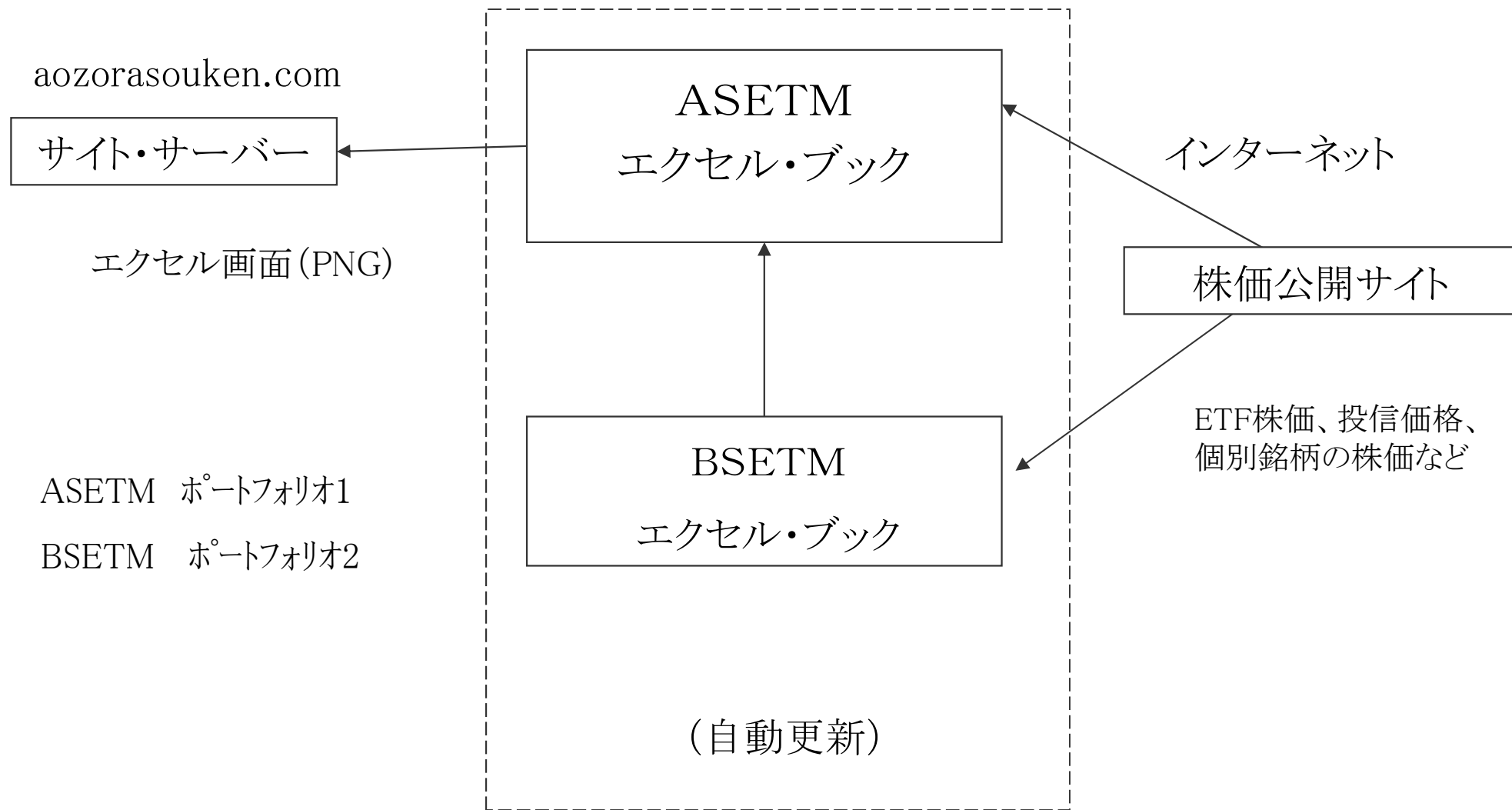


解説

2023年10月 改訂

システム構成



概要

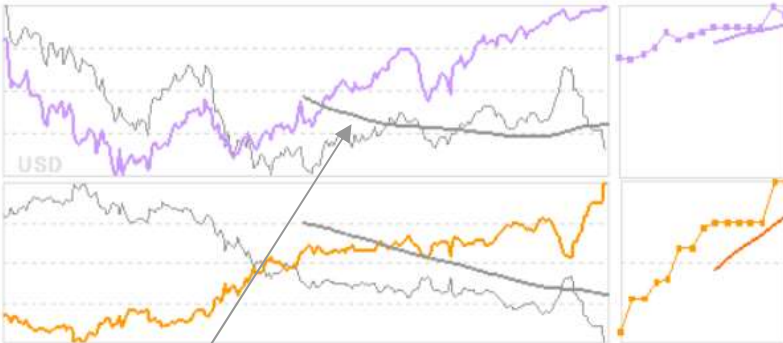
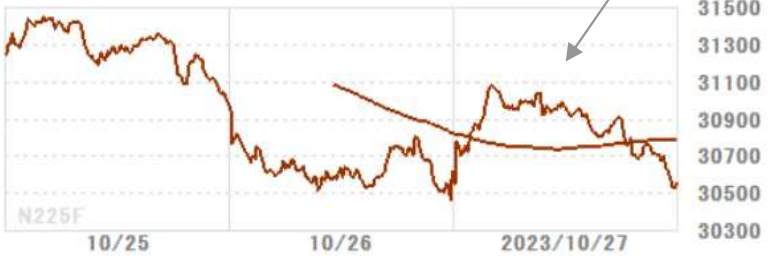
相場の予測とは。明日の日経平均のプラス・マイナスを毎日予想してもあまり意味がない
というか当たらない。定期的買いか売りかの判定を行い、それに沿って売買していれば
1年後には安定的に収益が得られる。そういうものが理想的である。当サイトは元々日
経平均の価格を予測する目的で始めた。しかし結果的には、複数の銘柄でポートフォリ
オを構成し、そのポートフォリオを維持しつつ長期的に安定した利益を追求するものとな
っている。構成する銘柄はインデックス連動のETFや投信、大型の個別株式、金や銀の
ETF、仮想通貨(ビットコイン、イーサリアム)と幅広く採用している。売買の戦略はトレ
ンド・フォローを基本に半年から1年程度の安値(高値)のタイミングで部分的に買う(売
る)ロジックを組み合わせている。短期的なノイズに惑わされないようにする。売買回数を
少なくする。このため、比較的長いテクニカル指標を使い売買は基本的に金曜日のみと
している。売買は時間分散で数回に分ける。ファンダメンタル面は銘柄の選定と資金配
分の増減で対応する。採用する銘柄は少なくとも価格が右肩下がりでないことが条件で
ある。全て買いポジションである。過去5~10年の月足チャートを見て上昇傾向であれば
よい。この条件から外れた場合は、資金配分を少なくするか、銘柄そのものを別のものに
交替する。運用の考え方としては、ポートフォリオ維持に留意しつつ、高値のタイミン
グで部分的に売却、安値のタイミングで購入を行う。プログラムのロジックに従った買
売を毎回行う必要は必ずしもないが、本システムから大きくカイリしないようにする。
「円」という通貨も銘柄のひとつであり、金建て価格で長期の推移をみると右肩下
がりである。相場は将来どうなるかは分からない。各銘柄のサイズは、最低でも
ゼロにしないで少し保有するようにする。ポートフォリオを維持する。そのほうが
より堅牢であろうと思われる。

テキスト
メッセージ

日経平均先物
グラフ(3日間)

損益経過

2023/10/28 3:00 n225f = 30560 L20:00
sim 51+73 ↓ 54+29 ↓ 18+25 ↓ 0+0 | 73+2 ↓ 24+12 ↓ _10/27
sim0 60+74 ↓ 53+39 ↓ 36+25 ↓ 38+14 ↑ 71+5 ↓ 24+19 ↓ _10/27
sync ssssss_10/27
bt 1545 1671 1321 1542 1540
0.677 15.8 62.1 0.0 89.9 60.2
0.000 0.0 0.0 0.0 33.3 0.0



ドル円
(過去1年)

銘柄チャート
(過去1年)

ポートフォリオ
保有割合

損益合計
経過

テキストメッセージ

現在の日付・時刻
日経平均先物

シミュレーション
計算

最終更新の時刻

シミュレーション計算

```
2023/10/28 3:00 n225f = 30560 L20:00
sim 51+73 ↓ 54+29 ↓ 18+25 ↓ 0+0 | 73+2 ↓ 24+12 ↓ _10/27
sim0 60+74 ↓ 53+39 ↓ 36+25 ↓ 38+14 ↑ 71+5 ↓ 24+19 ↓ _10/27
sync ssssss_10/27
bt      1545      1671      1321      1542      1540
0.677   15.8     62.1     0.0       89.9     60.2
0.000   0.0       0.0     0.0       33.3     0.0
```

シミュレーション計算
との比較(差)

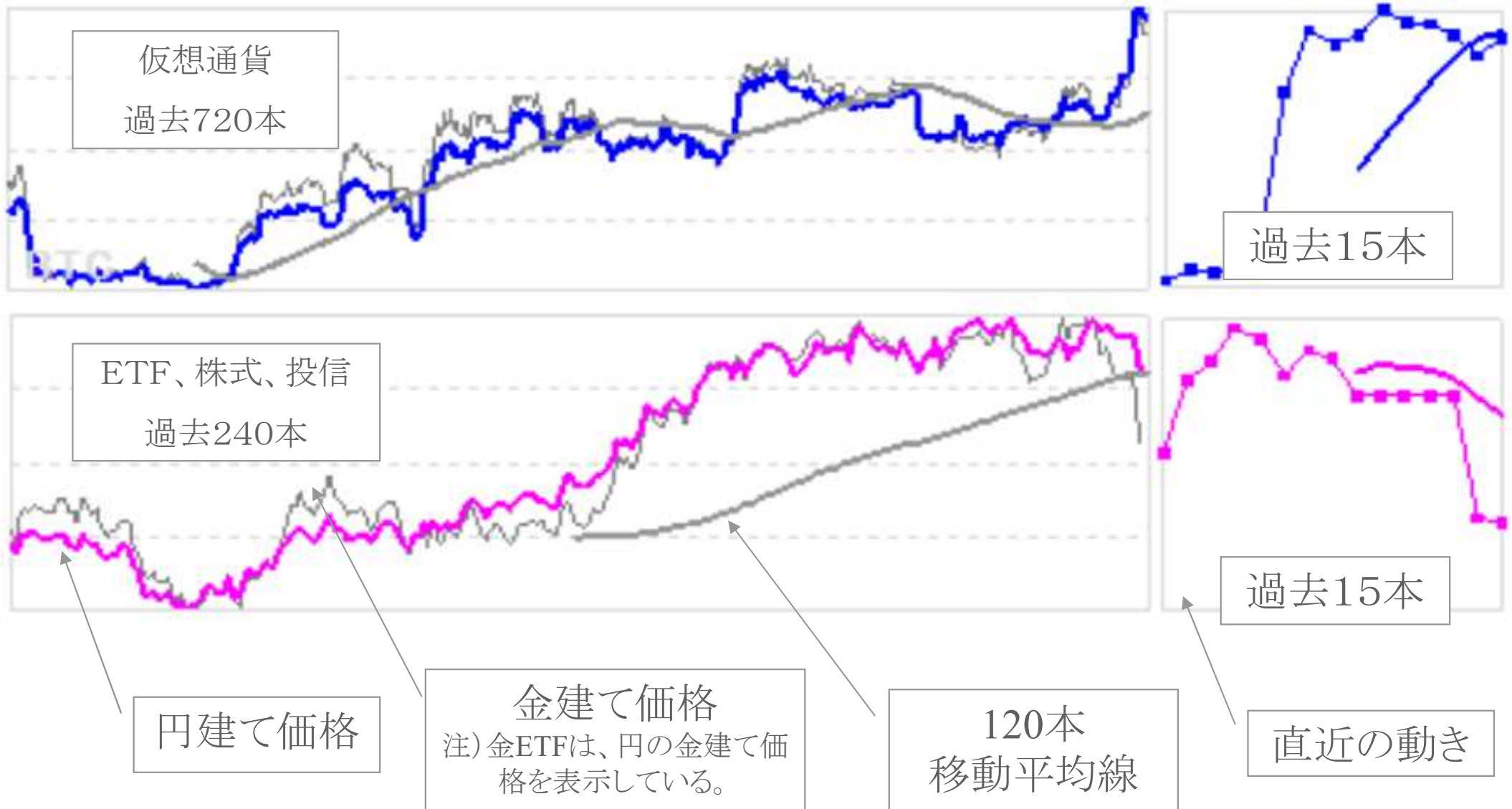
銘柄コード
(株式4桁、投信8桁)

売買サイズ
(株式:株数、投信:円)

MACDをベースに月足レベルの日数を設定して、ヒストグラムの山・谷の変化をみる。

価格グラフ

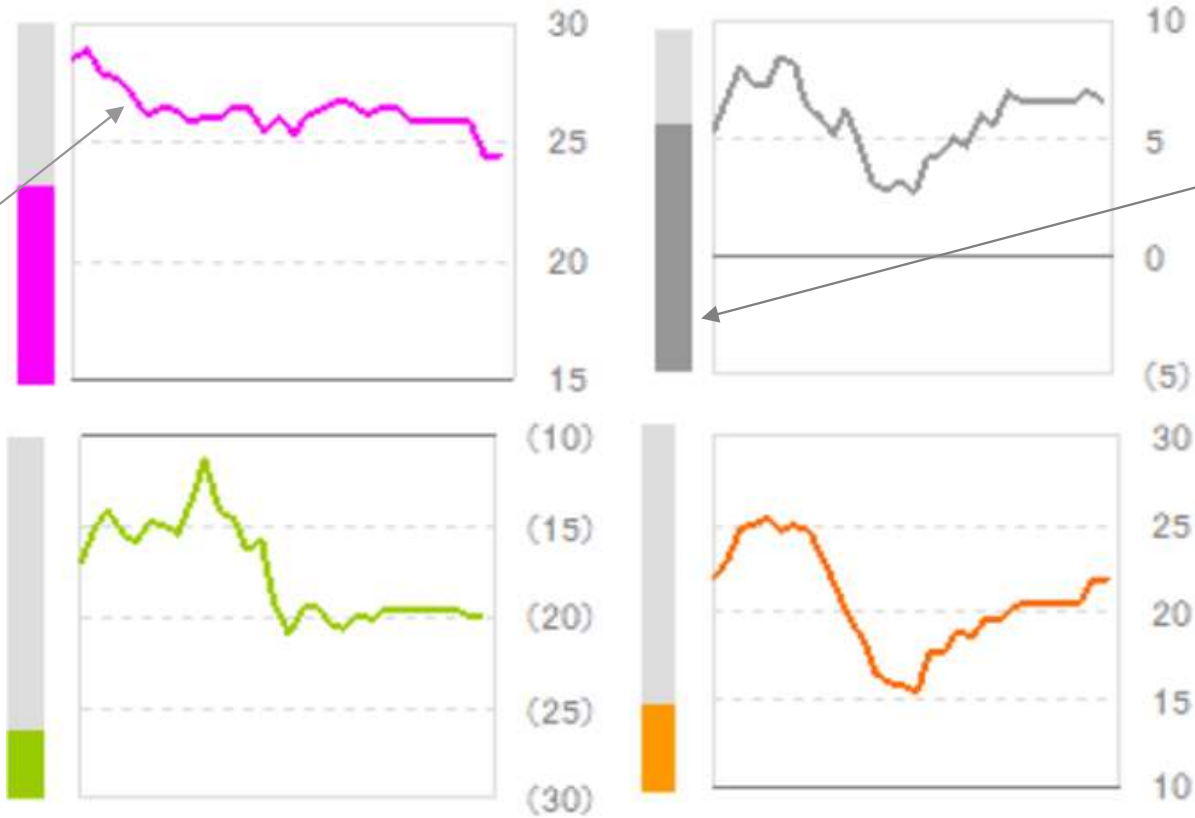
1日2回グラフを更新。10時40分、14時10分。(仮想通貨は8時と20時)



ETFや株式の1本は1営業日。仮想通貨の1本は12時間(休日含む)。

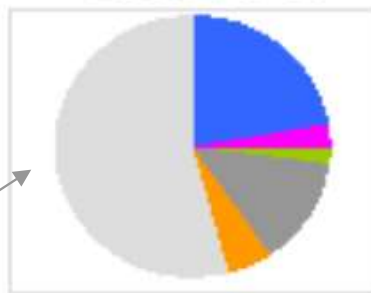
損益経過

損益経過
30日間



その銘柄の
保有簿価と
余力の割合

2023/10/27



ポートフォリオの
保有簿価と余力



損益合計
30日間

売買手数料などの経費は
考慮されていない。

< 詳細説明 >

- ・プログラムの判定は毎週金曜日のみ。金曜日の10時40分に一旦仮判定される。14時10分に最終判定される。仮想通貨(BTCとETH)は20時の価格更新時に判定される。サイズは株式では株数、投信では金額(時価)、仮想通貨はその通貨単位で表示される。単元株は考慮されていない。
- ・ドル円(USD)のグラフは過去240本(約1年)を示す。ETFなども過去240本(約1年)。仮想通貨は1日2回(休日含む)価格を取得する。720本で過去約1年の値動きを示す。
- ・保有サイズの上限は各銘柄毎に異なる。このため棒グラフが同じパーセントでも簿価の金額は異なる。各銘柄の保有割合(簿価)をみるには円グラフをみる。
- ・各銘柄の資金配分を裁量で変更したり、別枠で保有している同じ銘柄をポートフォリオに追加したりした場合、棒グラフや損益経過グラフが変動する。1回あたりの金額%をゼロとすると、買いも売りもしない設定となり、バイアンドホールドの状態になる。
- ・資金管理。売却損益がプラスの場合は、20%を税金などへの引当てとして残りを資金に加算する。損の場合は資金がその分減少する。
- ・売買シミュレーション計算の表示。simは各銘柄の保有割合%と評価損益%を表示。例えば、51+73は保有簿価51%(余力49%)、評価損益が現在プラス73%という意味である。
- ・途中で売買シミュレーションの設定を変更したり銘柄を入れ替えても、それまでに確定した損益は継続する。損益経過のグラフは連続している。
- ・sim0は、設定の見直し時に今までの確定損益をゼロリセットして再計算した結果を示す。syncは、現在の価格と売買シミュレーションの購入平均簿価を比較する。現在の価格がsimとsim0のいずれの平均購入簿価よりも安い場合はb、高い場合はs、それ以外はnとする。保有なしの場合、sim0と現在の価格を比較する。銘柄順に並べて表示。実際の平均簿価がsim0からカイリしているときは、bで少し買い、sで少し売却することでsim0の平均簿価に近づけることができる。

<投資に関する思想>

孫子曰、昔之善戦者、先為不可勝、以待敵之可勝、不可勝在己、可勝在敵、故善戦者、能為不可勝、不能使敵之可勝、故曰、勝可知、而不可為

孫子いわく。昔の善く戦う者は、先ず勝つべからざるをなして、もって敵の勝つべきを待つ。勝つべからざるはおのれに在るも、勝つべきは敵に在り。故に善く戦う者は、よく勝つべからざるをなすも、敵をして勝つべからしむることあたわず。故に曰わく、勝は知るべし、しかしてなすべからずと。

昔の戦い上手な者は、まず自軍をしっかり守る。誰にも負けないような態勢を整える。その上で、敵が弱点を現すのを待つ。誰もが勝てるような状況待つ。誰にも負けない態勢を整えるのは味方のことであるが、だれもが勝てる態勢とは敵側のことである。いかに戦い上手な者でも、味方をだれにも負けない態勢にできるが、敵をだれもが勝てるような態勢にはできない。つまり、必ず勝利できるわけではない。 <https://news.mynavi.jp/article/sonshi-8/>

<解説>

テクニカル、ファンダメンタルいずれにせよ、そのロジック(アルゴリズム)に忠実に従って売買しさえすれば必ず相応の利益が保証されるというシステムは存在するであろうか。答えは「存在しない」が正しいと思う。株式投資とは市場(および自己)との戦いともいえる。古代中国の思想家の孫子のいうとおり、どんなに優れた者であっても戦いに必ず勝利できるとはいえない。理由は上記のとおり。すなわち、どんなに優れた者であってもできることは負けない態勢を整えるまでである。そのうえで市場が誰もが勝てる状況になるまで待つわけである。ロジックを複雑化すれば計算上は簡単にプラスにできるが、将来の再現性がなくなる。市場は複雑系である。常に変化している。売買のシステムはこれに追随できる単純なものでなければならない。そのうえで勝てる状況か否かは各自が裁量で判断することになる。機械的な売買のシステムは守りの基準と考える。これから大きくカイリしないようにする。

END