

STEP 2

最適化GCVによる売買サイン点灯銘柄の抽出

- 1 最適化GCVの「勝率」「利益率」について
- 2 「勝率」と「利益率」の関係について



1 最適化GCVの「勝率」「利益率」について

STEP2 の画面では、STEP1で設定された条件に応じて、最適化 GCV による「買いサイン」と「注目サイン」が点灯している銘柄が抽出され、さらにその勝率と利益率によって4×4のマスの中にそれぞれ振り分けられます。「勝率」と「利益率」は以下の方法によって算出されています。

利益率 ...

GCV のサインに従って当該銘柄を最低売買単位で売買したと仮定して、株式の売却総額を購入総額で割った数字です。利益率が高いほど GCV がその銘柄をより良いタイミングで売買サインを出したということになります。

勝率 ...

期間内で最適化 GCV が買いサインを出した後、次の売りサインを出した時点で利益を出せたときは「勝ち」、損を出してしまったときは「負け」とします。全ての売買回数を勝ち回数で割った数字が勝率です。勝率が高いほど、GCV がその銘柄の値動きを的確に捉えていたということになります。



2 「勝率」と「利益率」の関係について

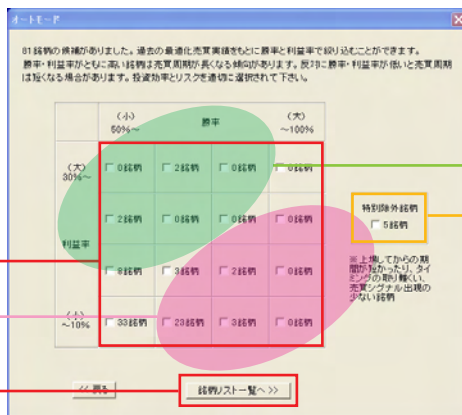
言うまでもなく、勝率も利益率も一番良い銘柄を選ぶことがベストですが、そのような銘柄が抽出されない場合は勝率が利益率かのどちらかの数値にポイントを置いて、銘柄を探すこととなります。勝率と利益率の関係は以下のように考えられます。

【勝率が高く、利益率が低い】

大きなリターンは望みづら이지만、低リスクで安定した投資運用が可能な銘柄が抽出される可能性が高くなります。売買回数は少なくなる傾向にあります。

【勝率が低く、利益率が高い】

大きな上昇波動を捉えられれば、大きくリターンを得ることが可能ですが、損切りを余儀なくされることも多い、いわゆる「ハイリスク・ハイリターン型」の銘柄が抽出される可能性が高くなります。売買回数は多くなる傾向にあります。



なお、この勝率・利益率はあくまでも過去のデータから算出されたもので、当該銘柄の今後の利益やリスクを保証するものではありませんのでご注意ください。

以上のことを参考にして、4×4のマス目の中からご覧になりたい箇所にチェックを入れ、下部にある「銘柄リスト一覧へ」のボタンをクリックし、次のSTEP画面へ行きます。

★特別除外銘柄

上場してから期間が短いなどの理由で、最適化GCVの売買サイン出現回数が2回以下の銘柄は、データの信憑性に疑問があるので、基本的には抽出銘柄に加えません。もし、これらの銘柄もリストに加える場合は、「特別除外銘柄」のチェックボックスにチェックを入れてください。