

8. 銘柄ペア自動作成

軸銘柄と相関の高い銘柄を組み合わせて、銘柄ペアを自動的に作成し ます。銘柄ペアファィル自動作成機能を利用する場合は、はじめに軸 銘柄の登録を実施してください。銘柄ペアは1ファイル当たり最大で 2000 ペア登録可能です。

- 1. 銘柄ペアを自動で作成する
- 1. 「[B]銘柄候補」をクリックしてください。
- 2. 「[B]銘柄候補」の画面が表示されますので、各項目を設定してください。 設定範囲内で変更が可能です。

🔄 [B]銘柄候補 ([A]銘柄:6503 三菱電 )	
<ul> <li>✓ 相関係数</li> <li>○ 800 +以上・-以下</li> <li>✓ 相関係数平均値</li> <li>○ 800 以上</li> </ul>	□ 出来高平均 □ 100.000 株以上
相関係数計算期間 240 日 (設定範囲20~ 494)	「元賀額平均 10,000 万円以上 通行 U%     上記の平均計管期間 10 円 (設定範囲1~988)
□ 銘柄コードの範囲 お柄コードの範囲を同葉種に設定	F サヤ長期移動平均変動率 30 %以下 条件保存 検索 中断 開じる
番号 日付 時刻 市場 コード 銘柄名	現在値  前日比  出来高  株数  相関瞬時  相関平均  出来高平均  売買額平均  妙長変動

- 相関係数 このチェックボックスには通常チェックを付けてください。 設定範囲は -1.0~1.0です。通常は 0.8 以上に設定します。 マイナスをつけた場合は逆相関の検索になります。
- 相関係数平均
   このチェックボックスは必要に応じて付けてください。
   設定範囲は 0~1.0です。
- 相関係数計算期間 相関係数の計算期間を変更したい時に、変更後の値を入力してくだ さい。
   例えば1年間の相関係数をチェックしたい場合はこの期間を240日 に設定してください。(営業日のみを数えますので1年は約240日 になります)
- 銘柄コードの範囲
   ここでは使用しませんのでチェックを外してください。

- 出来高平均
   ここでは使用しませんのでチェックを外してください。
- 売買額平均
   売買額がある一定値以上の銘柄に絞りたい場合に利用してください。
   売買額を検索条件に加えるには売買額平均の下限値を入力し「売買額平均」チェックボックスにチェックを付けてください。
   売買額平均が大きい場合(例えば 50000 万円)は中・大型の銘柄が抽出されます。売買額平均が小さい場合(例えば 10000 万円)は小型の銘柄も抽出されます。
- 上記の平均計算期間
   売買額は日によってばらつきますので平均値で検索するようになっています。売買額平均の平均期間を設定してください。
- サヤ長期移動平均変動率
   サヤを長期移動平均でみた場合、なるべく変動が少ない方がサヤ取りに向いています。サヤ長期移動平均の変動率を計算し、この値の
   上限を検索条件として設定できます。通常は「5%以下」に設定してください。
- 設定が完了したら「条件保存」をして「閉じる」をクリックしてく ださい。
- 次に、ペアグラフの最も右端の日付が今日になっていることを確認 してください。
- 5. メニューの「銘柄ペア作成」の「銘柄ペア作成開始」をクリックし てください。



軸銘柄ファイルを選択して「OK」をクリックしてください。
 ※軸銘柄は、最新のデータに更新の上ご利用ください。
 更新手続きは「軸銘柄ファイルの更新」をご参照ください。

0100412		

7. 「開始」をクリックしてください。

💀 銘柄ペア作成	- • 💌						
基準日付け 20100412							
軸銘柄ファイル名							
日経225車部名柄_50_20100412							
市場コード銘柄名	株数						
<u>東 1832 日水</u> 東1 1834 マルハニチロHD 東1 1805 国際帝石 東1 1721 コムシスHD 東1 1802 大林組 東1 1802 大林組 東1 1802 大林組 東1 1802 積水建 東1 1812 鹿島 東1 1928 積水いウス 東1 2268 明冶HD	1800         •           4000         1           500         2000           1000         2000           1000         2000           1000         2000           1000         500           100         •						
□ 同じ業種から検索する							
開始	閉じる						

- ※「同じ業種から検索する」にチェックを入れると、軸銘柄のコードが属する業種と同じ業種コード範囲が検索条件として設定されます。
- 8. 「B銘柄候補」画面が開いて、それぞれの軸銘柄に対して相関係数 の高い銘柄が検索されます。

ø	[B]錦	\$两候補 ([A]\$	搖柄: 3	105 E	]清紡	)										- • 💌	Ī
Б Б	7 相開	係数 係数平均値		0.800	〕 +以」 〒 以下	Ŀ∙-以下	Πa	出来高平均	10	0,000 株以」	E.		9947 ·	1マージュ			
ŧ	相関係数計算期間 240 日(設定範囲20~494				∰20~ 494)	○ 売買額平均 10,000 万円以上 ト記の平均計算期間 □ 30 日 (設定範囲1~088)					進行 9	進行 99 % ( 2247/ 2272)					
Г	]銘柄 銘柄コ	コードの範囲 ードの範囲を「	 司業種	1000 二設定	~	2000	E t	ナヤ長期移	動平均変	動率 [	30 %k	۲. T	条件保	存検索	中断	閉じる	
Ī	番号	日付	時刻	市場	_  ⊐~ド	銘柄名		現在値	前日比	出来高	株数	相閲瞬時	相関平均	出来高平均	売買額平均	サヤ長変動	
ľ	1	2010/04/12	15:00	東1	3101	洋紡		151	2	4,532,000	6,000	0.809	0.854	2,398,500	35,608	2.7	
	2	2010/04/12	15:00	東1	5812	日立線		277	6	1,302,000	3,000	0.831	0.883	1,725,600	47,757	2.6	
	3	2010/04/12	15:00	東1	5901	洋缶		1,708	21	496,000	600	0.924	0.924	1,093,580	184,629	2.4	
	4	2010/04/12	15:00	東1	6751	日無線		241	0	600,000	5,000	0.809	0.877	1,073,700	23,883	1.0	
	5	2010/04/12	15:00	東1	6924	岩崎電		210	0	2,036,000	5,000	0.830	0.850	1,198,200	23,126	1.6	
Ŀ	6	2010/04/12	15:00	東1	7911	凸版印		841	5	1,709,000	1,000	0.813	0.869	2,614,600	219,166	1.4	

軸銘柄毎に全銘柄から検索しますので軸銘柄の数が多い場合、この 作業は時間がかかります。軸銘柄として「日経225軸銘柄」を利 用した場合は約2時間かかります。

途中で中断したい場合は「中断」をクリックして「キャンセル」を してください。

9. 検索が終了すると下記が表示されますので「OK」をクリックしてく ださい。



銘柄ペア001			
保存するファイル			

10. 銘柄ペアの名前を入力して「OK」をクリックしてください。

11. 「OK」をクリックしてください。

さや取り達人	×
銘柄ペアファイルを保存しました。作成した銘柄ペアファイルに切	〕換えます。
	ОК

- 12. 銘柄ペアリスト・ペアグラフには作成された銘柄ペアが表示されま す。
- 2. 重複ペアを確認、削除する 銘柄ペアを自動で作成するとAとBの銘柄が入れ替わっただけで銘柄 の組み合わせが同じペアが何組か作成されます。ペアの重複を避ける目 的で重複ペアの削除をします。
- 1. メニューの「銘柄ペア作成」の「重複ペア確認、削除」をクリックします。

ਕੂ ਟਾ	や取りì	主人 [5	洛柄ペア_50_	2010	0412]						
ファイ	(JL(F)	<u>–</u> د	ザー設定(U)	錦桐	「ペア作	成(P) 🦻	売買余	€件(J)	グラ	ラ表示(G)	∿1/7°(H)
No.	[A]市	A3-1-	[A]銘柄		軸銘柄	證録(J)				[B]銘柄	[B]単価
1	東1	1802	大林組	1	軸銘柄	自動作成	ҟ(A)			补建	C
2	東1	1803	清水建		*************************************						C
3	東1	1812	鹿島	1	戦场内ノアイル削床(D) サコ					サエ	C
4	東1	1812	鹿島	1	銘柄べ	ア作成開	1886€	4)		▶ずほ信	C
5	東1	1928	積水ハウス		手作る		30164			を 瓦斯化	C
6	東1	2002	日清粉G		里後个	(ノイク住民公、	削時	:(vv)		けせ	C
7	東1	2002	日清粉G	同一銘柄確認・削除(B) ズケン							C
8	東1	2002	日清粉G		0	000	_	東リ	0210	_JXU	C
9	東1	2502	アサヒ		0	300		東1	4543	テルモ	C
10	車1	2502	アサト		0	300		审1	2267	ヤクルト	0

2. 「はい」をクリックすると削除されます。

さや取り達人	- 23
重複ペアが 63ペア存在します。削降	としますか。
(\$\mathcal{t})	いいえ(N)

3. 「はい」クリックすると現在の銘柄ペアファイルに上書きされます。



3. 同一銘柄を確認、削除する

銘柄ペアを自動で作成すると同じ銘柄を含むペアが複数出現します。そ のようなペアが存在すると全体の損益に対して特定の銘柄の損益が及ぼ す影響が大きくなります。ペアの分散効果が薄れて損益の乱高下が増 大します。そのような現象を防ぎたい場合は、同じ銘柄を含むペアを削 除してください。

[注意事項]

同一銘柄を削除すると銘柄ペアが極端に減る場合がありますのでユー ザー様の判断で行ってください。

削除の処理は最後尾から先頭に向かって実施されます。つまり並び順が 低いペアから優先して削除されます。何らかの項目で並べ替えを実施し た後に本作業を実施すると、最終的に並び順が最も高いペアが残ります。

1. メニューの「銘柄ペア作成」の「同一銘柄確認・削除」をクリックしてください。

0 th	や取り	<b>主人</b> []	洛柄ペア_50_3	201004	18]					
ファイ	(ノレ(F)	-L	ザー設定(U)	銘柄ペ	ペア作成(	[P) 売買	₹条件(J)	グラ	フ表示(G)	∿⊮7°(H)
No.	[A]市	A3-1*	[A]銘柄	1	鼬銘柄登	録(J)			[B]銘柄	[B]単価 [E
28	東1	6503	三菱電	đ	鼬銘柄自	動作成(A	A)		12-	0
29	東1	6762	TDK		+ 40 +T	- 20.20	(BA(D))		東電	0
30	東1	8332	横浜銀	4	闘師内ノ	アイル配	I际(D)		K(#K	0
31	東1	6762	TDK	1	名柄ペア	作成開始	3(M)		בוו	0
32	東1	8002	丸紅		£+# ~ ~ ~	7	156(141)		菱商事	0
33	東1	8404	みずほ信	5	担任(ヘノ)	伊田高の、月	IB∓(VV)		בע	0
34	東1	8815	東急不	Ī	同一銘柄	確認・削	l除(B)		[建物	0
35	東1	6301	עדב	-	0	300	果!	0471	日本精工	0
36	東1	4324	電通		0	200	東1	4205	日ゼオン	0
37	東1	7201	日産自		0	600	東1	7230	日信工業	0
	No. 28 29 30 31 32 33 34 35 36 37	<ul> <li>さや取り</li> <li>ファイル(F)</li> <li>No. [A]市</li> <li>28 東1</li> <li>29 東1</li> <li>30 東1</li> <li>31 東1</li> <li>32 東1</li> <li>33 東1</li> <li>34 東1</li> <li>35 東1</li> <li>36 東1</li> <li>37 東1</li> </ul>	さや取り達人 ( ファイル(F) ユー 10 10 10 11	さや取り違人[銘柄ペア_50_]           ファイル(F) ユーザー設定(U)           No.         [A]市 Aユード         [A)送椅雨           29 東1         6503<三要電           29 東1         6762 <tdk< td="">           30 東1         8332         横浜銀           31 東1         6762<tdk< td="">           32 東1         9402         九紅           33 東1         9404         かずぼ信           35 東1         6301         コマッ           36 東1         6301         コマッ           37 東1&lt;7201         日度自</tdk<></tdk<>	さや取り違人[銘柄ペア_50_201004           ファイル(F)         ユーザー設定(U)         銘柄ペア           20         東1         6503         三要電           20         東1         6503         三要電         1           20         東1         6762         TDK         1           30         東1         8332         横浜銀         1         1           31         東1         6762         TDK         1	さや取り違人(銘柄ペア_50_20100418)           ファイル(F)         ユーザー設定(U)         銘柄ペア作成()           28 東1         6503<三菱電         輪銘柄雪           29 東1         6762         TOK         輪銘柄う           30 東1         8332         横浜銀         輪銘柄う           30 東1         8332         横浜銀         輪銘柄う           30 東1         8332         横浜銀         輪銘柄う           33 東1         8404         みずぼ信         歯銀ペワ           36 東1         6815         東急不         同一銘柄           36 東1         6301         コマッ         0         一           37 東1         700         日産自         0         0		さや取り違人(銘柄ペア_50_20100418]           ファイル(F)         ユーザー設定(U)         銘柄ペア(本成(P))         売買条件(1)           No.         (A)市 Aユード         (A)路柄         輸銘柄登録(1)           28<東1	・さや取り違人[銘柄ペア_50_20100418]            ファイル(F)         ユーザー設定(U)         銘柄ペア作成(P)         売買条件(1)         グラ           1         第1         6503         三菱電         輸銘柄雪銀(1)         輸銘柄雪銀(1)           20         東1         6503         三菱電         輸銘柄ファイル削除(D)         503         三菱電           30         東1         6502         TDK              ・         輸銘柄ファイル削除(D)              ・	さや取り違人[銘柄ペア_50_20100418]           ファイル(F)         ユーザー設定(U)         銘柄ペア作成(P)         売買条件(J)         グラフ表示(G)           No.         (A)市 Aユード         (A)路荷         輸銘柄登録(J)         [B)銘柄           29 東1         6503         芝愛電         輸銘柄登録(J)         「夏電           30 東1         8322         権兵損         輸銘柄ファイル制除(D)         大ぼく           30 東1         8322         権兵損         単銘柄ファイル制除(D)         (ぼく           33 東1         8404         みぼ(指         一         一           33 東1         8404         みぼ(指         同一銘柄確認・削除(B)         12           35 東1         6301         コマツ         0         200         東1         420           36 東1         4324         電過         0         200         東1         4208         日ピオッ           37 東1<7201         日屋自         0         600         東1         4208         日ピオッ

2. 削除する場合は「はい」をクリックしてください。

さや取り達人 83
同一銘柄を含むペアが 54ペア存在します。削除しますか。
(まい(Y) いいえ(N)

上記の操作を実施すると該当するペアが消えますが銘柄ペアファイルは 自動的には更新されません。銘柄ペアファイルとして残したい場合はメニ 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。 4. 銘柄ペアを編集する

作成された銘柄ペアは主に相関係数が高いという条件で作成されています。

登録されている銘柄ペアの中には、サヤ取りに適していない銘柄ペアが ありますので「ペア編集実行」機能を使い銘柄ペアの絞り込みをします。

まず「損益内訳」「スキャン 1」を実行します。次に「ペア編集実行」から、 例えば、下記の項目順に並べ替えをし、成績の悪いペアを「選択」して削 除してください。

・損益の大きい順に並べ替える

・相関係数の大きい順に並べ替える

・勝ち数の大きい順に並べ替える

詳しくは<u>「銘柄ペアファイルの編集」</u>を参照してください。

また、サヤグラフを見てサヤ取りに適していない銘柄ペアは削除してください。

サヤ取りに適しているかどうかの判断は下記の点を観察してください。

・サヤの山と谷がなるべく規則的に複数存在する。

- ・サヤの不規則な変動が少ない
- ・サヤの山と谷はなるべく多く存在する。
- ・サヤの山と谷がなるべく揃っている。

・サヤの大きなうねりが少ない。

編集が終了したら、上書き保存をしてください。

◎チュートリアル

8.銘柄ペア自動作成

http://youtu.be/tefB8fkXB80