

「月に一回、大幅下落投資法」

毎月一回、大幅に下がった銘柄を買った場合、半年以内にどうなったのかを調べてみました。

■条件

J P分析 月足シートを使います。

過去半年間の最高値から、6割以上下がった(4割以下となった)銘柄

コメント			22000円台で保ち合い	
短期弾性値 以上	出来高倍率 以下	最高値・最低値 周期	出来高水準 周期	
短期弾性値 以下	最大出来高 周期	最高値/最低値 以上	出来高水準 以上	
中期弾性値 以上	最大出来高か?	最高値/最低値 以下	短中M間カイリ 以上	
中期弾性値 以下	短弾	最低値・最高値 周期	MACD①(4-20) 向き	
長期弾性値 以上	中弾 向き	最低値/最高値 以上	MACD②(5-20) 向き	
長期弾性値 以下	長弾 向き	最低値/最高値 以下	短M/中M 位置	
MAV指標 以上	MAV 向き	最高値 周期	生中弾/中弾 位置	
MAV指標 以下	短期M 向き	最高値/安値 以上	生中弾/長弾 位置	
短期M指標 以上	中期M 向き	最高値/安値 以下	株価水準 以上	
短期M指標 以下	生短弾 向き	最低値 周期	株価水準 以下	
中期M指標 以上	生中弾 向き	最低値/高値 以上		
中期M指標 以下	生長弾 向き	最低値/高値 以下		
生短弾性値 以上	短コスト 向き	長コスト/前日安値 以上		
生短弾性値 以下	長コスト 向き	長コスト/前日安値 以下		
生中弾性値 以上	短/長コスト 位置	長コスト/前日高値 以上		
生中弾性値 以下	短コスト上・下抜け	長コスト/前日高値 以下		
生長弾性値 以上	長コスト上・下抜け	生短弾/短弾 位置		
生長弾性値 以下	短長DC後日柄 以上	終値/高値 以上		
最高値 周期	短長DC後日柄 以下	終値/高値 以下		
最高値比率 以上	短長GC後日柄 以上	終値/安値 以上		
最高値比率 以下	短長GC後日柄 以下	終値/安値 以下		
最高値日柄 以上	短弾/中弾 位置	新値 周期		
最高値日柄 以下	中弾/長弾 位置	安値更新本数 以上		
最高値 周期	短弾/長弾 位置	安値更新本数 以下		
最高値比率 以上	陽線・陰線?	高値更新本数 以上		
最高値比率 以下	高値切り上・下がり	高値更新本数 以下		
最高値日柄 以上	安値切り上・下がり	足取り・5本設定		
最高値日柄 以下	RJ指数 以上	ハイ・ローバンド 周期		
出来高倍率 以上	RJ指数 以下	ハイ・ローバンド 向き		
	RJ指数 向き	短中M間カイリ 以下		

最高値周期 「6」・・・半年なので6、一年なら12となります。

最高値比率 「0.4」以下・・・最高値から株価が、4割以下となった(6割以上、下がったという意味)
 半値以下なら、「0.5」となり、
 5%下落したという条件なら、「0.05」となります。

■ 検証

仕掛けてから、半年先まで調べます。

期間は全期間としました。

■結果

J.P分析検証実行中

銘柄数: 3925 / 3925

銘柄 9997 ベルーナ

閉じる 印刷

結果 白

90%以上上昇の確率	30.44	90%以上上昇の件数	2091
80%以上上昇の確率	5.18	80%以上上昇の件数	356
70%以上上昇の確率	5.90	70%以上上昇の件数	405
60%以上上昇の確率	7.42	60%以上上昇の件数	510
50%以上上昇の確率	7.15	50%以上上昇の件数	491
40%以上上昇の確率	8.44	40%以上上昇の件数	580
30%以上上昇の確率	8.40	30%以上上昇の件数	577
20%以上上昇の確率	8.92	20%以上上昇の件数	613
10%以上上昇の確率	8.97	10%以上上昇の件数	616
5%以上上昇の確率	4.03	5%以上上昇の件数	277
5%未満上昇の確率	5.15	5%未満上昇の件数	354
		全件数	6870

コード	買信号日	条件	翌寄付	最高値	最安値	上昇率
9997	09/02/00	34	112.5	218	109	93.33
終値	115	日柄	2	0		
上昇率	89.13					

この結果から、仕掛けた銘柄の内、およそ3割(30.44)が90%以上、株価が上昇したという事になります。

およそ5%(5.15)の銘柄については、上昇率が5%未満です。これらについては、ダメとします。

全ての銘柄を仕掛けたと仮定した場合、95%の銘柄については、最低でも+5%の利益となった事が分かります。

では合格したこれらの銘柄は、どういう頻度で出現するのでしょうか？

それを調べるには、「合格数検索」を実行します。

■合格数検索

J P シートに合格した銘柄数をファイルに保存します。

実行 中止

日足検索
 週足検索
 月足検索

シート編集 ユーザー銘柄管理

シート一覧表

シート 34 番~ 34 番まで

上記シートの合格数結果を全て合計して書き出す番号 35

検索開始日付 検索終了日付

19970600 20171000
19970700 20171100

全銘柄
 東証
 東証1部
 東証2部
 大証
 大証1部
 大証2部
 名証
 JASDAQ
 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)

「実行」をすると、スタートします。

終了すると、この画面が消えますので、次は表示です。

合格数を表示するには、J Pチャートからとなります。

※合格数検索で合格数を保存し、J Pチャートで表示する。この一連の流れは覚えておいて下さい。

合格数検索をしないと、J Pチャートからは表示出来ません。

■合格数グラフの表示

今回は、月足なので日経平均月足チャートを表示させます。



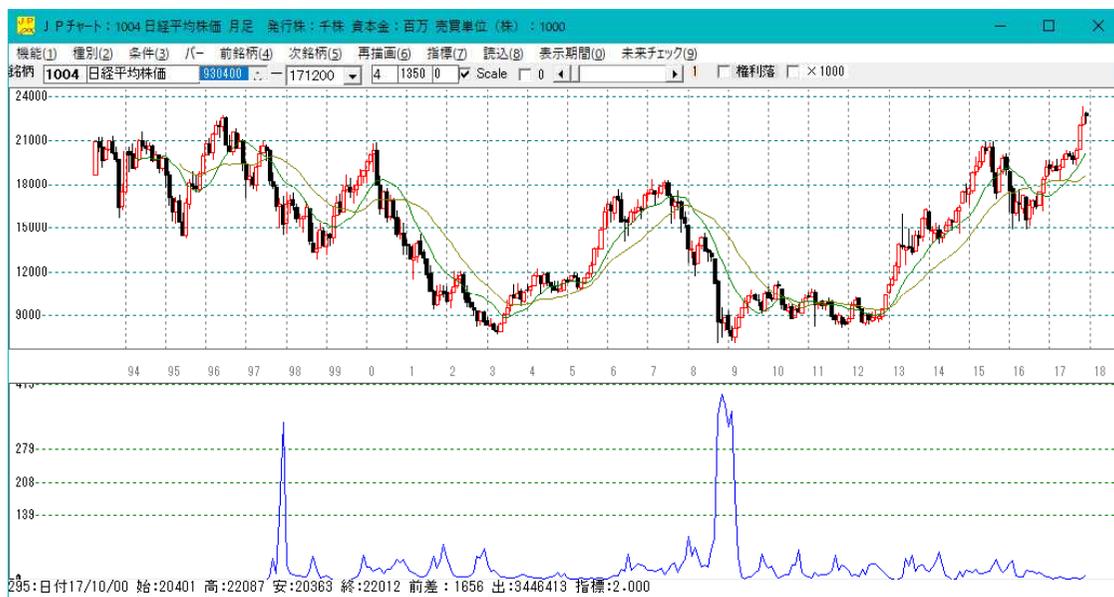
ここから、「機能」－「J P分析シート合格数」－「合格数表示」と進み、



今回は、34番シートを使用しましたので、[34]と入力し、[OK]をクリックします。



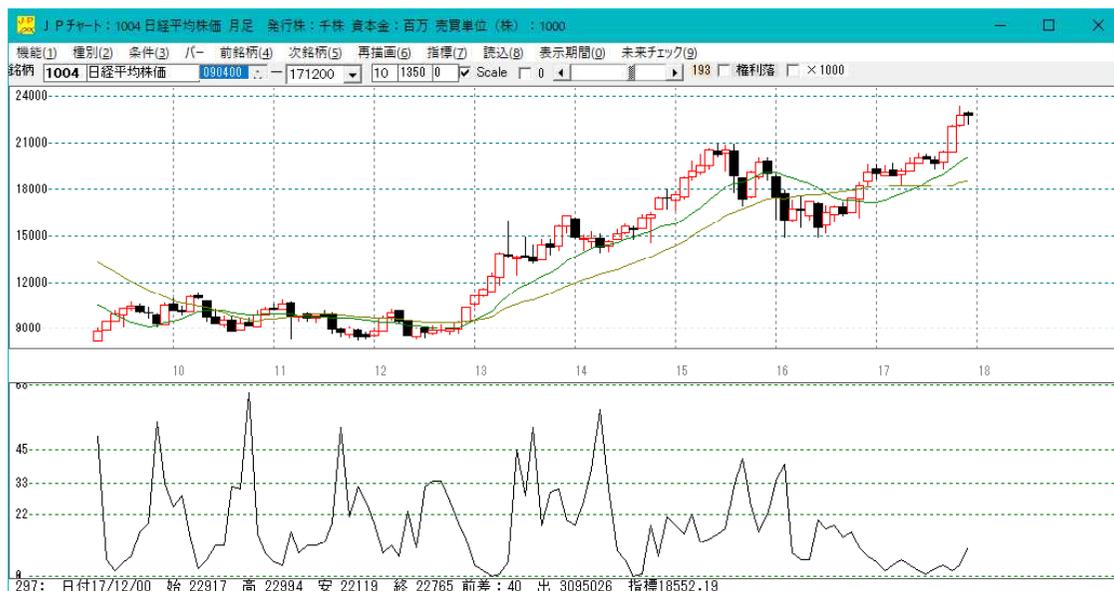
下記のように表示されます。



1997 年のアジア通貨危機、金融ビッグバンの時とリーマンショック直後が突出して多いです。

あまりにも合格数が多いので、その他の月の合格数がかすんでみえますが、どのくらい合格しているのでしょうか？

チャートを拡大し、リーマンショック後を見てみましょう。



2017年は少ないですが、それ以前は、毎年 20 銘柄以上合格してます。

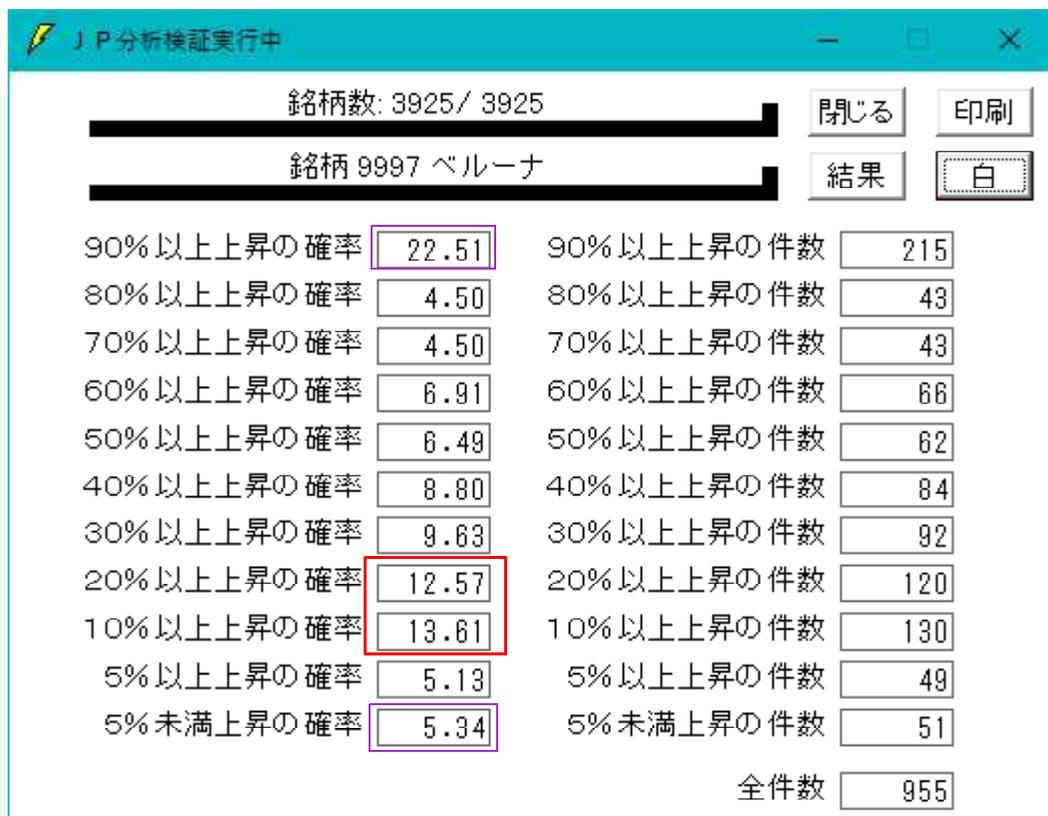
リーマンショック後、上記チャートの期間での検証結果をみてみましょう。

2009 年 4 月以降の検証結果



先の全期間での検証結果と大体同じとなりました。

2013 年以降（アベノミクス以降）の検証結果はこうなります。



90%以上株価が上昇する確率は、やや減少しますが、ダメ(5%未満)は5.3%と依然少ない確率となっています。

最近の傾向(2013年以降)から、仕掛けてからの手仕舞い処は、手堅く行くなら、20%、10%のところが多い、この近辺で利食い。

勝負する向きは、90%以上に賭けそこまで持続です。来ない場合は、半年後に手仕舞いです。

損切りの場合、元々6割以上、下落していますから、半年後の時間切れ負けでもいいと思います。

仕掛けてから、下がるのを極力避けるには、少し待つしかありません。

では、どのくらい待つのかを調べてみましょう。

それには、下降率検証をします。今までやってきた上昇率検証の逆です。

この検証をすると、仕掛けてから、どのくらい下落するのかが分かります。

■ 下降率検証

J.P分析検証

上昇率検証
 下降率検証
 日足検証
 週足検証
 月足検証

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 番～ 番 売買期間

検証開始日付	検証終了日付
19960700	20161000
19960800	20161100
19960900	20161200
19961000	20170100
19961100	20170200
19961200	20170300
19970100	20170400
19970200	20170500
19970300	20170600
19970400	20170700
19970500	20170800
19970600	20170900
19970700	20171000
19970800	20171100
19970900	20171200

- 全銘柄
- 東証
- 東証1部
- 東証2部
- 大証
- 大証1部
- 大証2部
- 名証
- JASDAQ
- 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)

検証は、全期間としてみました。

■結果

J.P分析検証実行中			
銘柄数: 3925/ 3925		閉じる	印刷
銘柄 9997 ベルーナ		結果	白
90%以上下降の確率	0.31	90%以上下降の件数	21
80%以上下降の確率	1.03	80%以上下降の件数	71
70%以上下降の確率	2.29	70%以上下降の件数	157
60%以上下降の確率	4.91	60%以上下降の件数	337
50%以上下降の確率	8.30	50%以上下降の件数	570
40%以上下降の確率	9.69	40%以上下降の件数	666
30%以上下降の確率	14.37	30%以上下降の件数	987
20%以上下降の確率	16.10	20%以上下降の件数	1106
10%以上下降の確率	19.11	10%以上下降の件数	1313
5%以上下降の確率	10.66	5%以上下降の件数	732
5%未満下降の確率	13.25	5%未満下降の件数	910
		全件数	6870

30%～5%未満までの間について下がる確率が他に比べ高いです。

10%までであれば、合計して、 $19.11+10.66+13.25=43.02\%$ なので、この辺りまでは仕掛けを待ってもよいのかもしれませんが。

また、30%までの確率が高いことから仕掛けた後、3割下がったら、ナンピン買い。という手もあります。

このように大きく下がった銘柄を買う投資法は、有効に思えます。

ソフトウェア様は、期間や、下落率を変更して、確率が良いシートを探してみてください。

■一年間で半値以下

J P分析ソフト 月足用 32番

コメント

短期弾性値 以上	出来高倍率 以下	最高値・最安値 周期	出来高水準 周期
短期弾性値 以下	最大出来高 周期	最高値/最安値 以上	出来高水準 以上
中期弾性値 以上	最大出来高か?	最高値/最安値 以下	短中M間カイリ 以上
中期弾性値 以下	短弾 向き	最安値・最高値 周期	MACD①(4-20) 向き
長期弾性値 以上	中弾 向き	最安値/最高値 以上	MACD②(5-20) 向き
長期弾性値 以下	長弾 向き	最安値/最高値 以下	短M/中M 位置
MAV指標 以上	MAV 向き	最高値 周期	生中弾/中弾 位置
MAV指標 以下	短期M 向き	最高値/安値 以上	生長弾/長弾 位置
短期M指標 以上	中期M 向き	最高値/安値 以下	株価水準 以上
短期M指標 以下	生短弾 向き	最安値 周期	株価水準 以下
中期M指標 以上	生中弾 向き	最安値/高値 以上	
中期M指標 以下	生長弾 向き	最安値/高値 以下	
生短弾性値 以上	短コスト 向き	長コスト/前日安値 以上	
生短弾性値 以下	長コスト 向き	長コスト/前日安値 以下	
生中弾性値 以上	短/長コスト 位置	長コスト/前日高値 以上	
生中弾性値 以下	短コスト上・下抜け	長コスト/前日高値 以下	
生長弾性値 以上	長コスト上・下抜け	生短弾/短弾 位置	
生長弾性値 以下	短長DC後日柄 以上	終値/高値 以上	
最安値 周期	短長DC後日柄 以下	終値/高値 以下	
最安値比率 以上	短長GC後日柄 以上	終値/安値 以上	
最安値比率 以下	短長GC後日柄 以下	終値/安値 以下	
最安値日柄 以上	短弾/中弾 位置	新値 周期	
最安値日柄 以下	中弾/長弾 位置	安値更新本数 以上	
最高値 周期	短弾/長弾 位置	安値更新本数 以下	
最高値比率 以上	陽線・陰線?	高値更新本数 以上	
最高値比率 以下	高値切り上・下がり	高値更新本数 以下	
最高値日柄 以上	安値切り上・下がり	足取り・5本設定	
最高値日柄 以下	RJ指数 以上	ハイ・ローバンド 周期	
出来高倍率 周期	RJ指数 以下	ハイ・ローバンド 向き	
出来高倍率 以上	RJ指数 向き	短中M間カイリ 以下	

開じる 印刷 変更 初期化 保存 一覧表 CSV 取込 一括 印刷2 白

2013 年以降 仕掛けてから三ヶ月先までの検証結果

90%以上上昇の確率	9.21	90%以上上昇の件数	788
80%以上上昇の確率	2.13	80%以上上昇の件数	182
70%以上上昇の確率	2.70	70%以上上昇の件数	231
60%以上上昇の確率	3.74	60%以上上昇の件数	320
50%以上上昇の確率	5.26	50%以上上昇の件数	450
40%以上上昇の確率	7.02	40%以上上昇の件数	600
30%以上上昇の確率	10.76	30%以上上昇の件数	920
20%以上上昇の確率	15.86	20%以上上昇の件数	1356
10%以上上昇の確率	20.32	10%以上上昇の件数	1738
5%以上上昇の確率	10.75	5%以上上昇の件数	919
5%未満上昇の確率	12.25	5%未満上昇の件数	1048
		全件数	8552

仕掛けてから三ヶ月の保有では、大きく上昇する銘柄を拾いきれないようです。

またダメの確率(12.25)も上昇しました。