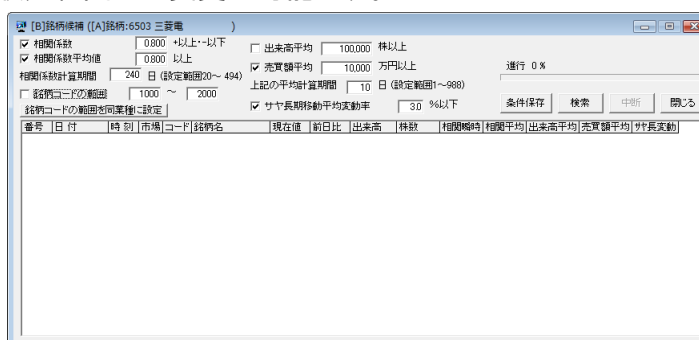


8. 銘柄ペア自動作成

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。銘柄ペアファイ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。

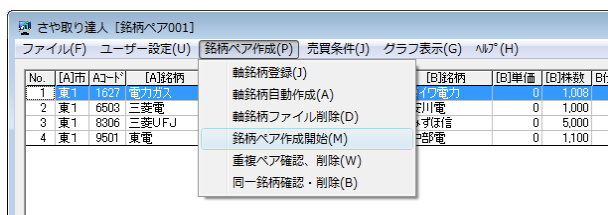
1. 銘柄ペアを自動で作成する

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。

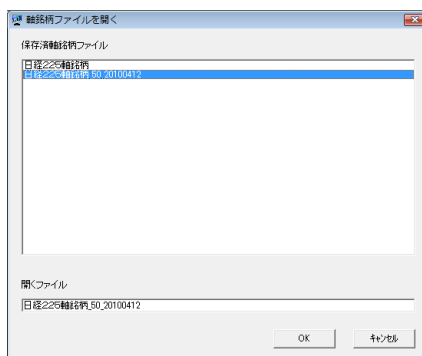


- 相関係数
このチェックボックスには通常チェックを付けてください。設定範囲は -1.0~1.0 です。通常は 0.8 以上に設定します。マイナスをつけた場合は逆相関の検索になります。
- 相関係数平均
このチェックボックスは必要に応じて付けてください。設定範囲は 0~1.0 です。
- 相関係数計算期間
相関係数の計算期間を変更したい時に、変更後の値を入力してください。
例えば1年間の相関係数をチェックしたい場合はこの期間を 240 日に設定してください。(営業日のみを数えますので1年は約 240 日になります)
- 銘柄コードの範囲
ここでは使用しませんのでチェックを外してください。

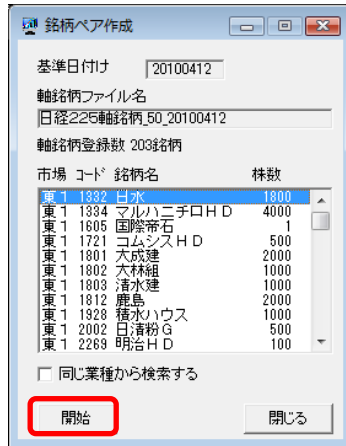
- 出来高平均
ここでは使用しませんのでチェックを外してください。
 - 売買額平均
売買額がある一定値以上の銘柄に絞りたい場合に利用してください。
売買額を検索条件に加えるには売買額平均の下限値を入力し「売買額平均」チェックボックスにチェックを付けてください。
売買額平均が大きい場合（例えば 50000 万円）は中・大型の銘柄が抽出されます。売買額平均が小さい場合（例えば 10000 万円）は小型の銘柄も抽出されます。
 - 上記の平均計算期間
売買額は日によってばらつきますので平均値で検索するようになっています。売買額平均の平均期間を設定してください。
 - サヤ長期移動平均変動率
サヤを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。
3. 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。
 4. 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。



6. 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。



7. 「開始」をクリックしてください。



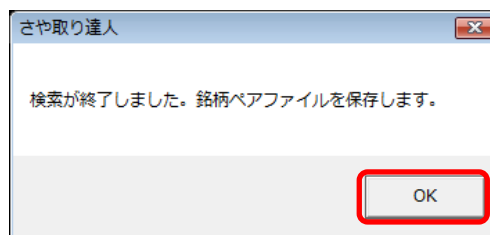
※「同じ業種から検索する」にチェックを入れると、軸銘柄のコードが属する業種と同じ業種コード範囲が検索条件として設定されます。

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。

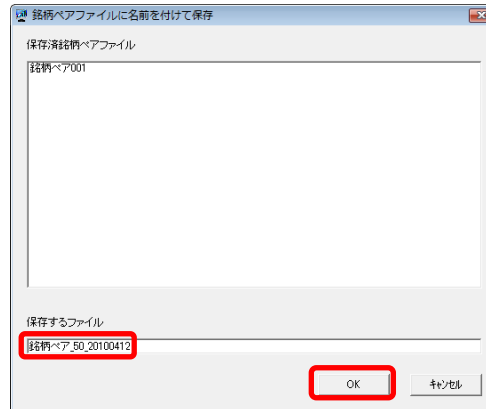


軸銘柄毎に全銘柄から検索しますので軸銘柄の数が多い場合、この作業は時間がかかります。軸銘柄として「日経225軸銘柄」を利用した場合は約2時間かかります。途中で中断したい場合は「中断」をクリックして「キャンセル」をしてください。

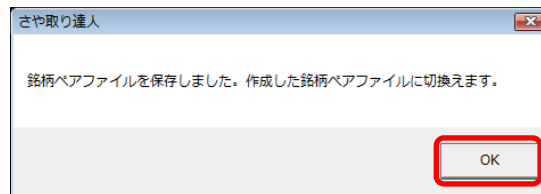
9. 検索が終了すると下記が表示されますので「OK」をクリックしてください。



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。

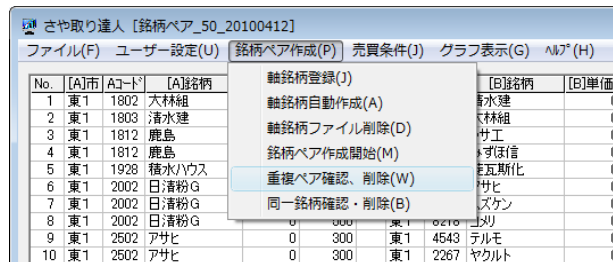


12. 銘柄ペアリスト・ペアグラフには作成された銘柄ペアが表示されません。

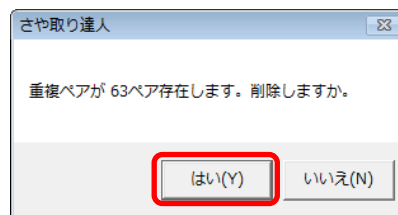
2. 重複ペアを確認、削除する

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。

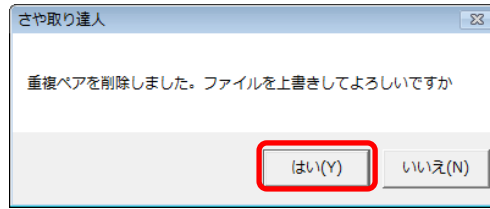
1. メニューの「銘柄ペア作成」の「重複ペア確認、削除」をクリックします。



2. 「はい」をクリックすると削除されます。



- 「はい」を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

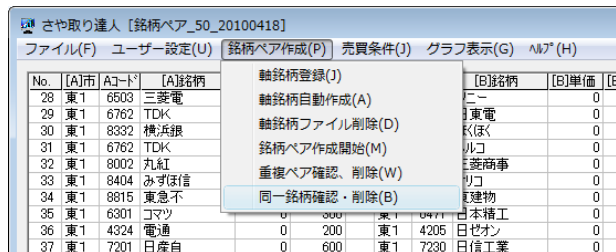
銘柄ペアを自動で作成すると同じ銘柄を含むペアが複数出現します。そのようなペアが存在すると全体の損益に対して特定の銘柄の損益が及ぼす影響が大きくなります。ペアの分散効果が薄れて損益の乱高下が増大します。そのような現象を防ぎたい場合は、同じ銘柄を含むペアを削除してください。

[注意事項]

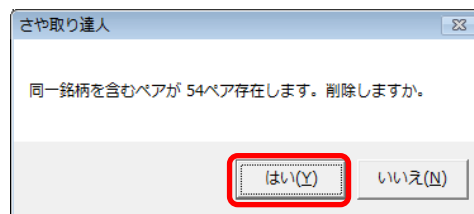
同一銘柄を削除すると銘柄ペアが極端に減る場合がありますのでユーザー様の判断で行ってください。

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。

- 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。



- 削除する場合は「はい」をクリックしてください。



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、さや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「[銘柄ペアファイルの編集](#)」を参照してください。

また、さやグラフを見てさや取りに適していない銘柄ペアは削除してください。

さや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。

- ・さやの山と谷がなるべく規則的に複数存在する。
- ・さやの不規則な変動が少ない
- ・さやの山と谷はなるべく多く存在する。
- ・さやの山と谷がなるべく揃っている。
- ・さや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>