

② ペア編集

銘柄ペアを選択、編集することができます。

「選択」をクリックすると、銘柄ペアリストの選択欄に「○」がつきます。



「実行」をクリックすると下記の画面が表示されます。

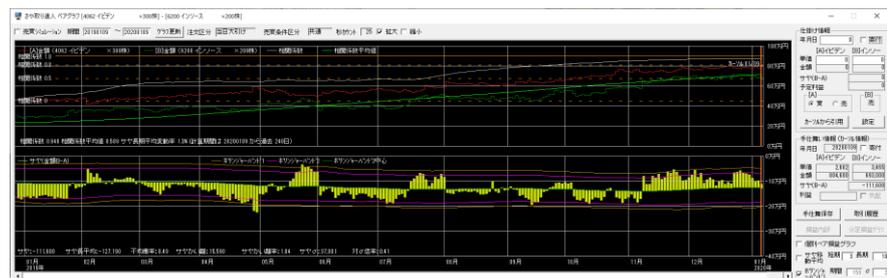
銘柄ペアを各種条件で並べ替えることができ、銘柄ペアの選別や、仕掛けペアを探すときに利用します。



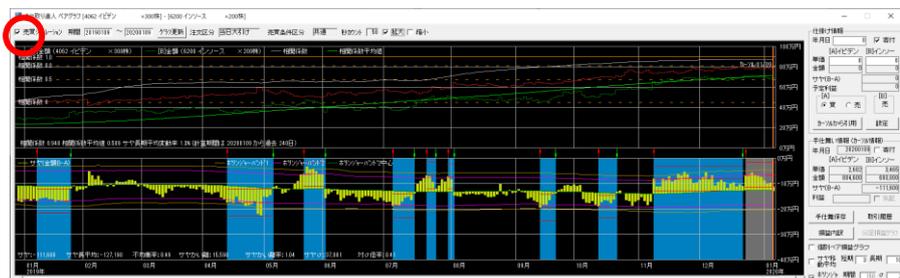
2. 銘柄ペアグラフ

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。

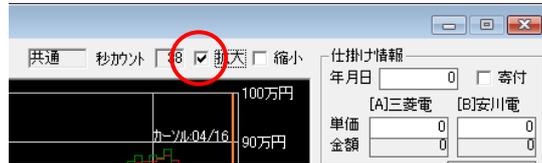


売買シミュレーションにチェックマークを入れると、1年間の売買シミュレーション(模擬取引)が表示されます。



サヤチャートは毎日 9:00 に更新されます。株価データは、過去 4 年間と取引時間中のリアルタイム株価データを自動で取得します。

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

サヤの平均値からのかい離(離れること)を表しています。黄色の棒グラフがサヤの長期移動平均線(緑線)を挟んで、山または谷に伸びている時がサヤの拡大している状態です。山と谷の違いは、仕掛け時の売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

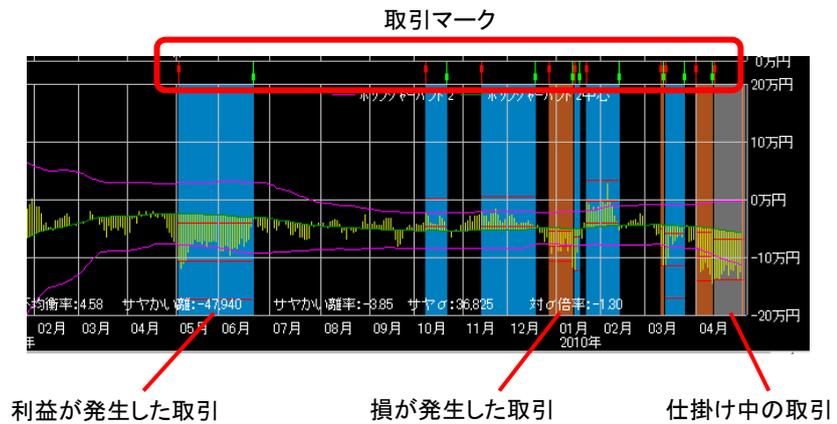
サヤチャートのサヤボリンジャーバンド 1.5σ (ピンク色の線)の外に出たら表示されます。

▼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。



※売買シミュレーションは模擬取引です。実際の取引とは異なる場合がありますので、あくまでも参考程度に留めてください。

⑥ 仕掛け情報の表示

グラフ画面上でカーソルを仕掛け日に合わせ「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。

仕掛け情報を保存しておきたい場合は「設定」をクリックしてください。銘柄ペアリストに仕掛け情報が保存されます。

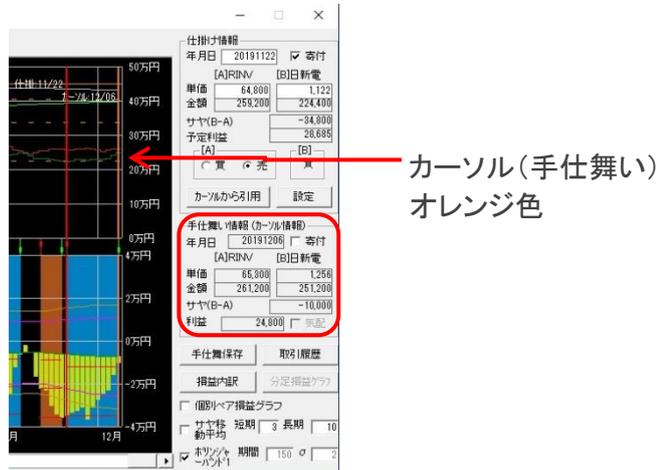


カーソル(仕掛け)
 オレンジ色から赤色に代わります

⑦ 手仕舞い情報の表示

グラフ画面上的の日付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。

仕掛け情報が設定されていると、日付カーソルを当日に合わせ最新の損益情報がリアルタイムに表示されます。



カーソル(手仕舞い) オレンジ色

※仕掛け情報・手仕舞い情報の用途は下記の2通りの目的があります。

- 実際に仕掛けた場合の記録とする。
- 過去のデータを用いて利益を試算する。

⑧ 手仕舞い保存

仕掛け情報が設定されていると、「手仕舞い保存」をクリックすると、手仕舞い日[A]と[B]の手仕舞い単価の初期値が表示されます。

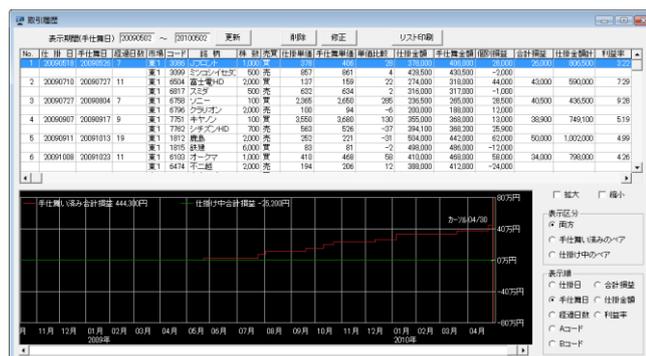


これらの初期値を実際の取引に合わせて修正して「OK」をクリックすると、手仕舞い情報がファイルに保存されると同時に仕掛け情報がクリアされます。

⑨ 取引履歴

表示期間の取引履歴の詳細と損益グラフを表示します。

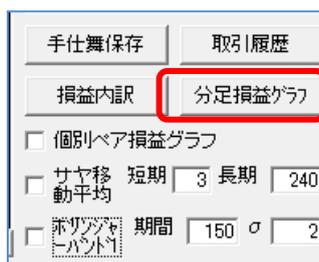
※取引履歴は手数料等の経費は考慮していません。



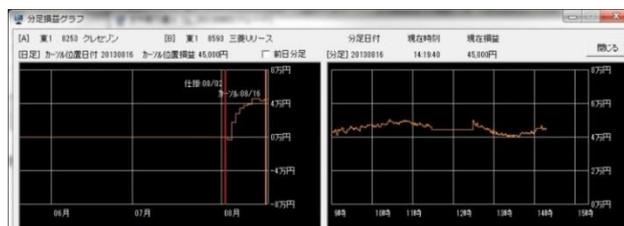
手仕舞い済み損益グラフは、確定損益の合計の変動を表します。現在仕掛け中の損益グラフは、評価損益の合計の変動を表します。これらのグラフによって資金の増減を一目で把握することができます。この機能をサヤ取りの練習にも利用できます。実際には取引をしないで、取引したと仮定して取引情報を記録し運用結果(擬似運用結果)を見ることができます。失敗を防止するため、じっくり練習をしてから実際の取引を開始してください。

⑩ 分足損益グラフ

サヤの変化状況を、分足で確認することができます。仕掛け情報が設定されていると、分足損益グラフを確認することができます。



損益グラフは日足(1日毎にプロットしたグラフ)と分足(1分毎にプロットしたグラフ)の2種類が表示可能です。リアルタイム株価データは1分毎に取得し常に更新しています。



⑪ 個別ペア損益グラフ

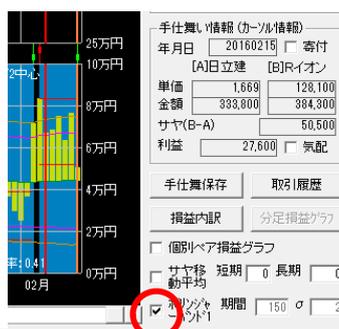
チェックを入れると、売買金額チャートから損益グラフに切り替わります。

⑫ サヤ移動平均

チェックを入れると、設定した日数のサヤ短期・長期移動平均線が表示されます。

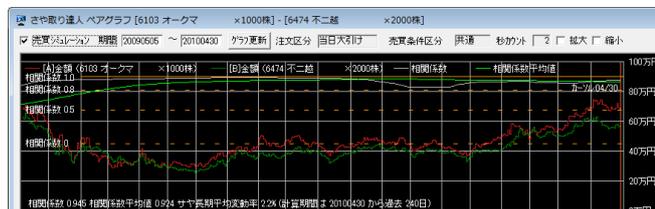
⑬ ボリンジャーバンド 1

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。



⑭ 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、売買金額チャート(上段)に、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。



⑮ 寄付

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」をクリックすると、当日の始値の情報が自動的に入ります。

手仕舞い情報(カーソル情報)	
年月日	20201009 <input checked="" type="checkbox"/> 寄付
[A]イビデン [B]インソー	
単価	2,671 3,470
金額	801,300 694,000
サヤ(B-A)	-107,300
利益	48,800 <input type="checkbox"/> 気配
手仕舞い保存 取引履歴	
損益内訳 分足損益グラフ	

手仕舞い情報の「寄付」にチェックを入れると、当日の始値の情報が自動的に入ります。

手仕舞い情報(カーソル情報)	
年月日	20201009 <input checked="" type="checkbox"/> 寄付
[A]イビデン [B]インソー	
単価	2,671 3,470
金額	801,300 694,000
サヤ(B-A)	-107,300
利益	48,800 <input type="checkbox"/> 気配
手仕舞い保存 取引履歴	
損益内訳 分足損益グラフ	

⑯ 気配

寄付き前(8:30~8:59)の気配値を表示したい場合は「気配」チェックボックスにチェックを付けると、サヤチャート、単価、金額、サヤ、利益が気配値ベースで表示されます。

手仕舞い情報(カーソル情報)	
年月日	20100423 <input type="checkbox"/> 寄付
[A]住友重 [B]伊藤忠	
単価	566 832
金額	566,000 582,400
サヤ(B-A)	16,400
利益	57,800 <input type="checkbox"/> 気配

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。カーソルを移動すると日付が変わりますので表示される数値も変化します。各項目の意味は下記の通りです。

① 相関係数

相関係数とは2つのデータ列の間の類似性の度合いを示します。銘柄の組み合わせがサヤ取りに適しているかどうかの判断に利用します。相関係数の変動範囲は-1～1です。見方としては下記のようにみます。

1・・・正相関である --- 2つのデータ列がまったく同じ場合に相関係数は1になります。1に近いほど相関が高いと言えます。

0・・・相関なし --- 2つのデータ列には類似性がないということです。

-1・・・逆相関である。 --- 2つの同じデータ列の一方が別のデータ列の極性を反転した場合に-1になります。

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

サヤ長期移動平均をサヤの収縮点と考えます。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のが良いです。なぜなら将来のサヤの収縮位置が予想できるからです。数値的には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。

サヤは下記の計算式で計算します。

サヤ[円] = B銘柄の金額 - A銘柄の金額

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。

サヤ長期移動平均は下記の計算式で計算します。

サヤ長期移動平均[円] = (サヤ1 + サヤ2 + サヤ3・・・サヤN) / N

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。A銘柄とB銘柄の取引金額(平均値)の不均衡度合いはサヤ長期移動平均で知ることができます。

不均衡率は下記の計算式で計算します。

不均衡率[%] = (サヤ長期移動平均 / 取引金額合計) × 100

不均衡率、0%はA銘柄とB銘柄の取引金額(平均値)が完全に均衡している状態です。数値的には10%以下が望ましいです。

なぜなら暴落等でA銘柄とB銘柄の株価が同時に下落した場合に不均衡率が小さい程(つまり均衡が高い程)、損益がバランス良く相殺され、損を抑制できるからです。

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。サヤ長期移動平均をサヤの縮小位置と考えます。サヤかい離の絶対値は予定利益と同じ値になります。

サヤかい離は下記の計算式で計算します。

$$\text{サヤかい離[円]} = \text{サヤ} - \text{サヤ長期移動平均}$$

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。

サヤかい離率は下記の計算式で計算します。

$$\text{サヤかい離率[\%]} = \text{サヤかい離} \times 100 / \text{取引金額合計}$$

この数値が高い程、大きな利益が期待できる半面、リスクも伴います。サヤが極端に拡大した場合は株価の連動性がなくなる前兆の場合がありますので注意が必要です。

⑨ サヤσ

サヤσ(サヤシグマ)とはサヤの標準偏差です。ボリンジャーバンドのσに相当します。単位は[円]になります。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を示しています。ボリンジャーバンドには理論値が存在しますが、確率を過信しないようにしてください。

この数値が高い程、大きな利益が期待できる半面、リスクも伴います。異常値である場合は、株価の連動性が失われる前兆の場合がありますので注意が必要です。

対σ倍率の数値は、設定した期間内のサヤ移動平均線で算出されたもので、限定的な過去のデータを元にしていきますので、将来のサヤがそれによって拘束されるものではありません。

また、株価の変動によってボリンジャーバンドの形も日々変形します。株価が大きく変動した事によって、ボリンジャーバンドも大きく広がってしまう場合もありますので注意してください。

◎チュートリアル

1.さや取り達人の概要

<http://youtu.be/75Wo4p23DNE>