

12. 損益内訳(スキャン 2)

スキャン1は発生した仕掛けマークをすべて表示し、損益はすべての取引の合計を計算していました。

登録した銘柄ペアの数が多い場合は多額の運用資金が必要となり、シミュレーションとして現実的ではありません。

スキャン2は運用規模を考慮してシミュレーションを実行する機能です。

例えば目標とする運用金額を 1000 万円と設定してスキャン2を実行すると建て玉の合計金額が常に 1000 万円近辺になるよう仕掛けマークを選別します。

多数のペア(例えば 500 ペア以上)が登録されていてもスキャン2によってユーザー様の資金に応じたシミュレーションを実行することができます。運用規模は運用金額で設定する他に、最大保有ペア数で設定することも可能です。運用規模を最大保有ペア数で設定した場合は同時に保有するペア数が設定したペア数を超えることはありません。ただし株価の変動によって運用金額は変動します。

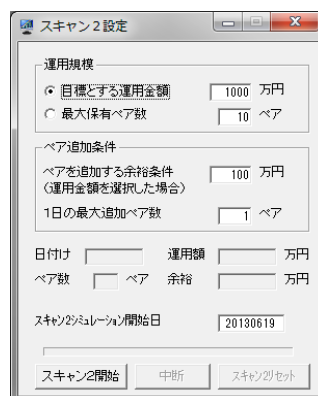
スキャン2は銘柄ペアリストに多数のペアが登録してある場合に利用してください。銘柄ペアが既に絞り込んであって運用規模を制限する必要がない場合はスキャン2を使う必要はありません。

1. スキャン 2 を実行する

ペアグラフ画面の「損益内訳」をクリックしてください。

まず最初に「スキャン 1」をクリックして実行してください。

スキャン 1 が終了したら「スキャン 2」をクリックしてください。



運用規模は運用金額か最大保有ペア数のどちらかで設定します。

「ペアを追加する余裕条件」は 1 ペアの取引金額の合計に近い金額を設定してください。

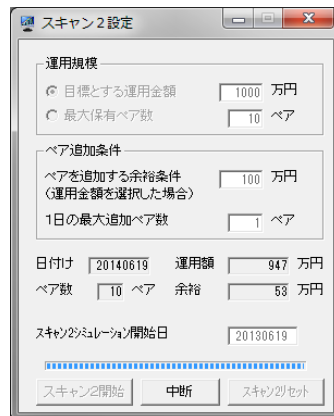
「1 日の最大追加ペア数」は目標とする運用金額と 1 ペアの取引金額の合計(平均値)に応じて設定してください。

下記は最大追加ペア数の目安値です。

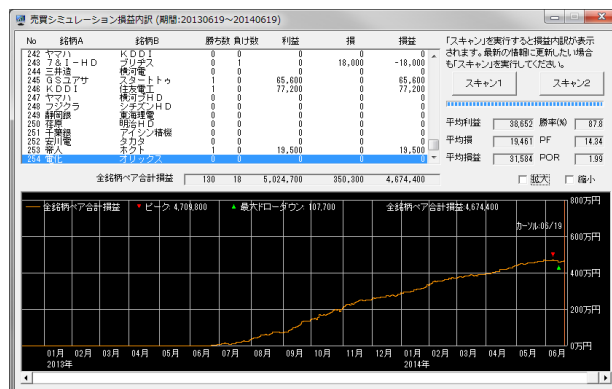
最大追加ペア数目安値		
目標とする運用金額	1日の最大追加ペア数 (1ペア約100万円の場合)	1日の最大追加ペア数 (1ペア約200万円の場合)
1000万円以下	1	1
2000万円	1~2	1
3000万円	2~3	1~2
5000万円	3~4	1~2
1億円	5~8	2~4

1日の最大追加ペア数の設定値が小さい場合は建て玉の合計金額が目標とする運用金額に達しない場合があります。
 銘柄ペアリストに登録されている銘柄ペア数が少ない場合は建て玉の合計金額が目標とする運用金額に達しない場合があります。
 「スキャン2シミュレーション開始日」を確認してください。
 初期値は1年前の日付が設定されています。(1年前よりさらに前に設定することはできません。)

以上の設定が完了しましたら「スキャン2開始」をクリックしてください。
 処理中は動作確認のため下記が表示されます。
 「日付け」「運用額」「ペア数」「余裕」



「目標とする運用金額」に対して表示された運用額が極端に小さい場合(1/2以下)は「1日の最大追加ペア数」を増やしてください。



2. スキャン 2 の仕組み

スキャン 2 の処理は過去から現在に向かって 1 日毎に処理されます。その日の運用金額または保有ペア数に余裕が存在したら新規に仕掛けるという仕組みになっています。

運用金額または保有ペア数に余裕がない場合は新規には仕掛けません。日にちの経過によって利食いまたは損切りによって返済されますので運用金額(またはペア数)に余裕が生まれます。余裕が生まれたらまた新規に仕掛ける訳です。このような処理を過去から現在に向かって毎日繰り返します。

仕掛けマークの選別作業はソフトが自動的に実行します。

仕掛けが 1 部のペアに偏らないよう、すべてのペアに分散するよう考慮されています。

運用規模を「最大保有ペア数」で設定した場合は同時に建てられるペア数が設定値で制限されます。

株価の変動によって運用金額は変動します。

取引の結果発生した利益や損は運用金額に組み入れていません。

実際の運用においては損が発生する場合を考慮して保証金に余裕を持たせる必要があります。

[保証金の余裕の例]

(下記の例は「売り」だけでなく「買い」も信用で取引すると仮定しています。)

目標とする運用金額……1000 万円

必要保証金………300 万円 (1000 万円の 30%)

実際に預ける保証金としては上記の金額に余裕を持たせてください。

例えば 100 万円の余裕を加えると 400 万円になります。

$300 + 100 = 400$ 万円

となります。

損が保証金の余裕、100 万円をオーバーしなければ 1000 万円の運用を継続できます。

3. スキャン 2 注意事項

- 売買条件によってスキャン 2 のシミュレーションの成績が異なります。売買条件の、しきい値係数を 2σ 以上に設定することをおすすめします。
- 下記のいずれかを変更後スキャン 2 を再度実行すると 1 回目のスキャン 2 で表示されていた結果と異なる結果が表示されます。
 - ・銘柄ペアの追加や削除
 - ・売買条件の変更
 - ・スキャン 2 の条件の変更

実際の運用を開始した後は、仕掛けマークの連続性が失われますのでご注意ください。

- スキャン 2 の結果は自動的に更新されません。
時間が経過して株価が変化するとスキャン 2 の結果は古いものになります。
スキャン 2 の結果を最新に更新するにはスキャン 1 とスキャン 2 の両方を実行してください。スキャン 2 はスキャン 1 の結果を利用していますのでスキャン 2 だけ実行しても最新の結果が得られません。
スキャン 2 の結果を実際の運用に利用する場合は特にご注意ください。
- 「スキャン 2 シミュレーション開始日」はメイン画面の「シミュレーション開始日」と同じか後に設定する必要があります。
「スキャン 2 シミュレーション開始日」は保存されますので変更しない限り固定されます。
一方メイン画面の「シミュレーション開始日」の初期値は自動的に 1 年前の日付が表示されます。
- スキャン 2 によるシミュレーション結果を毎日継続して見る場合は「スキャン 2 シミュレーション開始日」を 1 年前の日付ではなく例えば 6 ヶ月前の日付に設定してください。
そうすると 6 ヶ月間は日付(メイン画面の「シミュレーション開始日」または「スキャン 2 シミュレーション開始日」)を変更しないで済みます。
スキャン 2 シミュレーション開始日」を 1 年前の日付に設定するとメイン画面の「シミュレーション開始日」が「スキャン 2 シミュレーション開始日」を追い越してしまうのでスキャン 2 を実行する度に日付の設定を変更しなければならなくなります。
- 銘柄ペアを追加したり削除したりした場合と他の銘柄ペアに切り替える操作を実施するとスキャン 1 とスキャン 2 の実行後の情報は消滅します。スキャン 1 およびスキャン 2 を再度実行してください。