

物理データパック

『株で勝つ人は、物理で考えている』
検証データ一式 — 見方ガイド

本書で述べた「相場を物理として捉える」という考え方を、実際に日本株337銘柄・約9年のバックテストにかけた結果の全記録です。防御レイヤーを持たない素朴なシステムと、物理的な防御を組み込んだシステムを、まったく同じ条件で戦わせています。

このデータが示した結論

物理は、儲ける装置ではなく
破壊を防ぐ装置だった。

数字はすべて、あなたの手元のExcelで確かめられます。

このバックに入っているもの

CSVは7本。すべてExcelでそのまま開けます（文字コードはUTF-8 BOM付き）。

ファイル	内容
01_成績サマリー	両システムの主要指標を一枚に
02_年別リターン	年ごとの勝ち負け（2017-2026）
03_局面別ダウンロード	4つの急落局面での落ち方
04_トレード明細_素朴版	3,883件すべての売買記録
05_トレード明細_物理版	3,017件すべての売買記録
06_資産推移	日ごとの資産額（グラフ用）
07_対象銘柄リスト	検証した339銘柄

検証の条件

- 対象 — 日本株337銘柄（東証の主要銘柄から構成）
- 期間 — 2017年8月15日～2026年7月9日（約9年）
- 資金 — 100万円スタート・現物・単利
- 建玉 — 最大20銘柄×1銘柄あたり5%
- 約定 — シグナル翌日の寄付で仕掛け
- 出口（順張り） — 損切り－8%/5日目以降25日線割れで手仕舞い（最長120日）
- 出口（逆張り） — 25日線タッチで利確／損切り－7%/15日で時間切れ

数字の読み方

まず、両者を並べます。物理版は「勝ちを増やす」のではなく「負け方を変える」システムだということが、ここに出ています。

指標	素朴版	物理版
トレード数	3,883件	3,017件
勝率	26.3%	29.7%
プロフィットファクター	1.30	1.36
年率リターン	+9.5%	+7.5%
最大ドローダウン	-34.3%	-20.5%

最大ドローダウンとは「資産が一番へこんだ時の落差」です。34%減れば元に戻るのに52%の利益が要りますが、20%なら25%で済みます。物理版が守ったのは、この「戻す労力」でした。

急落局面での落ち方

局面	素朴版	物理版
2018年 世界同時株安	-12.3%	-7.7%
2020年 コロナショック	-33.5%	-19.3%
2022年 金利ショック	-13.6%	-6.1%
2024年 令和のブラックマンデー	-11.7%	-8.5%

そして、その代償

都合のいい話だけを載せるつもりはありません。強気相場では、物理版は明確に負けます。2023年は+21.3%に対して+10.3%、2024年は+16.9%に対して+4.3%。守りを固めるとは、上げに乗り遅れることでもある——この事実も含めて、02_年別リターン.csv にすべて残してあります。

このデータの限界

検証は万能ではありません。以下は、この数字が抱えている弱点です。隠さずに書いておきます。

- 生存バイアス — 現在の上場銘柄で過去を検証しているため、途中で上場廃止になった銘柄が含まれません。成績はやや上振れます。
- コスト・税が未計上 — 売買手数料・スリッページ・税金を引いていません。売買回数の多い素朴版のほうが、実際にはさらに不利になります。
- 端株を許容 — 単元未満の株数で計算しています。実際の売買ではこの通りには建てられません。
- 過去は未来ではない — 約9年という期間は、相場の歴史から見れば短い一区間です。同じことが次の9年で起きる保証はありません。

おことわり

本データは、著者自身が行ったバックテストの結果を研究記録として共有するものであり、特定の銘柄や商品の売買を推奨・勧誘するもの、また投資判断について助言するものではありません。投資はご自身の判断と責任において行ってください。

検証データライブラリでは、ほかのパックも公開しています。

ruletrade.jp/bnf-data/