「スキャナーを活用した銘柄選び」セミナーでいただいたご質問への回答

1.はじめに

こんにちは。
今回はコラム特別編として 2020 年 1 月 22 日のオンラインセミナーでいただいたご質問のうち、時間の都合上お答えできなかったものに対して回答する内容とさせていただきます。
この回のオンラインセミナーは「スキャナー」がテーマでした。
当日のオンラインセミナーの動画は『トレードステーション日本株』公式 YouTube チャンネルでご覧いただけます。

URL　https://www.youtube.com/watch?v=2ZmwcIoqjsk&t=15s

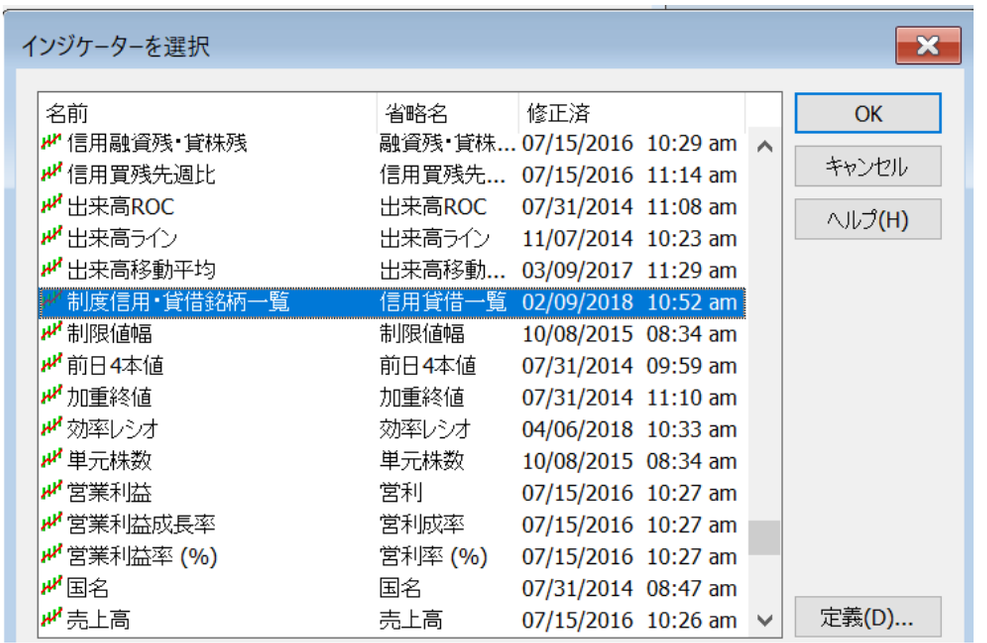
私のセミナーも含め、トレステに関する最新のセミナーが随時公開されていますので是非チャンネル登録をお願いします。
オンラインセミナーはライブで 200 名近くの多くの皆様にご覧いただき、銘柄をスクリーニングすることに対する関心の高さを実感しました。
いただいたご質問に回答することで、まだ動画をご覧になっていないトレステユーザーにも有益なものとなれば幸いです。
スキャナーの基本的な操作方法にまだ自信が無い方は、まずはオンラインセミナーをご覧いただいてスキャナーの概要をご理解いただいてからの方が理解しやすいと思います。
では早速質問と回答形式で進めていきましょう。

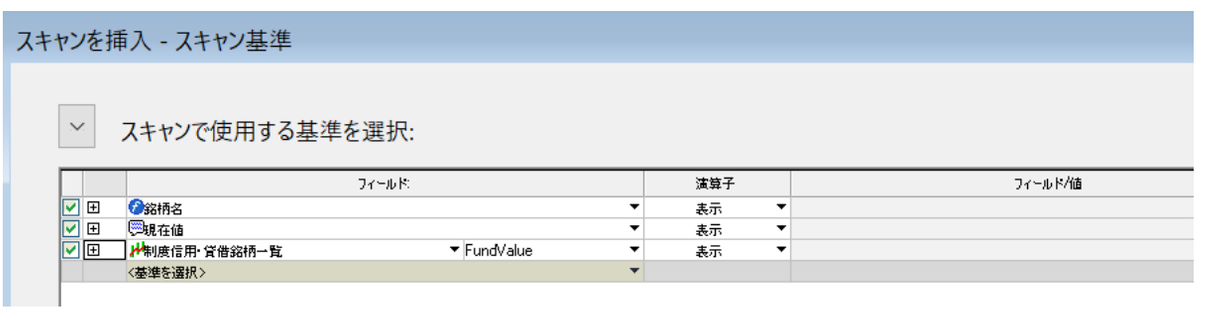
2. 質問と回答

【質問 1】スキャナーで貸借銘柄を選択する方法は？

トレステの組み込みインジケーターに「制度信用・貸借銘柄一覧」というものがあります。このインジケーターをスキャナーのスキャン基準のフィールドに追加することで貸借銘柄だけをスクリーニングすることができます。
トレステで信用取引を行っているユーザーにとっては大変便利なインジケーターですので是非試してみてください。

設定は以下のようになります。

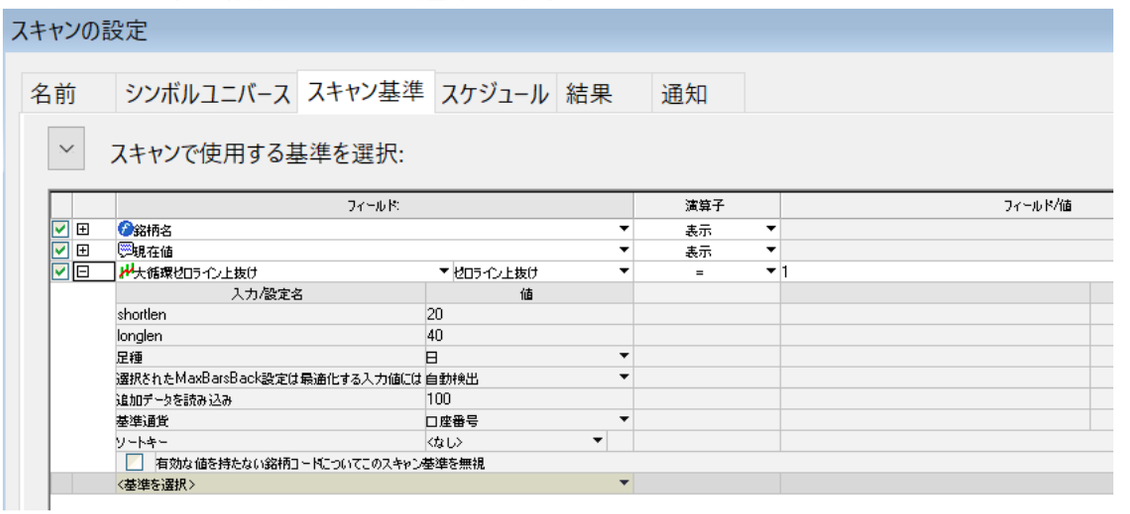




	銘柄コード	銘柄名	現在値	制度信用・貸借銘柄一覧: FundValue
1	1434-TS	JESCOホールディングス	373.00	貸借銘柄
2	1443-TS	技研ホールディングス	382.00	制度信用銘柄
3	1451-TS	KHC	930.00	制度信用銘柄
4	1491-TS	中外鉱業	19.00	制度信用銘柄
5	1711-TS	省電舎ホールディングス	319.00	制度信用銘柄
6	1737-TS	三井金属エンジニアリング	946.00	制度信用銘柄
7	1743-TS	コーアツ工業	3,800.00	制度信用銘柄
8	1757-TS	クレアホールディングス	29.00	制度信用銘柄
9	1764-TS	工藤建設	2,395.00	制度信用銘柄
10	1775-TS	富士古河E&C	2,145.00	制度信用銘柄

【質問 2】小次郎講師の大循環分析 MACD で 3 ラインが下からゼロラインに到達したスキャナーが知りたいです 。

小次郎先生の大循環分析 MACD の資料を読み、私なりに解釈した結果でご説明します。
1 ラインが中期（20 日間指数平滑移動平均）
2 ラインが長期（40 日指数平滑移動平均）
1 ラインと 2 ラインの差が 3 ライン
ゼロラインは 1 ラインと 2 ラインがクロスする点です。
とすると中期 EMA と長期 EMA のゴールデンクロスがお求めのスキャナーによるシグナルになると考えました（私の解釈が間違っていたら申し訳ありません）。
以上を前提にトレステに内蔵されているインジケーターを使用してスキャナーを設定してみましたが、なかなかうまく行かなかったため新たにインジケーターを開発しました。
以下よりダウンロードください。
https://info.monex.co.jp/tools-download/Tools/JPEQ/20200210_hongo.ELD
スキャン基準の設定は以下の通りです。



【質問 3】MACD のデッドクロスは、スキャン出来ますか？

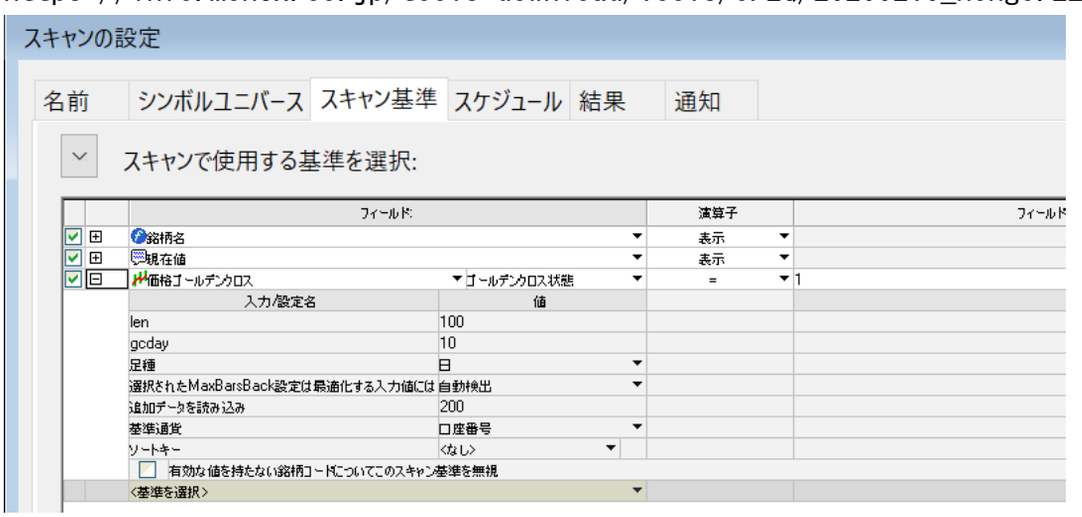
可能です。トレステに標準搭載されている MACD インジケーターを使ってスキャン基準を以下のように設定して試してみてください。

【質問 4】貸株料や逆日歩、日々公表銘柄等の表示はできますか？

これらの情報は残念ながらスキャナーでは表示できません。

【質問 5】直近 10 日以内に株価が 100 日移動平均線をゴールデンクロスした銘柄を検索することはできますか？

トレステに標準搭載されたインジケーターには、そのものずばりの名前の「ゴールデンクロス」というものがありますが、こちらは移動平均同士の比較でゴールデンクロスを判定するインジケーターですので、価格と移動平均線を比較するゴールデンクロスのインジケーターを別途開発しました。
こちらもダウンロードしたインジケーターに一緒に入れてありますので、こちらをご自分のトレステにインストールして以下のように設定してお試しください。
https://info.monex.co.jp/tools-download/Tools/JPEQ/20200210_hongo.ELD



【質問 6】出来高と出来高回転率と時価総額を出すにはどうすれば良いのですか

スキャナーのスキャン基準に「出来高」の項目がありますので、こちらを選択して演算子を「表示」とすると各銘柄の出来高が表示できます。
一般的な出来高回転率の計算式は以下の通りです。

出来高回転率＝1 日の出来高÷時価総額

全上場銘柄や市場別の出来高回転率はスキャナーでは計算できません。
しかし銘柄毎の回転率であればスキャナーを使って算出可能です
具体的な方法としては、スキャン基準に「出来高」と「時価総額」を選択し、スキャンを実行、スキャン結果を Excel にコピー＆ペーストして、出来高回転率を計算するための除算（割り算）を行います。
これにより出来高回転率を導き出すことができます。

【質問 7】銘柄同時バックテストのソースコードは見れますか？

こちらは一般公開しておりません。
2 月 1 日開催の一日集中対面セミナーで、参加者限定でテスト的にソースコードを公開いたしました。

【質問 8】2 銘柄や 3 銘柄以上を組み合わせたペアトレード向けの銘柄のスクリーニング方法が気になりました。

スキャナーは個別銘柄情報を元にスクリーニングするのは得意ですが、銘柄横断的な情報を元にスクリーニングするのはあまり得意ではありません。
よってペアトレードのような複数銘柄を比較するような計算は原則できないとお考え下さい。
それを前提にスキャナーでできるペアトレードの手法を考えていきます。
スキャナーでペアトレードができる銘柄をスクリーニングする場合は、スキャン基準の演算子のうちの「範囲外」を使うと良いでしょう。
インジケーターは移動平均乖離率を使用します。
銘柄 A が移動平均乖離率で＋10%を超えた上昇、銘柄 B が―10%を下回る下落、となる場合に銘柄 A を信用売り、銘柄 B を信用買い、または現物買いします。
銘柄 A と銘柄 B が同じ化粧品業界であるなど、同業種であり、値動きの相関性が高いとなおペアトレードに向いています。
スキャナーの設定方法は以下のように行ってみてください。設定は「短期%」でフィールドのうち「FastLength」の 5 が設定値となっています。すなわち 5 日移動平均線からの乖離率でスクリーニングしています。
この数値を変更すれば自分好みの期間の移動平均からの乖離率でペアトレード候補を探すことができます。

3. おわりに

以上、いただいたご質問に回答しました。
インジケーターも 2 つありますのでスキャナーに設定してスクリーニングを行ってみてください。
スキャナーにインジケーターを適用して使いこなせるようになればスキャナー中級者です！

【参考文献】

1. EasyLanguage プログラミング入門（本郷喜千著、スタンダーズ）
プログラミングが初めてという方にもおすすめの EasyLanguage 学習書籍です。
2. EasyLanguage ホームスタディーコース
無料ダウンロード可能の EasyLanguage 初級者向け学習教材です。
以下のリンク経由でダウンロードできます。
https://info.monex.co.jp/ts-support-info/information/easylanguagehsc.html
3. トレードステーション EasyLanguage プログラミングホームスタディー動画講座
一般社団法人プログラミングトレード協会が開催するプログラミング初心者から取り組める動画講座です。
https://info.monex.co.jp/ts-info/news/20181213_01.html