

BNF検証データ 見方ガイド

『BNF流 短期逆張り投資の全検証』特典 — ruletrade.jp

このデータについて

書籍の検証で実際に使用したデータ一式です。研究・学習のための「検証結果の共有」であり、特定銘柄の売買推奨や投資助言ではありません。

ファイル一覧（7点）

01_jjai_filter.csv	地合いフィルター検証（第4章）
02_threshold_era.csv	乖離率閾値×時代別 2005-2026（第5章）
03_threshold_sector.csv	乖離率閾値×セクター別（第5章）
04_size_groups.csv	大型株vs中小型の逆張り比較（第6章）
05_crash_holding.csv	下落相場×保有期間（第7章）
06_tsuredaka_trades_8y.csv	連れ高・出遅れ順張り トレード明細 8年
07_tsuredaka_trades_jq.csv	同・J-Quantsデータ版 明細

主要な列の読み方（集計CSV）

trades = 取引数 / win = 勝率% / pf = プロフィットファクター

（総利益÷総損失。1超で利益、1.5超で優秀の目安）

avg = 1回あたり平均損益% / ann = 年率% / maxdd = 最大ドローダウン%

tp_rate = 利確で終えた割合%。取引数30未満の行は参考程度に。

明細CSV（06・07）の列

ticker/name/sector = 銘柄 / entry_date・exit_date = 建て・手仕舞い日

entry_price・exit_price = 約定価格 / pnl_pct = 損益% /

exit_reason = 手仕舞い理由（利確+8%・損切り-4%・時間切れ10日）

各検証の見どころ

- 01 地合い：日経25/75日線・VIXで新規建てを絞るとPFがどう変わるか。
改善幅と「引き換えに減る取引数」をセットで見る。
- 02 時代別：最適な乖離率閾値が時代とともにどう深く/浅くなったか。
- 03 セクター別：同じ閾値でも業種で効き方が違うことを確認。
- 04 大型株：BNFが大型で逆張りを縮小した理由が「機会の消失」か
「エッジの消失」かをシグナル頻度と成績の両面から切り分ける。
- 05 下落相場：リーマン/コロナ/2024.8で、保有日数別にどう振る舞ったか。
- 06-07 連れ高：終値判定→翌日寄付約定、利確+8%/損切-4%/最大10日の
ルールによる8年ぶんの全トレード明細。

検証の限界（必ずお読みください）

- ・ 上場廃止銘柄を含まないため、サバイバーシップバイアスがあります。
- ・ 対象は選抜済みの128銘柄ユニバースです（市場全体ではありません）。
- ・ 2005年頃の古いデータは品質が落ちる場合があります。
- ・ 売買コストは往復0.2%固定の簡易モデルです（滑り・流動性は簡略化）。

免責

本データは過去データにもとづく検証結果の共有であり、将来の成果を保証するものではありません。特定の金融商品の売買を推奨・勧誘するもの、投資助言を行うものではありません。投資はご自身の判断と責任で。

無料の学習記事・診断・ツール：<https://ruletrade.jp/>

著者の全書籍：<https://ruletrade.jp/#books>