

# テンプレートを使ったロジック作成の手順

## 1 動画講座を視聴する

まずは、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、動画講座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 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、

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。

# ETF S&P500オーバーナイト買い

～中長期的に上昇する傾向が強い海外市場に連動するETFを、タイミングを見計らって売買を行い短期トレードで買う場合の検証例～

## 【仮説】

- ・ 株価が小幅な値下がりで済んだ後は、反発して上がりやすいのではないか？
- ・ 株価が直近の価格帯から大きく値下がりしている場合は、買うのを避けたほうがいいのか？

## 【検証の手順】

### ① 検証する市場（銘柄）を設定しましょう。

- 対象：1557 SPDR-S&P500ETF
- 口数：50口

※最低運用資金がすべてのロジックで同じくらいになるように揃えとのちのち比較しやすくなります。

この例では、100～200万円くらいになるように設定しています。

### ② エントリー/エグジットの時間枠を設定します。

- 翌日の日中の終値で買いエントリー
- エントリー日から、1日後の日中の始値で決済

### ③ 株価が値下がりをした場合の値幅によって、優位性がどうなるかを検証しましょう。

- 前日の終値からの値下がり幅（乖離）が、どの程度だったら優位性があるかを検証してみましょう。

サブフィルタ

## 【設定例】

■ シミュレーション対象	
1557 SPDR-S&P500ETF	▼
売買口数:	50 ※売買単位1口

■ 注文条件	
【ドテン】	
<input type="checkbox"/> サイン表示の	当日 ▼ の 日中 ▼ の 始値 ▼
【エントリー】	
<input checked="" type="checkbox"/> サイン表示の	翌日 ▼ の 日中 ▼ の 終値 ▼ で 買い ▼
【エグジット】	
<input type="checkbox"/> サイン表示の	当日 ▼ の 日中 ▼ の 始値 ▼ で 買い ▼
<input checked="" type="checkbox"/> エントリー日から	1 日後の、日中 ▼ の 始値 ▼ で決済

■ 乖離	
<input type="checkbox"/> 本日の 日経 ▼ の 始値 ▼ が 本日を含まない ▼ 過去 0 日間の 日経 ▼ の 始値 ▼ 平均(MA)から + ▼ 0 % 超 ▼ である	
<input type="checkbox"/> 本日の 日経 ▼ の 始値 ▼ が 本日を含まない ▼ 過去 0 日間の 日経 ▼ の 始値 ▼ 平均(MA)から + ▼ 0 % 超 ▼ である	
<input checked="" type="checkbox"/> 本日の 日経 ▼ の 終値 ▼ が、前日 ▼ の 日経 ▼ の 終値 ▼ から - ▼ 0.8 % 超 ▼ 乖離している	

④ 株価が直近の価格帯から、大幅に下落した場合に  
優位性がどうなるかを検証してみましょう

- i. 前週の週足の実体の安値から、大幅に下落した場合に  
成績がどうなるかを検証してみましょう。

サブフィルタ

⑤ 期日の偏りを探しましょう！

- i. 年末年始、お盆、GW、月頭、月末 など、  
特殊な時期を検証。

サブフィルタ

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

【設定例】

**乖離**

本日の 日経 の 始値 が 本日を含まない 過去 0 日間の 日経 の 始値 平均(MA)から + 0% 超 である

本日の 日経 の 始値 が 本日を含まない 過去 0 日間の 日経 の 始値 平均(MA)から + 0% 超 である

本日の 日経 の 終値 が、 前日 の 日経 の 終値 から - 0.8% 超 乖離している

本日を含まない 過去 日間連続して、 日経 の 始値 が その日 の 日経 の 始値 から + % 超 乖離している

本日を含まない 過去 日間連続して、 日経 の 始値 が過去 日間の 日経 の 始値 平均から + % 超 乖離している

本日から過去 0 日間の 日経 の 終値 が、 本日から過去 1 週前の 日経 週足の 実体の安値 から - 4% 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「0」週前 = 今週は指定できません。

**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

毎年 2 月 第3 週 木 曜日 を省く

毎年 2 月 第4 週 木 曜日 を省く

毎年 2 月の 第11 営業日と、その前 0 日間、その後 6 日間 を省く

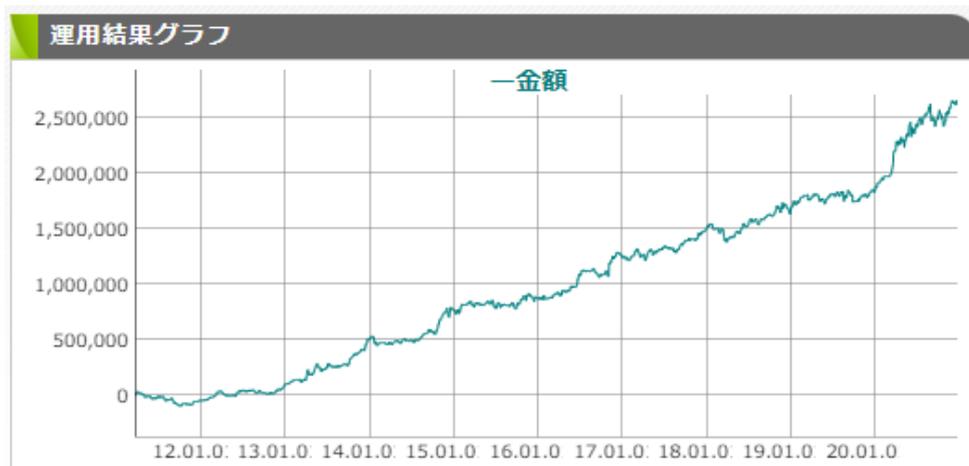
毎年 3 月の 第2 営業日と、その前 0 日間、その後 3 日間 を省く

## 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：～2020/12/30まで

売買口数：50口



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
2011/03/24～2011/12/31	-47,500	-2.2%	-137,500	137	50.0%
2012/01/01～2012/12/31	107,000	5.0%	-86,500	188	53.6%
2013/01/01～2013/12/31	448,000	21.0%	-72,500	176	58.9%
2014/01/01～2014/12/31	279,000	13.1%	-89,000	185	63.4%
2015/01/01～2015/12/31	109,000	5.1%	-88,500	174	53.3%
2016/01/01～2016/12/31	369,500	17.3%	-81,000	175	61.2%
2017/01/01～2017/12/31	222,000	10.4%	-108,500	210	55.7%
2018/01/01～2018/12/31	205,500	9.6%	-174,000	183	61.2%
2019/01/01～2019/12/31	167,000	7.8%	-110,000	196	60.2%
2020/01/01～2020/12/30	790,500	37.1%	-207,500	184	58.9%

総合運用実績

最低運用資金	2,130,000
損益累計	2,650,000
利回り	124.4%
勝率	57.8%
最大ドローダウン(DD)	-207,500

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。

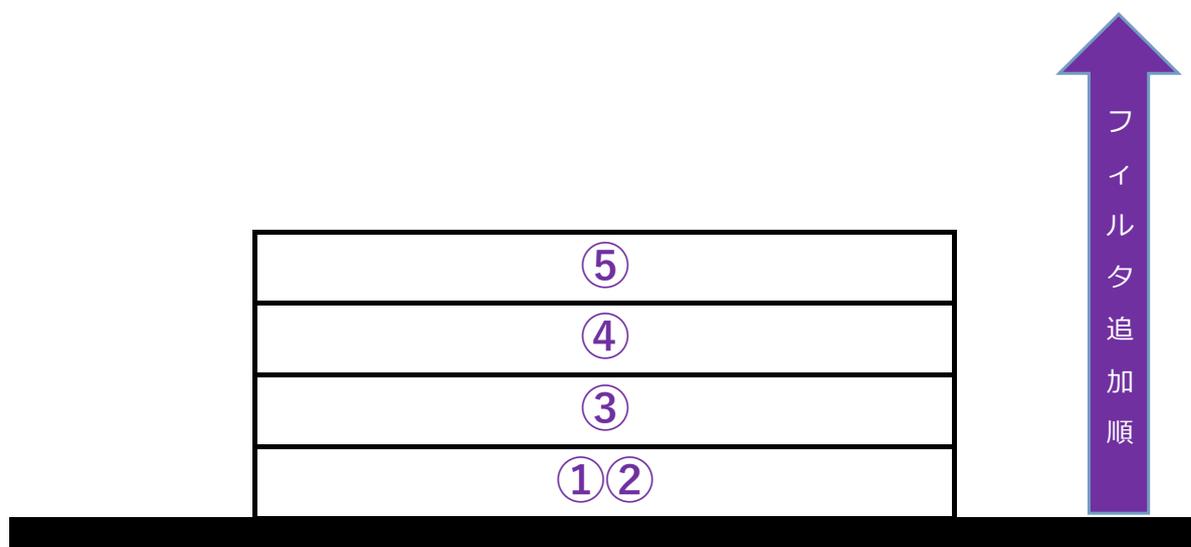
講座用のソフトでは、4本値のデータは実際のデータとは異なる類似データを利用しています。

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」

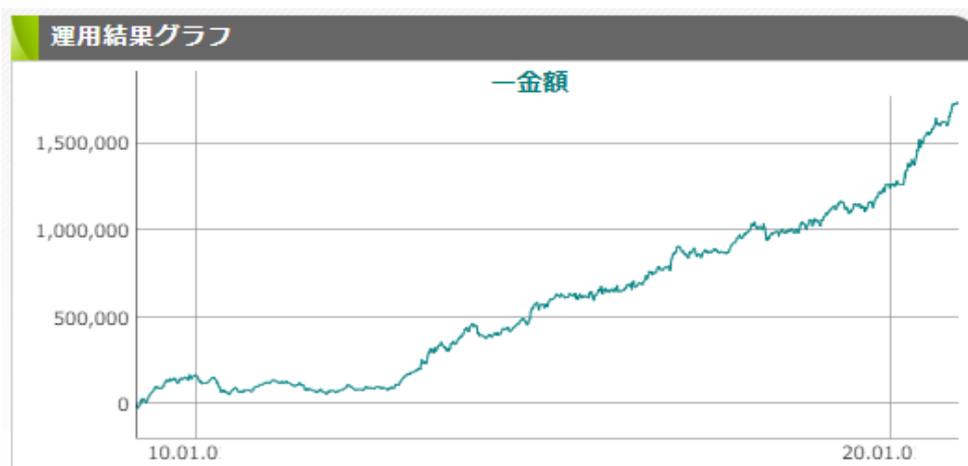
をご視聴になり、ご参考ください。

## おまけ 検証する市場を"日経225連動ETF"に変更した場合のサンプル結果

検証に利用したデータ期間：～2020/12/30まで

対象：1346 MAXIS日経225ETF

売買口数：50口



**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
2009/02/25～2009/12/31	166,500	10.8%	-30,000	154	58.7%
2010/01/01～2010/12/31	-53,000	-3.4%	-116,000	173	53.0%
2011/01/01～2011/12/31	-40,500	-2.6%	-113,500	166	48.4%
2012/01/01～2012/12/31	66,000	4.3%	-103,500	188	52.6%
2013/01/01～2013/12/31	325,000	21.1%	-51,000	176	63.4%
2014/01/01～2014/12/31	113,500	7.4%	-83,000	185	58.2%
2015/01/01～2015/12/31	89,500	5.8%	-51,500	174	52.9%
2016/01/01～2016/12/31	223,000	14.5%	-39,000	177	54.7%
2017/01/01～2017/12/31	105,500	6.9%	-69,000	210	55.2%
2018/01/01～2018/12/31	53,500	3.5%	-106,000	182	51.7%
2019/01/01～2019/12/31	214,500	13.9%	-73,500	202	57.9%
2020/01/01～2020/12/30	476,500	31.0%	-48,500	184	56.3%

**総合運用実績**

最低運用資金	1,539,000
損益累計	1,740,000
利回り	113.1%
勝率	55.3%
最大ドロウダウン(DD)	-116,000

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。