてください。

■これは、どんなアイデア？

【検証を行う仮説は、こちらです】

A) 期日設定の条件文を作って検証する：

株は、季節性・時季によって上がりやすいタイミングがあるのではないか？

B) ローソク足の条件文を作って検証する：

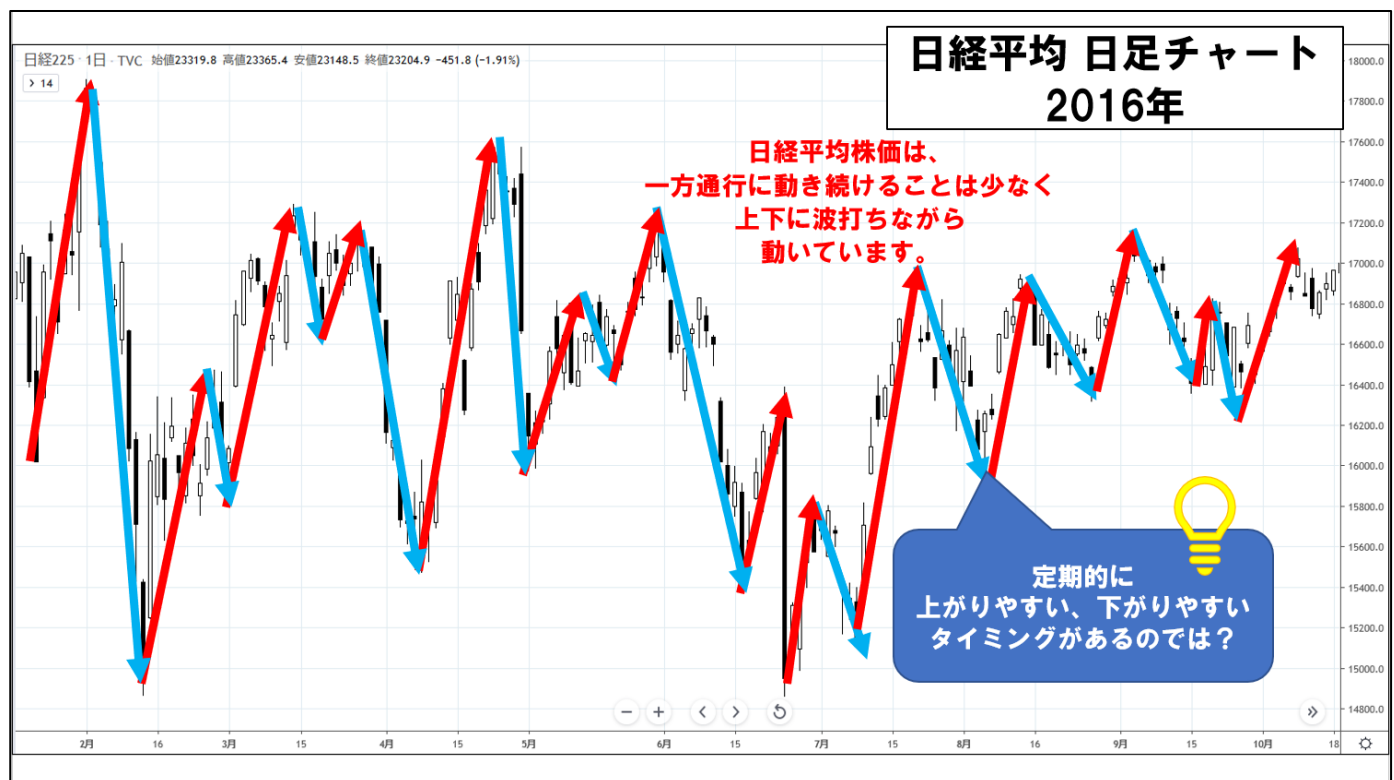
日経先物が、直前のナイト市場で大きく売られていなければ、上昇しやすいのではないか？

C) 週足のローソク足の条件文を作って検証する：

日通しの日経先物が、前の週に大きく上昇したのち、失速して終わる局面（長い上髭が出た）では、相場は下落しやすい（上昇しづらい）のではないか？

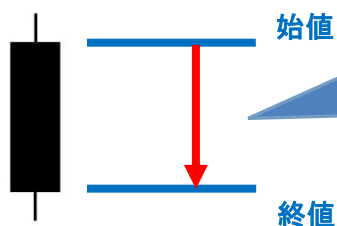
⇒それとは逆の局面では、株価は上昇しやすいのではないか？

A)



B) 条件文を満たす、ローソク足の例(日経先物ナイト 日足チャート)

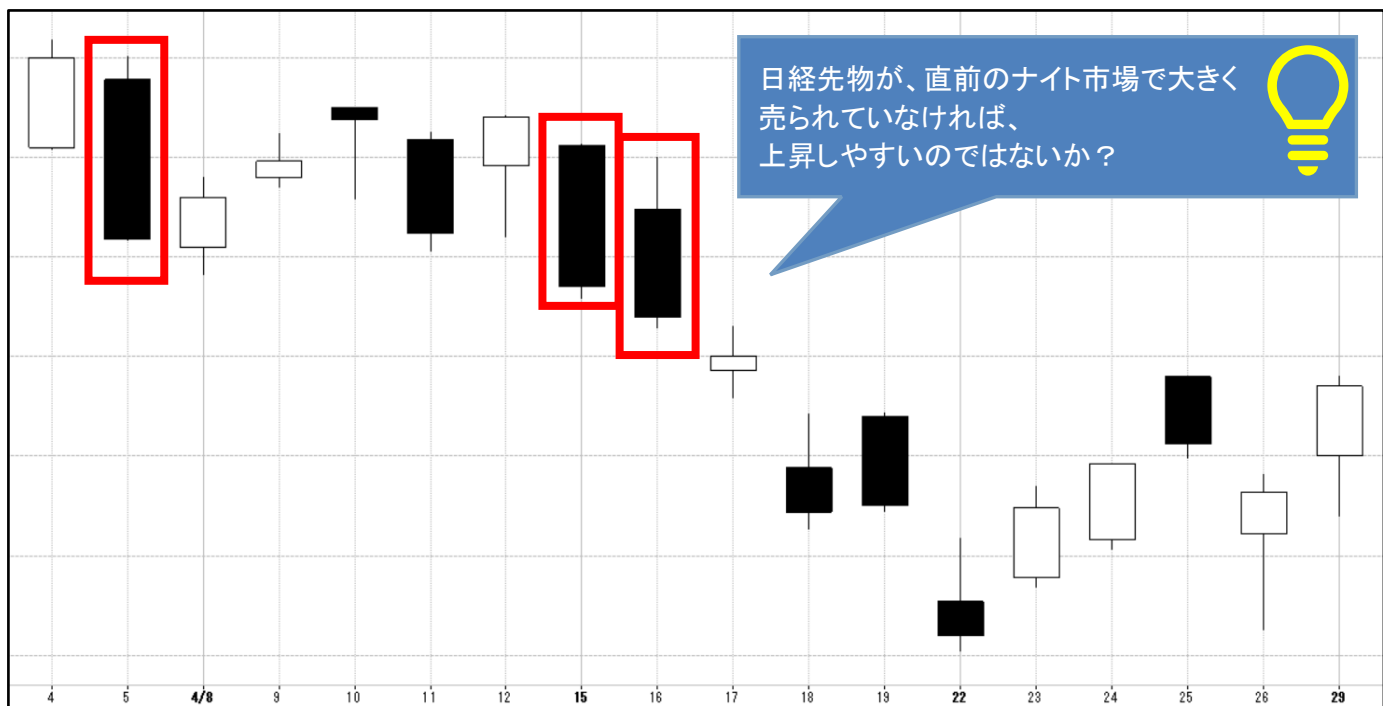
【前夜の足】



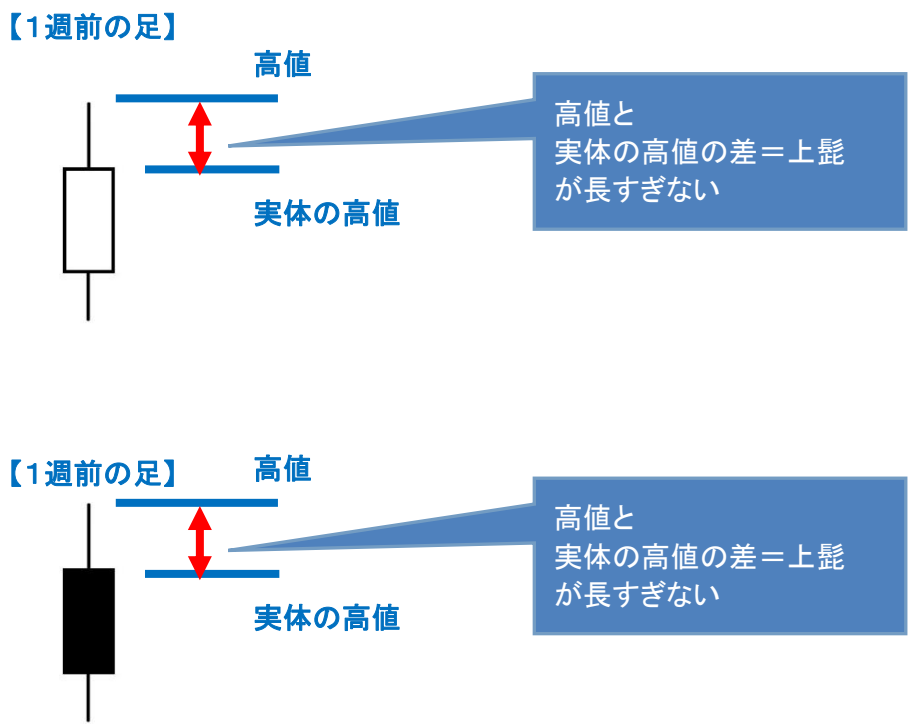
ナイトの終値が、
ナイトの始値より
大きく下げている
(長い陰線)

このような場合で
なければ、上昇し
やすいのではな
いか？

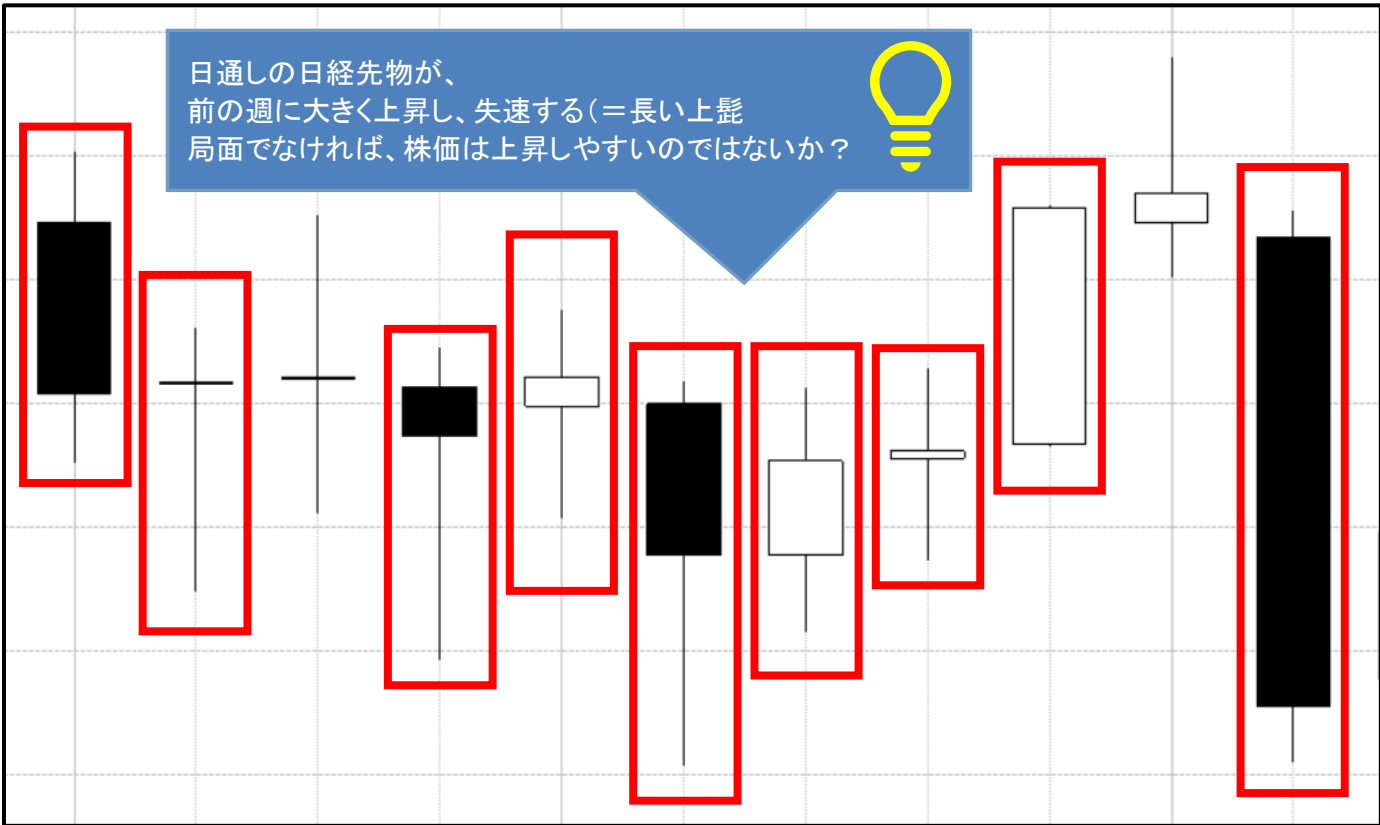
実際のチャートでは、陽線／陰線、ヒゲの長さの違い等、
さまざまなパターンがあります。



c) 条件文を満たす、ローソク足の例(日経先物日通し 週足チャート)



実際のチャートでは、陽線／陰線、ヒゲの長さの違い等、さまざまなパターンがあります。



【検証の手順】

① 検証する期間を設定しましょう。

■設定例

検証期間指定：2013/01/01～

② 検証をしたい時間帯のエントリー/エグジットを設定しましょう。

例えば、条件を満たした後、日中の始値で買い、
同日の日中の終値で売る、日中寄り引けの時間帯で作ってみましょう。

■設定例

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

③ 季節要因や週等の偏りから、上昇しやすい時期を探ってみましょう。

メインフィルタ

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

月頭、月末、お盆、正月、辺りの検証もしてみると良いでしょう。

■設定例

以下のような様々な期日を検証をして確認していきましょう。

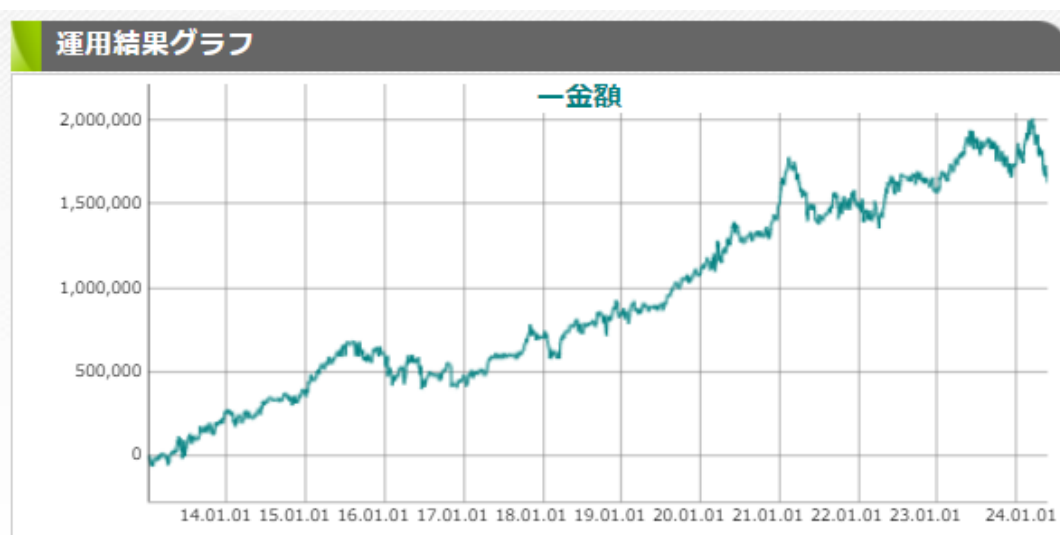
8/15の前後●営業日を省く

毎年●月第●週●曜日を省く

…など。（他にもいろいろ検証してみましょう）

季節要因や週等の条件は、定期的に変化するので、定期的に検証しなおしましょう。

▼手順①②+③（設定例）までの条件で検証結果がこのような右肩上がりになるようにしましょう。



④ 直前のナイト市場の値動きについて

メインフィルタ

優位性があるかを検証してみましょう。

日経先物の、直前のナイトの終値が、ナイトの始値よりも、大きくは下げている。
(下げずに、上昇した場合も含む。)
という条件を設定してみましょう。

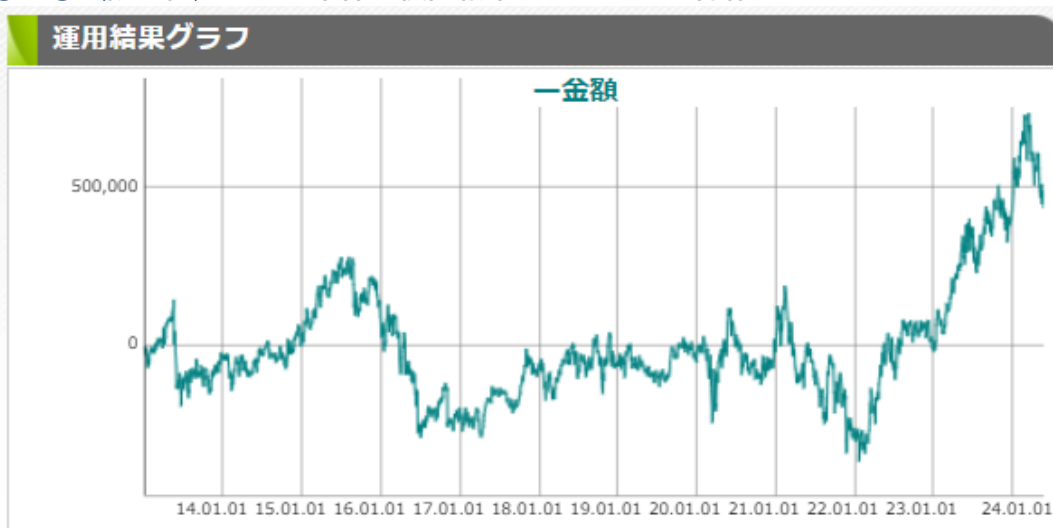
■設定例

本日から過去●日前のナイトの『終値-始値』が-●円超である

というように、どの数値が良いか(右肩上がりになるか)を検証していきましょう。
パラメータは、ご自身で検証してみてください。

▼手順③を除外して、

手順①②+④(設定例)までの条件で検証結果がこのような右肩上がりになるようにしましょう。



⑤ 日通し日経先物の週足が、長い上髭を出していない、
という条件を設定してみましょう。

メインフィルタ

■設定例

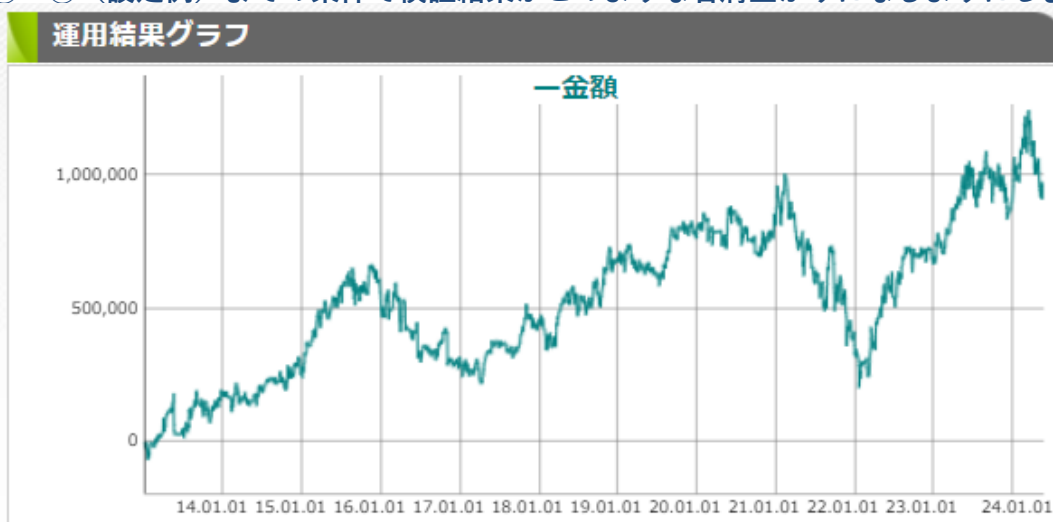
本日から過去●週前の日通し週足の実体の高値が、

本日から過去●週前の日通し週足の高値から-●%超乖離している

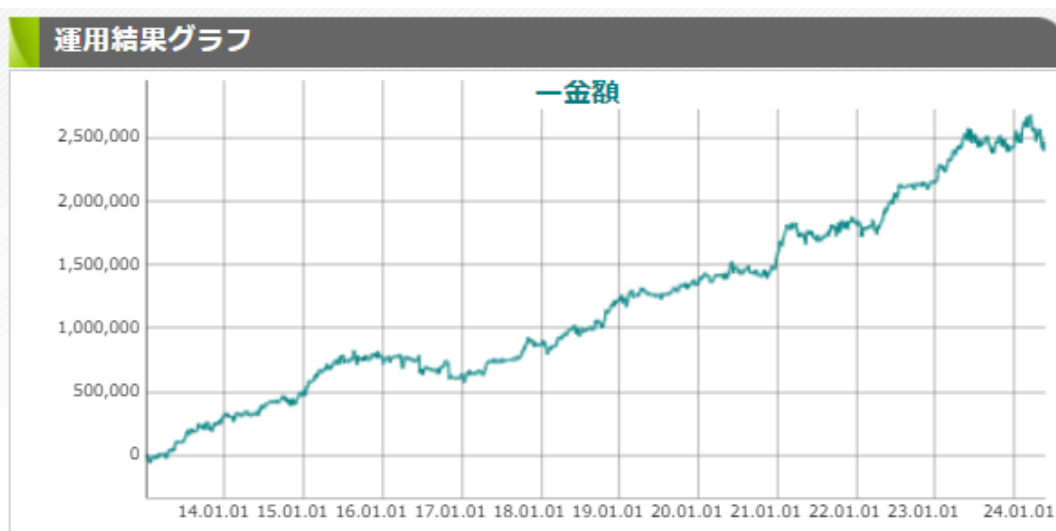
というように、どの数値が良いか(右肩上がりになるか)を検証していきましょう。
パラメータは、ご自身で検証してみてください。

▼手順③・④を除外して、

手順①②+⑤(設定例)までの条件で検証結果がこのような右肩上がりになるようにしましょう。



▼手順①～⑤を全て設定した検証結果がこのような右肩上がりになるか、確認しましょう。



- ◆ ⑥、① 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」ための条件文であり、以下のように検証します。
1. ■設定例 にある条件を「逆」にした場合を検証します。
(「〇〇以下」は「〇〇より大きい」に、「〇〇を省く」は「〇〇を含む」にして検証します。)
 2. 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。
 3. 1. の設定を元に戻すことで、悪い条件を除外できます。

⑥ オシレータ (RSI) を使い、買われ過ぎの状態にあるとき、
優位性があるかを検証してみましょう。

サブフィルタ

RSIは相対力指数と言われ、数値が大きいと買われ過ぎ、数値が小さいと売られ過ぎ、
というシグナルとして用いられる、テクニカル指標です。

ある期間の日中の日経先物のRSIが、上がり過ぎている場合に買うとどうなるのかを、検証してみましょう。

■設定例

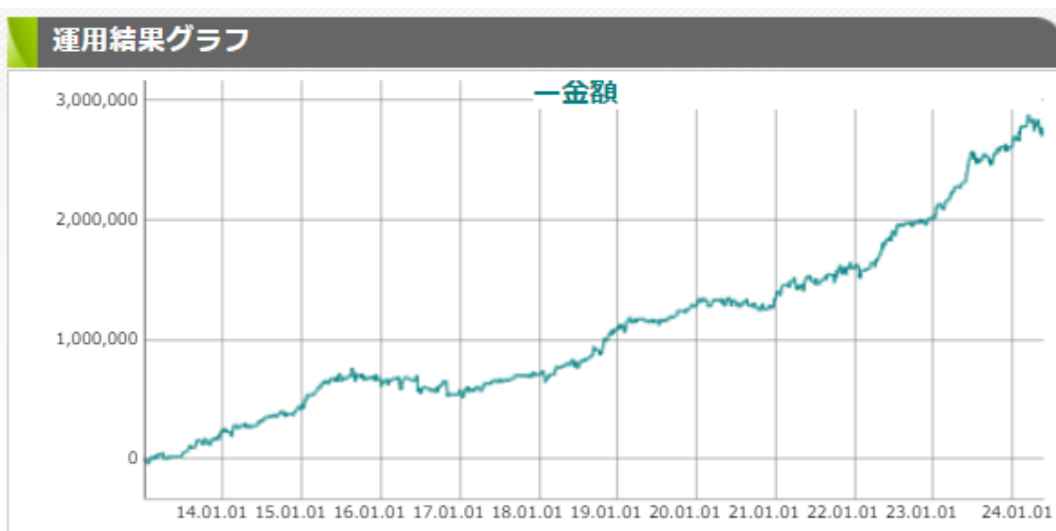
本日の過去●日前から過去●日間の日中のRSI(SMA)が●%以下である

まず、『以下』を『より大きい』にして、パラメータを変えて検証してみましょう。

一番悪い数値(右肩下がりになる条件)を見つけたら、『より大きい』を『以下』に戻します。

こうすることで、悪い条件を省けます。

▼手順①～⑤+⑥(設定例)までの条件で検証結果がこのような右肩上がりになるようにしましょう。



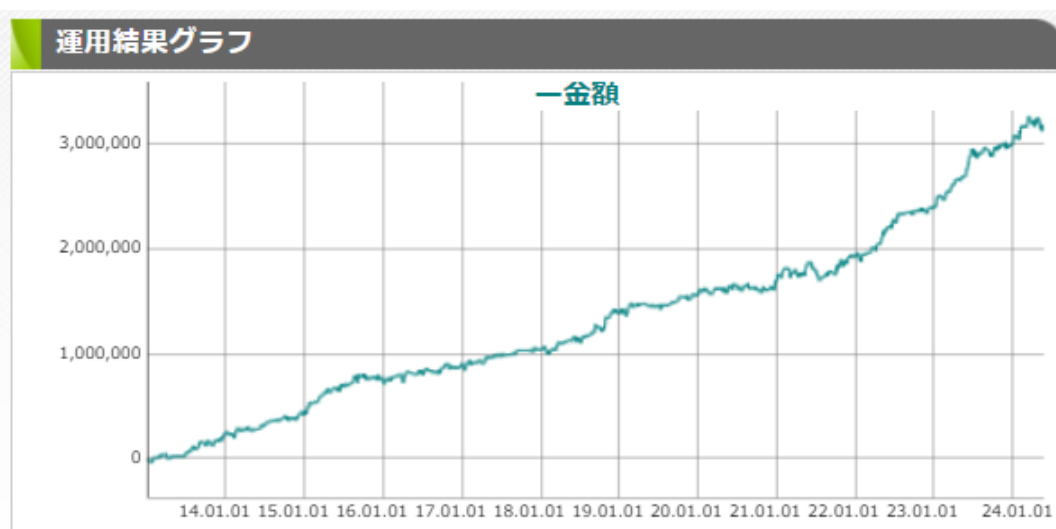
⑦ ロスカットの検証方法を学びましょう！

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。

■設定例

エントリー価格から●円下がったらロスカット
100円下がったら、200円下がったら、、、
と順番に検証をしていきましょう。

▼手順①～⑥+⑦までの条件で検証結果がこのような右肩上がりになるようにしましょう。



★ここから先の手順は、オプションです。さらに戦略を良くするための手順として、ご参考ください。

④ 特定の経済イベントによる偏りを探しましょう！

サブフィルタ

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。

■設定例

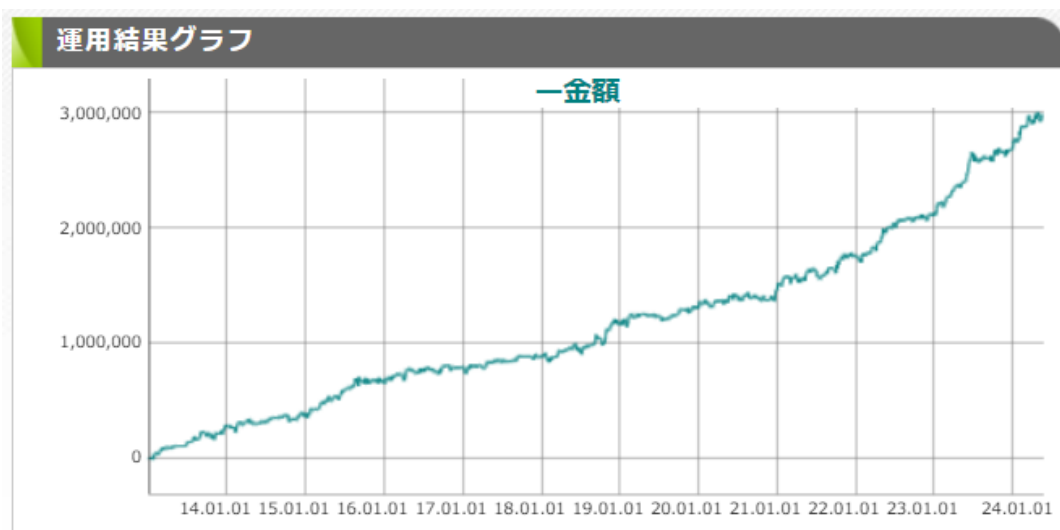
以下のような様々な経済イベントを検証をして確認していきましょう。

- ・ドイツ生産者物価指数(PPI)の当日を省く
- ・FOMC政策金利発表の翌日を省く
- ・FRB議長発言 (FOMC後の会見も含む) の翌日を省く
- ・FOMC議事要旨公表の当日を省く

『省く』を『含む』にして、検証してみましょう。

検証の結果、右肩下がりになる条件を見つけたら、『含む』を『省く』に戻して、省いていきましょう。経済イベントの条件は、定期的に変化するので、定期的を検証しなおしましょう。

▼手順①～⑦+④までの条件で検証結果がこのような右肩上がりになるようにしましょう。



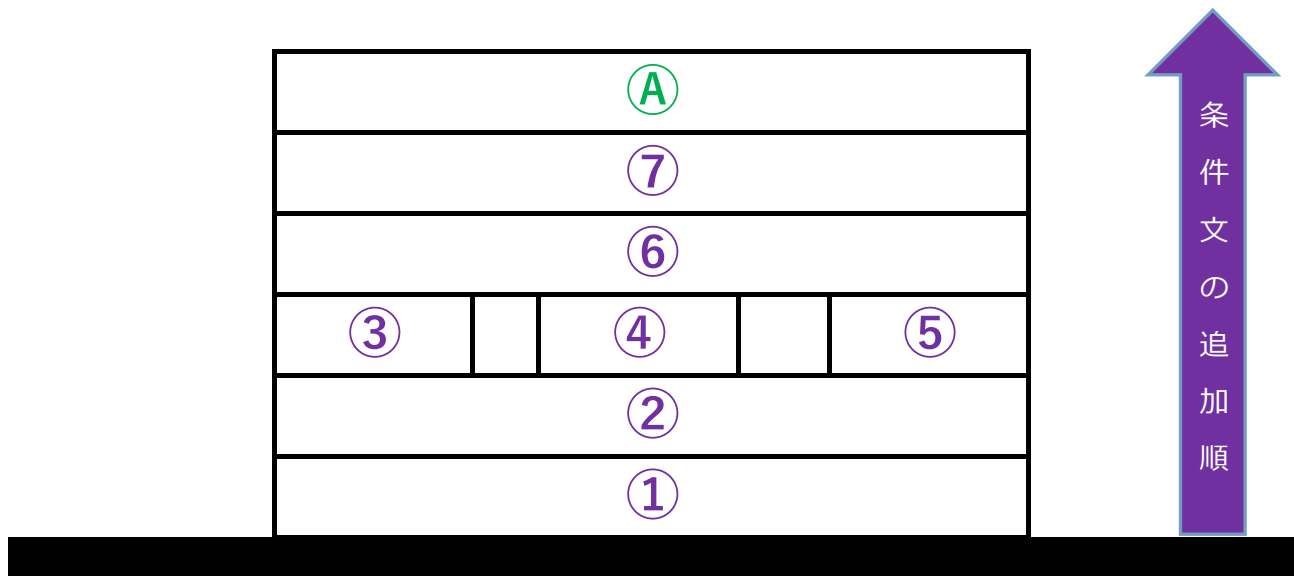
⑤ 最終確認をしましょう！

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

ロジック構築図

この売買ロジックの条件文の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。



※条件文のパラメータを見直しをする際の注意点

パラメータを見直しするには、手順通りに検証を行わないと、カーブフィッティングの原因になります。