

Volume

2

シェバリー株式会社
さや取り達人プロジェクト



さや取り達人 超かたんたんマニュアル

さや取り達人
超かんたんマニュアル

改訂版 20230420

目次

1. さや取り達人の概要2
2. 仕掛けの手順.....8
3. 手仕舞いの手順14

このマニュアルでは、基本操作の説明をいたします。
動画でもご覧いただけます(You Tube)

https://youtu.be/xXJ5S_tFEmc



CHIVALRY

© シェバリー株式会社

愛知県名古屋市中村区名駅南 1-14-4F
電話 052-651-5709 ・ FAX 052-651-5707

1. さや取り達人の概要

さや取り達人を起動すると、銘柄ペアリスト画面と銘柄ペアグラフ画面が表示されます。起動した時点で、常に自動で最新のデータになっています。

1. 銘柄ペアリスト

この部分にはサヤ取りの対象となる、銘柄ペア(銘柄の組み合わせ)と銘柄ペアの情報が表示されます。表示サイズは変更可能です。

銘柄	銘柄名	業種	銘柄	銘柄名	業種	銘柄	銘柄名	業種	銘柄	銘柄名	業種	銘柄	銘柄名	業種	銘柄	銘柄名	業種
1	9433	9433	2413	2413
2
3
4
5
6
7
8
9
10
11
12
13
14
15
16
17
18
19
20
21
22
23
24
25
26
27
28
29
30

- ① 銘柄ペア
ペアリストの銘柄ペアをクリックすると、銘柄 A と銘柄 B のコード・銘柄名・株数が自動で表示されます。ペアの追加・削除もできます。

銘柄ペア

コード OR [A] [B]
銘柄名 9433 2413
株数 100 2

業種検索 [B]銘柄候補

ペア追加 ペア削除

- ② ペア編集
銘柄ペアを選択、編集ができます。「実行」をクリックすると銘柄ペアを各種条件で並べ替えることができ、銘柄ペアの選別や、仕掛けペアを探すときに利用します。

ペア編集

選択 全クリア 実行

選択数 3

ペア編集実行

- 印のペアを先頭へ移動する
- 印のペアを削除する
- 印のペアを新規ファイルで保存する
- 印のペアを別のファイルへ追加する
- [A]銘柄のコード順に並べ替える
- 仕掛け日の新しい順に並べ替える
- 損益の大きい順に並べ替える
- 仕掛けマークのペアを上へ移動する
- 相関係数の大きい順に並べ替える
- 相関係数平均の大きい順に並べ替える
- 最大利回りマークのペアを上へ移動する

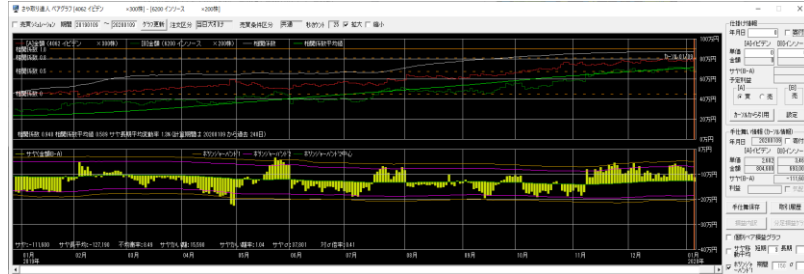
サヤ平均変動率の小さい順に並べ替える
勝ち数の大きい順に並べ替える
負け数の大きい順に並べ替える
利益の大きい順に並べ替える
損の大きい順に並べ替える
不均等率の小さい順に並べ替える
サヤかみ、残の大きい順に並べ替える
サヤかみ、残率の大きい順に並べ替える
サヤσの大きい順に並べ替える
付σ倍率の大きい順に並べ替える

キャンセル

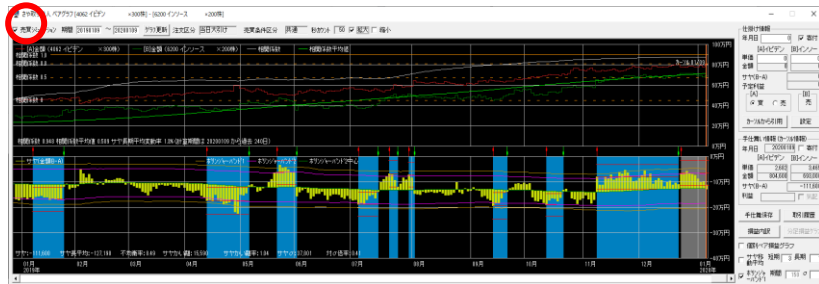
2. 銘柄ペアグラフ

銘柄ペアのサヤの変化状況を常に監視し、仕掛けまたは手仕舞いのタイミングを検討することができます。

ペアリストの銘柄ペアをクリックすると、売買金額チャート(上段)とサヤチャート(下段)が表示されます。



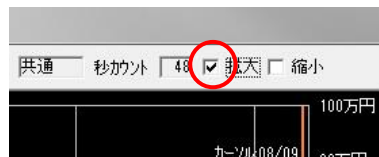
売買シミュレーションにチェックマークを入れると、1年間の売買シミュレーション(模擬取引)が表示されます。



表示可能なデータの期間は4年間です。

取引時間中は、リアルタイム株価データを自動で取得しています。

ペアグラフの拡大、縮小ができます。チェックを外すと標準表示になります。



- ① 売買金額チャート(上段)
 - ・銘柄Aの売買金額チャート(単価×株数)・・・赤色
 - ・銘柄Bの売買金額チャート(単価×株数)・・・緑色
- ② サヤチャート(下段)
 - ・サヤの長期移動平均線(サヤの平均値)・・・緑色
 - ・サヤのかい離(平均から離れること)グラフ・・・黄色
 - ・サヤボリンジャーバンド・・・ピンク色
 - ・カーソル・・・オレンジ色又は赤色

サヤチャートの見方

黄色の棒グラフがサヤの長期移動平均線(緑色)を挟んで、山または谷に伸びている時にサヤが拡大している状態です。(サヤの平

均値からのかい離を表しています)山と谷の違いは、仕掛け時の売り
りと買いが逆になるだけです。
サヤが拡大したところで仕掛け、平均値付近に戻ったところで手仕
舞いします。(サヤの縮小で利益を上げます)
サヤチャートは一日単位で、取引終了後は終値の状態です。

- ③ 相関係数が表示されます。
相関係数は、2銘柄の類似性の度合いを示しています。1に近いほど相関
が高い)
- ④ 売買シミュレーション時の取引マークが表示されます。
 - ・赤マーク……仕掛け位置を示しています。
 - ・緑マーク……手仕舞い位置を示しています。

取引マークの初期設定

▼仕掛けマーク

サヤチャートのサヤボリンジャーバンド 1.5σ (ピンク色の線)の外
に出たら表示されます。

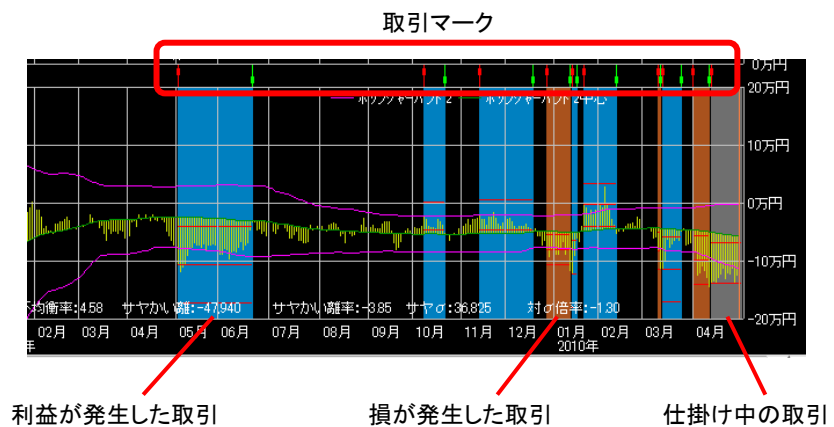
▼手仕舞いマーク

利食い……予定利益の 80%のプラスで表示されます。

損切り……予定利益の 80%のマイナスで表示されます。

手仕舞い期限(無条件で手仕舞いする期限)……仕掛け日から 30
日で表示されます。

- ⑤ 取引マークの下の着色部分は、売買シミュレーション時の仕掛けから手
仕舞いまでの期間を示しています。損益の区別によって色が変わります。
 - ・青色……利益が発生した場合を示します。
 - ・オレンジ色……損が発生した場合を示します。
 - ・灰色……仕掛け途中で手仕舞いしていない場合を示します。



[ご注意]

取引マーク通り取引するわけではありません。実際の取引とは異なります。

売買シミュレーションは、一定金額以上サヤが開いたら仕掛け、サヤが閉じたら手仕舞うという取引方法で、過去の取引回数等を調べるものです。システムトレードのロジックとは異なり、サヤ取りに適した、ペアの選定を行うためのものです。

⑥ 仕掛け情報の表示

グラフ画面上でカーソルを任意の仕掛け日に合わせ「カーソルから引用」をクリックすると仕掛け年月日・単価・売買金額・サヤ・予定利益・売買区分が自動的に表示されます。



カーソル(仕掛け)
オレンジ色から赤色に変わります

⑦ 手仕舞い情報の表示

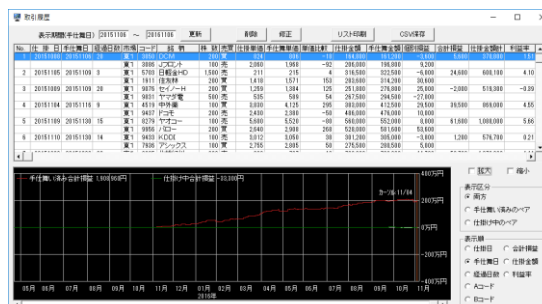
グラフ画面上の別のカーソルが指す位置の手仕舞い 年月日・単価・売買金額・サヤ・利益が表示されます。



カーソル(手仕舞い)
オレンジ色

⑧ 取引履歴

手仕舞い済みのペアと仕掛け中のペアが表示されます。



⑨ 分足損益グラフ

仕掛け情報が設定されていると分足で損益を確認することができます。

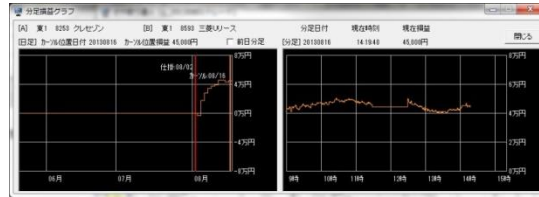


図 1-10

⑩ ボリンジャーバンド 1

任意で設定した期間・ σ のサヤボリンジャーバンドが表示されます。

例えば、期間 150・ σ 2 に設定し、チェックマークを入れると、サヤチャートに 2σ のラインが追加表示されますので参考にしてください。

⑪ 相関係数グラフ

メニューの「グラフ表示」から「相関係数グラフ表示する」をクリックすると相関係数のグラフが表示されます。相関係数の時系列的な変化を把握することができます。

3. グラフ画面の表示項目

それぞれの値はグラフのカーソルが指している日付における値を表示します。

① 相関係数

相関係数は、2つのデータ列間の類似性の度合いを示します。変動範囲は $-1 \sim 1$ です。1に近いほど相関が高いと言えます。相関係数が、0.8以上となる銘柄の組み合わせがサヤ取りに適しています。

② 相関係数平均値

計算期間の相関係数の平均です。この値が高いほど、長期に渡り相関が高いと言えます。

③ サヤ長期移動平均変動率

サヤ長期移動平均はなるべく一定が望ましく、グラフで言えば直線かつ水平に近い方が良い。サヤ長期移動平均変動率 5%以下が望ましいです。

④ サヤ

2銘柄の金額(株価×株数)の価格差です。

⑤ サヤ長期移動平均

ある期間のサヤの中心値、つまりサヤの縮小位置と考えます。

⑥ 不均衡率

不均衡率は、A銘柄とB銘柄の取引金額(平均値)の不釣り合いの度合いを示しています。不均衡率は 10%以下が望ましいです。

- ⑦ サヤかい離
サヤかい離は、サヤがサヤの平均値からどれだけ離れているかの値を示しています。サヤかい離の絶対値は予定利益と同じ値になります。
- ⑧ サヤかい離率
サヤかい離率は投資金額に対するサヤかい離の割合です。この値を絶対値で見ると予定利益率になります。
- ⑨ サヤ σ
サヤ σ (サヤシグマ)とはサヤの標準偏差です。サヤの変動の広がり程度を表しています。
- ⑩ 対 σ 倍率
サヤ σ に対するサヤかい離の割合を示しています。この値が高いほどサヤの拡大が大きい事示しています。

チャプター
2

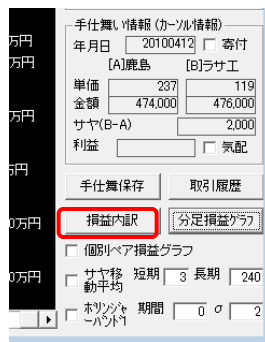
2. 仕掛けの手順

仕掛けルールを決めて実行します。サヤチャートを順番に確認して、サヤがかい離をして仕掛けのタイミングにあるペアを選定します。

1. 仕掛けペアの選定

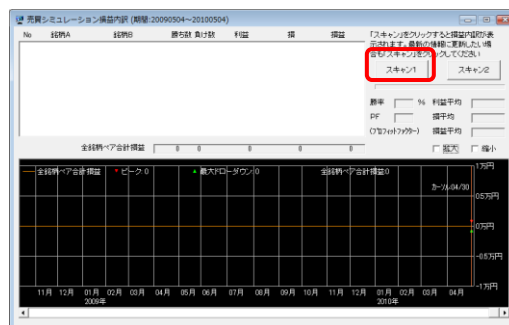
ペア編集機能を使えば、効率よく仕掛けペアを探すことができます。ここでは、ペア編集の過去最大のサヤかい離になったペアから仕掛けるペアを選定します。手順は以下の通りです。

1. 「損益内訳」ボタンをクリックしてください。



※売買シミュレーションにチェックが入っていないと操作できませんのでご注意ください。

2. 「売買シミュレーション損益内訳」画面が表示されますので「スキャン1」をクリックしてください。



3. 「スキャン1」が終了すると、最新のデータに更新されます。

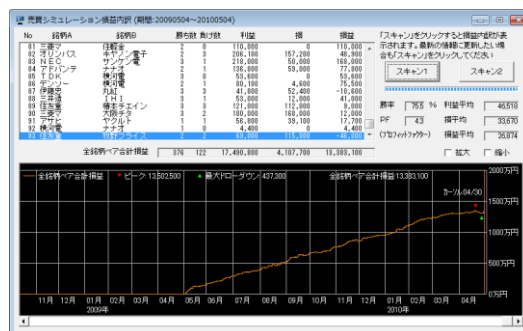
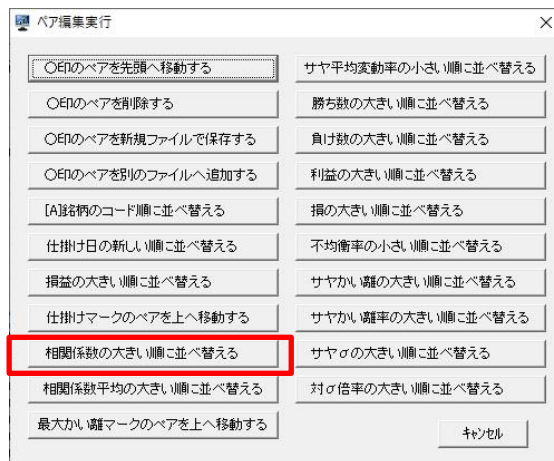


図 2-3

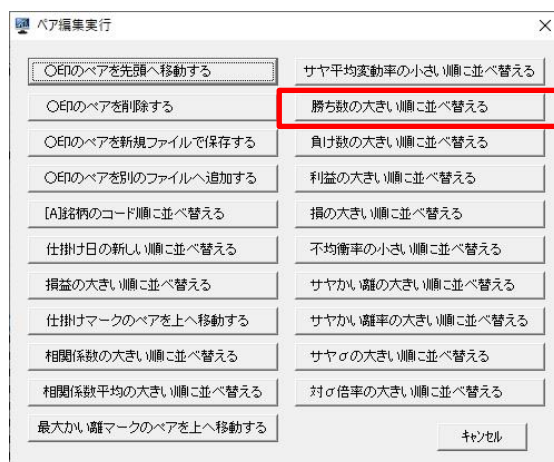
4. ペアリストのペア編集「実行」をクリックしてください。



5. ペア編集実行画面から「相関係数の大きい順に並べ替える」をクリックして「OK」を押してください。

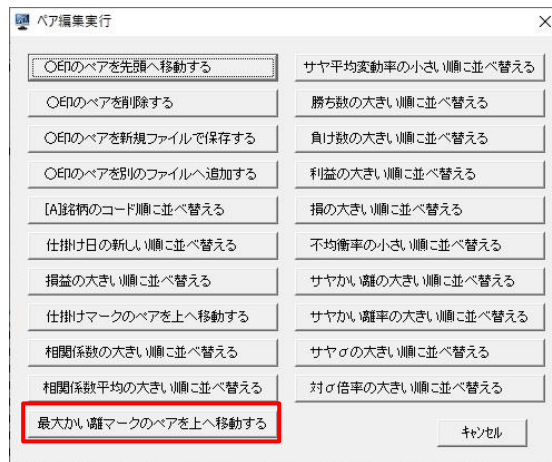


6. ペア編集実行画面から「勝ち数の大きい順に並べ替える」をクリックして「OK」を押してください。



過去一年間の売買シミュレーションで勝数の大きい順で、かつ相関係数の大きい順に並びます。

7. ペア編集実行画面から「最大サヤかい離マークのペアを上へ移動する」をクリックして「OK」を押してください。



8. ペアリストの上段に最大サヤかい離マーク(緑色)の付いたペアが移動しますので、サヤチャートを確認して、ルールに則り仕掛けペアを選定してください。

※ペア編集の「選択」をクリックするとペアリストの選択項目に○印が表示されますので仕掛け候補等の目印にご利用ください。

ワンポイント(仕掛けルール 1)

できるだけ相関係数が高く、売買シミュレーションの成績(勝数)が良いペアを選んでください。

※資金量・戦略・方針・性格等を考慮して、自己売買ルールを確立してください。

相関係数は、2銘柄の類似性の度合いを示します。1に近いほど株価の連動性が高いと言えます。

勝ち数の多いペアは、サヤの開閉が頻繁にあり短期で利益を取りやすい傾向にあります。

ワンポイント(仕掛けルール 2)

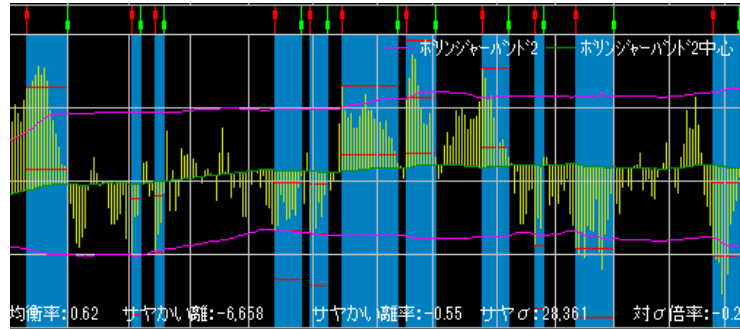
サヤが短期で開閉している動きの良いペアを選んでください。サヤ取りで一番重要なのは、サヤに一定のリズムがあることです。サヤチャートの綺麗なペアを優先してください。

サヤの形も重要です。

・サヤの山と谷がなるべく規則的に複数存在すること。(サヤの開閉が頻繁にあり周期がある)

- ・サヤの山と谷がなるべく揃っていること(サヤの不規則な変動が少ない)
- ・サヤが平均線を中心に上下変動を繰り返していること。
- ・サヤの平均線、ボリンジャーバンドが一定していること。

※下記は仕掛け条件を満たしたペアの一例です。



ワンポイント(仕掛けルール 3)

サヤチャートからサヤの動き(開閉周期と変動幅)を読み取り、仕掛けのタイミングを計ってください。

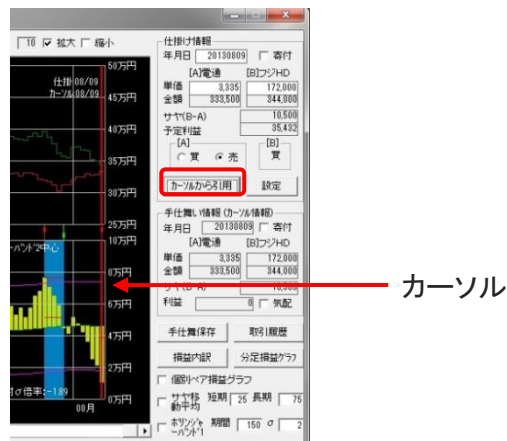
サヤσを考慮した最大のかい離(金額)で仕掛ける。

※仕掛けは、サヤが最も拡大したところで仕掛け、平均線で手仕舞いするのが理想ですが、コツとしては「仕掛けは、少し遅めに、手仕舞いは少し早め。」位が良いでしょう。

※仕掛けチャンスは沢山あります。余裕資金を持ち、エントリーのタイミングを待って、焦らず取り組んでください。

2. 仕掛け情報を確認する

ペアグラフのカーソルを仕掛け日(当日)にして「カーソルからの引用」をクリックするとそのペアの仕掛け情報(年月日・単価・金額・予定利益・売買区別)が自動的に表示されます。



※この時、売買シミュレーション損益内訳画面が表示されていると、下記のメッセージが表示されますので、一旦画面を閉じてください。



[ご注意]

スクロールバーの位置にご注意ください。最新の日付(当日)を表示する場合はノブが右端にあるのを確認してください。



※予定利益がマイナスで表示されていたら「A」、「B」銘柄の売り、買いが逆になっていますので「A」の[買]、[売]を反転させてください。

山でサヤが開いている場合は、「A」銘柄が買い、「B」銘柄が売りです。
谷でサヤが開いている場合は、「A」銘柄が売り、「B」銘柄が買いです。

3. 仕掛け注文

仕掛け情報を参考に証券会社に注文を入れます。

売りは「信用新規売り」で注文を出してください。
買いは「信用新規買い」または「現物買い」どちらでもかまいません。

注文は必ず「成行」で同時に注文してください。
期間は当日中、預り区分は特定預り、制度信用(6ヶ月)になります。

売りと買いを間違えないようにしてください。(必ずカーソルからの引用をクリックして確認してください)

[ご注意]

稀に信用売りできない銘柄がありますのでご注意ください。取引時間中は、念のため信用売りから先に注文を入れるようにしてください。

4. 仕掛け情報の保存

仕掛け情報を保存するには「設定」をクリックしてください。ペアリストに仕掛け日が記録されます。また、「取引履歴」にも保存されます。

翌日の寄り付きで注文する場合は、翌日サヤチャートが更新されてから仕掛け日を設定してください。

※仕掛け情報を削除したい場合は「仕掛け情報」の「年月日」に 0(または空欄)を入力して「設定」をクリックしてください。

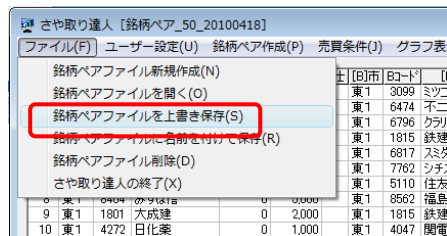
5. 仕掛け後の単価修正

注文単価と約定単価が違う場合は「単価 A」または「単価 B」に実際の約定単価を手動で入力して「設定」をクリックしてください。

寄り付きで仕掛けた場合は、仕掛け情報の「寄付」にチェックを入れ「カーソルからの引用」→「設定」をクリックすれば単価が自動的に入ります。終了したらチェックを外してください。

6. 銘柄ペアファイルを上書き保存する

取引を更新したら、銘柄ペアファイルを上書き保存をします。メニューの「ファイル」の「銘柄ペアファイルを上書き保存」をクリックしてください。



3. 手仕舞いの手順

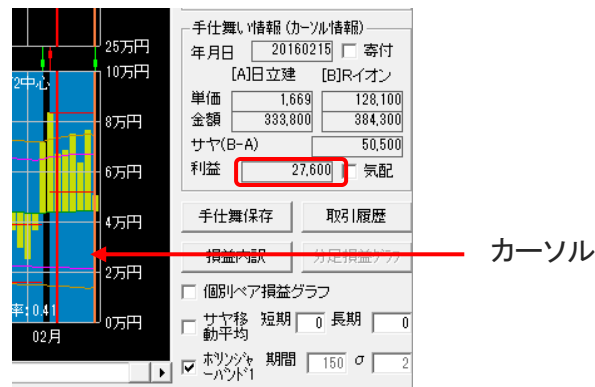
仕掛けペアのサヤの動きを観察し、手仕舞いルールに従い実行します。
手仕舞いには、利食い、損切り、手仕舞い期限の3種類があります。

1. サヤチャートを確認する

サヤグラフが縮小すると利益が出ます。

2. 手仕舞い情報を確認する

「手仕舞い情報」には現在の日付、単価、金額、サヤ、利益が表示されます。



※手仕舞い時の日付はグラフ画面のカーソルが指している情報です。通常はカーソルを当日に合わせた状態(右端)で表示してください。

ワンポイント(手仕舞いルール)

仕掛け時の予定利益に対して、下記を目安に実行してください。

- ・利食い・・・利益が予定利益のプラス 80%前後
- ・損切り・・・利益が予定利益のマイナス 80%前後
- ・手仕舞い期限・・・30 日前後

※資金量・戦略・方針・性格等を考慮して、自己売買ルールを確立してください。

3. 手仕舞い注文

手仕舞い情報を確認して証券会社に注文を入れます。

売建の銘柄は「信用返済買い」で決済してください。

買建または現買の銘柄は「信用返済売り」または「現物売り」で決済してください。

注文は必ず「成行」で同時に決済してください。

4. 手仕舞い情報の保存

注文が確定したら「手仕舞保存」をクリックしてください。

手仕舞い情報 (カーソル情報)			
年月日	20100426	<input type="checkbox"/> 寄付	
	[A]住友重	[B]伊藤忠	
単価	587	852	
金額	587,000	596,400	
サヤ(B-A)		9,400	
利益	64,800	<input type="checkbox"/> 気配	
手仕舞保存		取引履歴	
損益内訳		分足損益グラフ	

5. 手仕舞いの単価修正

[A]と[B]の手仕舞い単価の初期値が表示されます。

これらの初期値を実際の取引に合わせて修正して「OK」をクリックすると、手仕舞い情報がファイルに保存されると同時に仕掛け情報がクリアされます。

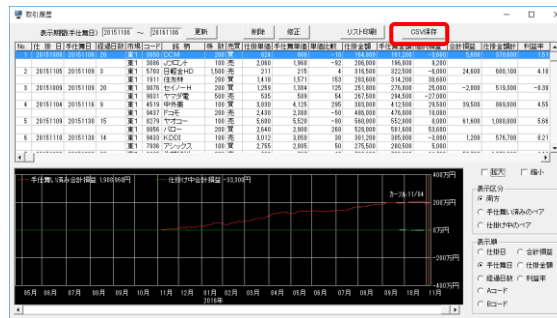
手仕舞い情報保存			
手仕舞い情報を保存します。			
手仕舞い日	20100426	手仕舞い単価	
[A]東 1 6302 住友重	×1000株 (買建)		587
[B]東 1 8001 伊藤忠	×700株 (売建)		852
OK		キャンセル	

寄り付きで決済した場合は、手仕舞い情報の「寄付」にチェックを入れ「手仕舞保存」をクリックすると単価が自動的に入ります。終了したらチェックを外してください。

手仕舞い情報 (カーソル情報)			
年月日	20100426	<input checked="" type="checkbox"/> 寄付	
	[A]住友重	[B]伊藤忠	
単価	587	852	
金額	587,000	596,400	
サヤ(B-A)		9,400	
利益	64,800	<input type="checkbox"/> 気配	
手仕舞保存		取引履歴	
損益内訳		分足損益グラフ	

6. 取引履歴を表示する

「取引履歴」をクリックすると、手仕舞い済みのペアと仕掛け中のペアが表示されます。



取引履歴は、CSV ファイルで出力できます。「CSV 保存」をクリックすると、下記のフォルダーに保存されます。スタートボタンからエクスプローラーをクリックして下記の順番で進んでください。

PC から OS(C:) → SayaProject → Statsujin → Rireki

※取引履歴を表示した時点でのデータになります。取引を更新したら、再度 CSV 保存をクリックしてください。

7. 銘柄ペアファイルを上書き保存する

取引を更新したら、銘柄ペアファイルを上書き保存をします。メニューの「ファイル」の「銘柄ペアファイルを上書き保存」をクリックしてください。

《アドバイス》

できるだけ相関係数が高く、売買シミュレーションの成績(勝数)が良いペアで、サヤが短期で開閉している動きの良いペアを選んでください。

仕掛けのタイミングは、サヤ σ を考慮した最大のかい離(金額)で仕掛けると有効です。

毎日サヤチャートをチェックして、トレードセンス(感覚)を磨いて下さい。

資金量・方針・性格等を考慮して、自己売買ルールを確立してください。

投資の掟を守る

▶売買ルールを守る

自分に合った売買ルールを決め、一貫して守る。

▶メンタルコントロールをする

感情(欲・恐怖・退屈等)はトレードの最大の敵です。平常心を保ちましょう。

▶資金管理をする

分散(銘柄・資金・時間)投資に心がける。利小損大にならないように注意してください。

仕掛けが早く、損切ができないと負けパターンになります。

「仕掛けは、少し遅めに、手仕舞いは少し早めに。」

仕掛けチャンスは沢山あります。余裕資金を持ち、エントリーのタイミングを待って、焦らず取り組んでください。

[▲目次に戻る](#)