

J P法株価分析システムのメインメニューから、右列下から4番目に「投資シミュレーション」というボタンがあります。

この機能は、どういうものなのでしょうか？

今回はそれについて解説していきます。

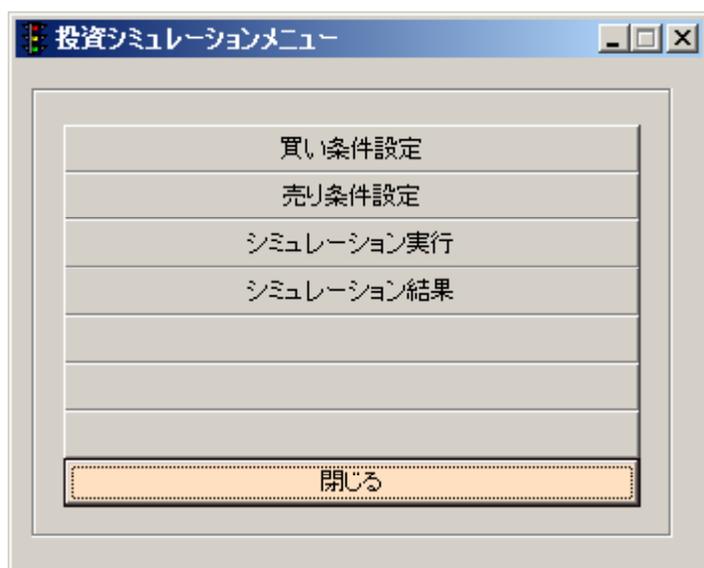
投資シミュレーションとは・・・

システムトレードという言葉をご存じでしょうか？これは、あるルールに基づいて仕掛け・手仕舞いを繰り返していくというものです。そのルールに裁量は入りません。今日は、なんとなく下がるから仕掛けない、といったことは排除します。

今から紹介する投資シミュレーションとは、仕掛け・手仕舞いの条件を決め、それに沿って売買した場合、どのくらいの利益または損失となるのかが分かる機能です。

買いの場合は、買い条件が仕掛けとなり、売り条件が手仕舞いです。

空売りの場合は、売り条件が仕掛けとなり、買い条件が手仕舞いです。



買い条件設定・・・買いの条件を決めます。

売り条件設定・・・売りの条件を決めます。

例として一番一般的と思われる、

仕掛けのサインが表示されたら「買い」、手仕舞いのサインが表示されたら「売る」というシミュレーションをしてみたいと思います。

手仕舞ったら、次の仕掛けのサイン（買いサイン）が表示するまでは何もしません。

簡単には以下のような流れとなります。

買い 売り、買い 売り、買い 売り・・・と続きます。

操作の流れは、

買い条件を決める、売り条件を決める、シミュレーションをしてみる、結果を見るです。

途中、銘柄群を決めるところがありますが、解説の流れからはずれますので今回は割愛します。

それでは、解説スタートです。

まずは仕掛ける条件である「買い」を決めます。

買い条件設定

買いの条件をセットします。

買いの場合は、仕掛の条件、空売りの場合は買い戻しの条件となります。

今回は、仕掛けが買いですからどのようなサインで銘柄を買うか、ということを下記表にセットします。セットしたら、「書込」をクリックして保存し「閉じる」です。

とりあえず、以下のようにしました。

相対力指数(RSI)が20ポイント以下でV字(下降から上昇へ転じた)となったら買いサインと決めます。

このチェックをすることにより、この項目について調べます。チェックが入っていないと、無視します。

買い条件設定	周期1	周期2	以上	以下	向き	××日前	以上	以下
<input checked="" type="checkbox"/> 1.相対力指数	14		0	20	3			
<input type="checkbox"/> 2.サイロジカル								
<input type="checkbox"/> 3.VR1								
<input type="checkbox"/> 4.VR2								
<input type="checkbox"/> 5.順位相関								
<input type="checkbox"/> 6.STC								
<input type="checkbox"/> 7.カイリ								
<input type="checkbox"/> 8.Sカイリ								
<input type="checkbox"/> 9.コストカイリ								
<input type="checkbox"/> 10.Sコストカイリ								
<input type="checkbox"/> 11.株価弾性値								
<input type="checkbox"/> 12.出来高倍率								
<input type="checkbox"/> 13.株価位置								
<input type="checkbox"/> 14.RJ指数								
<input type="checkbox"/> 15.新値3本足		[1]陽転 [2]陰転						
<input type="checkbox"/> 16.ハイローバンド			向き [1]買転換 [3]売転換 [4]買場 [5]売場					
買い戻し時の損切り(空売りの場合)専用								
<input type="checkbox"/> 17.ロスカット①		過去××日間で最も高い終値を上回った						
<input type="checkbox"/> 18.ロスカット②		仕掛け値より××円「終値が」上がった						
<input type="checkbox"/> 19.ロスカット③		仕掛け値の××%「終値が」上がった						
<input type="checkbox"/> 20.JP分析シート		~			[1]日足 [2]週足 [3]月足			シート編集
買い戻し時の利食い(空売りの場合)専用								
<input type="checkbox"/> 21.利食い①(円)		仕掛け値より××円(安値)下降した						
<input type="checkbox"/> 22.利食い②(%)		仕掛け値の××%(安値)下降した						

例えば以下のようにセットした場合、カイリの項目しか調べません。相対力指数、ハイローバンドの項目に数値が入っていますが、これらは無視されます。

投資シミュレーション(買い条件設定)

書込 閉じる

買い条件設定

	周期1	周期2	以上	以下	向き	××日前	以上	以下
<input type="checkbox"/> 1.相対力指数	14		0	20	3			
<input type="checkbox"/> 2.サイコシカ								
<input type="checkbox"/> 3.VR1								
<input type="checkbox"/> 4.VR2								
<input type="checkbox"/> 5.順位相関								
<input type="checkbox"/> 6.STC								
<input checked="" type="checkbox"/> 7.カイリ	20			-10				
<input type="checkbox"/> 8.Sカイリ								
<input type="checkbox"/> 9.コストカイリ								
<input type="checkbox"/> 10.Sコストカイリ								
<input type="checkbox"/> 11.株価弾性値								
<input type="checkbox"/> 12.出来高倍率								
<input type="checkbox"/> 13.株価位置								
<input type="checkbox"/> 14.RJ指数								
<input type="checkbox"/> 15.新値3本足		[1]陽転 [2]陰転						
<input type="checkbox"/> 16.ハイローバンド	3	1	向き [1]買転換 [3]売転換 [4]買場 [5]売場					

買い戻し時の損切り(空売りの場合)専用

17.ロスカット① 過去××日間で最も高い終値を上回った

18.ロスカット② 仕掛け値より××円「終値が」上がった

19.ロスカット③ 仕掛け値の××%「終値が」上がった

20.JP分析シート ~ [1]日足 [2]週足 [3]月足 シート編集

買い戻し時の利食い(空売りの場合)専用

21.利食い①(円) 仕掛け値より××円(安値)下降した

22.利食い②(%) 仕掛け値の××%(安値)下降した

もし、相対力指数の項目、ハイローバンドの項目にチェックが入っていたら、カイリと合わせて3つの指標に合格すると「買い」OKとなります。3つの条件はAND条件です。3つとも満たしていないと、合格とはなりません。

例えば、カイリとハイローバンドだけ合格、相対力指数は不合格となった場合は、買いとはなりません。

次に手仕舞いの条件である売りの条件を決めます。

売り条件設定

今回は手仕舞い条件となります。
空売りの場合は、仕掛けの条件です。

以下のようにセットしました。
相対力指数が50ポイント以上で手仕舞い、
または、10%下がったらロスカット、または、+10%で利益確定手仕舞いです。

投資シミュレーション(売り条件設定)		書込	閉じる						
売り条件設定		周期1	周期2	以上	以下	向き	××日前	以上	以下
<input checked="" type="checkbox"/>	1.相対力指数	14		50	100				
<input type="checkbox"/>	2.サイロシカル								
<input type="checkbox"/>	3.VR1								
<input type="checkbox"/>	4.VR2								
<input type="checkbox"/>	5.順位相関								
<input type="checkbox"/>	6.STC								
<input type="checkbox"/>	7.カイリ								
<input type="checkbox"/>	8.Sカイリ								
<input type="checkbox"/>	9.コストカイリ								
<input type="checkbox"/>	10.Sコストカイリ								
<input type="checkbox"/>	11.株価弾性値								
<input type="checkbox"/>	12.出来高倍率								
<input type="checkbox"/>	13.株価位置								
<input type="checkbox"/>	14.RJ指数								
<input type="checkbox"/>	15.新値3本足		[1]陽転 [2]陰転						
<input type="checkbox"/>	16.ハイローバンド			向き	[1]買転換 [3]売転換 [4]買場 [5]売場				
売却時の損切り(買いの場合)専用									
<input type="checkbox"/>	17.ロスカット①		過去××日間で最も安い終値を下回った						
<input type="checkbox"/>	18.ロスカット②		仕掛け値より××円「終値が」下がった						
<input checked="" type="checkbox"/>	19.ロスカット③	10	仕掛け値の××%「終値が」下がった						
<input type="checkbox"/>	20.JP分析シート		~			[1]日足 [2]週足 [3]月足			シート編集
売却時の利食い(買いの場合)専用									
<input type="checkbox"/>	21.利食い①(円)		仕掛け値より××円(高値)上昇した						
<input checked="" type="checkbox"/>	22.利食い②(%)	10	仕掛け値の××%(高値)上昇した						

もし、手仕舞いの条件を相対力指数50ポイント以上のみとした場合、仕掛けの条件は20ポイント以下でV字ですから、50ポイントに来ないで、さらに下がっていった場合、「手仕舞い出来ない」となってしまいます。そこでロスカットの項目を使います。

相対力指数の条件、ロスカットの条件、利食いの条件は、いずれか1つに合格するとその時点で売り(今回は手仕舞い)となります。OR条件です。

以上が出来たら、次はシミュレーションをしてみましょう。

シミュレーション実行

ここではまず、どの銘柄群についてシミュレーションをするのかを決めます。

そのためあらかじめユーザー銘柄管理へシミュレーションしたい銘柄群をセットしておく必要があります。

銘柄が少ない場合は、手入力でも構いませんが、調べる銘柄が多い場合はそれも大変です。

今回は、貸借銘柄のうち、50円以上の銘柄についてのみシミュレーションしたいと思います。(5/8時点)

絞り込み検索を使えば、簡単にユーザー銘柄管理へとセット出来ます。

わたしはユーザー銘柄管理の511番シートへ上述の銘柄群をセットしましたのでそれを入力しました。

その他の選択項目は「日足シミュレーション」を選択し、「買いから入る」を選択します。

ここまで出来たら実行をクリックします。

投資シミュレーション実行

実行 中止

ユーザー銘柄管理

開始日付 終了日付

20080526 20090428
20080527 20090430
20080528 20090501
20080529 20090507
20080530 20090508

シミュレーション種別

日足シミュレーション
 週足シミュレーション
 月足シミュレーション

シミュレーション種別

買いから入る
 空売りから入る
 買→売ドテンする
 売→買ドテンする

ユーザー銘柄管理の倍率(単位)について

無視(通常設定) 反映させる

511 シミュレーションするユーザー銘柄シート番号

銘柄がクルクルとまわりだし、シミュレーションがスタートします。

最後までくると、この画面は消え検索結果が表示されます。

シミュレーション結果

投資シミュレーション結果									
<input checked="" type="radio"/> 日足結果 <input type="radio"/> 週足結果 <input type="radio"/> 月足結果 <input type="button" value="読込"/> <input type="button" value="印刷"/> <input type="button" value="終了"/>									
N o.	コード	銘柄名	買サイン日	翌日寄り	売サイン日	翌日寄付	売買損益	小計	総合計
5772	9987	スズケン	2009/01/23	2225					
5773	9987	スズケン			2009/01/30+	2295	70	70	
5774	9989	サンドラッ	2009/01/21	2075					
5775	9989	サンドラッ			2009/02/09X	1860	-215	-215	
5776	9989	サンドラッ	2009/03/12	1330					
5777	9989	サンドラッ			2009/03/17+	1509	179	-36	
5778	9991	ジェコス	2008/10/07	316					
5779	9991	ジェコス			2008/10/14+	348	32	32	
5780	9997	ペルーナ	2008/06/26	700					
5781	9997	ペルーナ			2008/07/09X	509	-191	-191	
5782	9997	ペルーナ	2008/07/16	421					
5783	9997	ペルーナ			2008/07/17+	444	23	-168	
5784	9997	ペルーナ	2008/07/23	465					
5785	9997	ペルーナ			2008/08/01	462	-3	-171	
5786	9997	ペルーナ	2008/12/03	216					
5787	9997	ペルーナ			2008/12/09+	249	33	-138	
5788									-27115

ここに注目してみます、この意味は、

08年12月3日に買いサインが表示、翌日寄り付き216円で仕掛け、次の行、08年12月9日に「利食い条件」の売りサインに合格、翌日寄り付き249円で手仕舞い。結果33円の利益という意味です。

続いて売りサイン日、今回は手仕舞いですが、この日付に注目してみます。

日付に+が付いていると利食いの条件に合致して手仕舞った

日付にXが付いているとロスカットの条件に合致して手仕舞った

日付のみは、セットしたテクニカル指標の通りになったので手仕舞ったとなります。

今回は相対力指数50ポイント以上です。

テクニカル指標の手仕舞い、ロスカットの手仕舞い、利食いの手仕舞い、のうち一番早いタイミングで表示されたら手仕舞いです。

また仕掛けは、翌日寄り付き、手仕舞いも翌日寄り付きです。

サインが表示されたら、その翌日で仕掛け(手仕舞い)となります。

システムトレードという手法がさかんにもてはやされていますが、皆さまもご承知の通り手仕舞いは難しいです。なかなか思ったように手仕舞えないのが実際ではないでしょうか。

この機能を使うと、いかにシステムトレードで利益を上げるのが難しいかが分かります。

色々テクニカル指標を使いお試し下さい。特に手仕舞い条件について考察されてください。

尚、今回解説しました投資シミュレーションにつきましては、ホームページの

ソフト利用事例集 第4回、第30回

<http://www.neuralnet.co.jp/howjp/index.html>

勉強会の資料

<http://www.neuralnet.co.jp/user/benkyou.html>

にも解説が載っておりますので、ご覧下さい。