

多周期共振スコアリングシステム

製品説明書

銘柄スクリーニング、テクニカル構造の識別、投資リサーチ業務を支援する定量シグナルツール

製品ポジション

本システムは、日足・週足・月足の間に現れる構造的共振シグナルの識別を支援し、ローカルの過去相場データベース、テクニカル指標、カルマンフィルター予測、スコアリングモデルを、バッチ実行可能な投資リサーチスクリーニングプロセスへ統合します。

項目	説明
発行主体	洛水株式会社
文書バージョン	日本語版 v4.0
対象利用者	お客様、投資リサーチ担当者、投資助言サポートチーム、製品デモ、社内研修
発行日	2026-07-07
本番環境	本システムは Python および洛水定量モデルシステム 3.0 に基づいています。利用前に「洛水定量モデルシステム操作マニュアル V3.0」に従い、Python 環境および database ローカルデータベースをインストールしてください。

重要事項：本製品の出力は投資リサーチを補助する情報であり、いかなる投資助言、収益保証、売買指示にも該当しません。

目次

- 1. 製品概要
- 2. コアバリューと利用シーン
- 3. データソースと実行方法
- 4. モデルロジックの説明
- 5. 多周期共振スコアリング体系
- 6. Excel 出力結果の説明
- 7. お客様の利用フロー
- 8. リスク開示と利用範囲
- 9. よくある質問
- 付録：項目説明

1. 製品概要

洛水投資の多周期共振銘柄選定システムは、日本株式市場向けのバッチ型テクニカル構造スクリーニングツールです。本システムはローカルの過去相場データベースから終値データを読み込み、日足・週足・月足の3周期について、移動平均線構造、MACD 状態、予測クロス日、共振スコアを自動計算し、結果を Excel ランキング表として出力します。これにより、初期スクリーニング、比較、後続の投資リサーチ確認を効率化できます。

本製品の目的はアナリストの判断を置き換えることではなく、反復性の高いテクニカル構造の観察を標準化し、表形式で記録し、再確認可能にすることです。統一されたスコアと項目定義により、お客様は追加調査が必要な銘柄群を迅速に特定できます。

一言でいうと

システムはまず月足で大きな方向性を判断し、次に週足で主要な転換点を識別し、最後に日足で短期リズムを観察します。これら3つを統合し、ソート可能な共振スコアを形成します。

2. コアバリューと利用シーン

お客様のニーズ	システム機能	得られる結果
一括スクリーニング	ticker.csv 内の全銘柄プールを自動読込	銘柄ごとに手作業でチャート確認する必要を低減
ノイズ低減	月足・週足・日足の階層別スコアリングを導入	単一の日足シグナルによる誤判定を低減
構造識別	移動平均線、MACD、トレンド傾き、予測クロスを統合	修復、強化、または弱勢フィルター対象を迅速に発見
結果の記録	Excel ランキングと周期別詳細を出力	ソート、絞り込み、振り返り、社内共有に有用
オフライン優先	ローカル DuckDB 相場データベースを優先読込	外部データ取得への依存を低減

主な利用シーン

- 日次または週次で候補銘柄リストを作成し、投資リサーチ会議、モデル確認、ポートフォリオ観察の入力として利用します。
- 市場変動後に、週足の修復、月足の改善、日足の確認が見られる銘柄を迅速にスキャンします。
- お客様が注目する銘柄について多周期構造を説明し、標準化されたコミュニケーション言語を形成します。
- 過去シグナルを段階的に振り返り、スコア変化とその後の値動きとの関係を確認します。

3. データソースと実行方法

本システムは標準でローカルデータソースを使用します。まず「洛水定量モデルシステム操作マニュアル V3.0」に従って Python 環境および database ローカルデータベースをインストールしてください。インストール後の基本設定は以下の通りです。

データ項目	現在の設定
銘柄プールファイル	ticker.csv
銘柄コード列	ticker
相場データベース	database¥jp_close_db¥db¥jp_close.duckdb
相場テーブル	daily_close(symbol, date, close)
標準データソースモード	local：ローカル相場データベースのみ読み込み
予備モード	auto：ローカル優先、失敗時のみオンライン取得へフォールバック

実行方法

1. 日常実行：スクリプトをダブルクリックまたはコマンドラインで実行すると、システムは ticker.csv 内の全銘柄コードを自動的に読み込みます。
2. 基準日：実行時のポップアップで基準日を YYYY-MM-DD 形式で入力します。
3. 出力先：標準ではプロジェクトディレクトリ内の outputs フォルダに出力されます。
4. 一時指定：少数銘柄のみを実行する場合は、コマンドライン引数 --tickers で指定できます。

4. モデルロジックの説明

本システムは「多周期構造共振」を中心に設計されています。基本ロジックには、価格のリサンプリング、テクニカル指標計算、局所的な高値・安値の識別、カルマン予測、総合スコアリングが含まれます。

モジュール	説明
周期処理	日足終値から週足・月足へリサンプリングし、3周期を同時に分析します。
移動平均線構造	標準で短期移動平均 MA5 と長期移動平均 MA20 を計算し、短長移動平均の関係と予測クロスを観察します。
MACD 構造	DIF、DEA、HIST を計算し、モメンタム修復、DIF/DEA 関係、ゼロライン位置を観察します。
自動 order	周期、サンプル長、直近ボラティリティに基づき、高値・安値識別の感度を自動設定します。
予測区間	直近の高値・安値構造に基づいて予測開始点を決め、移動平均線クロスと MACD クロスを別々に予測します。
カルマンフィルター	short - long の差分を平滑化し将来外挿することで、将来ウィンドウ内のクロス日を探索します。

モデル解釈

システムが出力する予測日は、現在のデータ条件下でモデルが識別した構造的接近点を示すものであり、必ず発生する売買シグナルを意味しません。お客様はファンダメンタルズ、バリュエーション、流動性、業界環境、リスク許容度を総合して判断してください。

5. 多周期共振スコアリング体系

最新版のスコアリング体系は「将来予測ゴールデンクロス共振」を中核とし、すでに発生したゴールデンクロス、当日クロス、過去クロスには点数を付与しません。システムは MA の将来予測共振スコアと MACD の将来予測共振スコアを別々に計算し、その平均を Final Score とします。この設計は、日足・週足・月足における移動平均線と MACD の将来ゴールデンクロス点を予測し、それらが多周期共振を形成しているかを評価するというモデルの中核機能により適合しています。

基本公式

Final Score = (MA Score + MACD Score) / 2。MA Score と MACD Score はいずれも「将来予測ゴールデンクロスの有効性スコア + 多周期共振強度ボーナス」で構成され、それぞれ 100 点を上限とします。すでに発生したクロス、当日クロス、過去クロスは採点されません。

採点対象	計算方法	説明
MA Score	月足 MA 将来予測点 + 週足 MA 将来予測点 + 日足 MA 将来予測点 + MA 共振ボーナス	移動平均線システムにおける将来ゴールデンクロス予測共振を測定します。
MACD Score	月足 MACD 将来予測点 + 週足 MACD 将来予測点 + 日足 MACD 将来予測点 + MACD 共振ボーナス	MACD システムにおける将来ゴールデンクロス予測共振を測定します。
Final Score	(MA Score + MACD Score) / 2	トレンド構造とモメンタム構造を統合した最終ランキングスコアです。

周期ウェイトと予測タイミング係数

各指標の内部では、月足・週足・日足がそれぞれ周期ウェイトに基づいて採点されます。予測日が今回の実行基準日より厳密に後であるゴールデンクロスのみが有効な将来予測とみなされます。すでに発生したクロス、当日クロス、過去クロス、未予測または遠すぎる結果はいずれも 0 点となり、Excel の日付欄は空白のままとなります。

周期	ウェイト	理想ウィンドウ	有効ウィンドウ	観察ウィンドウ	説明
Monthly	40	30-360 日	540 日以内	720 日以内	長周期のウェイトが最も高く、大きな方向性と中長期転換の判断に用います。
Weekly	35	14-120 日	180 日以内	270 日以内	中周期のウェイトは次に高く、主要な修復と転換点の識別に用います。
Daily	25	5-45 日	90 日以内	120 日以内	短周期はリズム確認に用いられ、月足・週足よりウェイトは低くなります。

予測状態	時間係数	説明
既存ゴールデンクロス、当日クロス、過去クロス	0	将来予測スコアには含めません。Excel の日付欄は空白とし、発生済みまたは当日のシグナルを将来予測と誤認しないようにします。
将来予測が理想ウィンドウ内	1.00	最適状態であり、ゴールデンクロス時期が当該周期のリズムと比較的合致していることを示します。
将来予測は有効だが遠い	0.60	予測価値はありますが、時間的距離が遠く、確度は低

		下します。
将来の遠期観察ウィンドウ	0.30	観察手がかりとしてのみ扱い、スコアは低くなります。
未予測、遠すぎる、または有効な将来日なし	0	当該周期の予測点には含めず、Excelの日付欄は空白のままとします。

多周期共振ボーナス

共振ボーナスは、複数の周期で有効な予測ゴールデクロスが同時に現れる場合のシグナル強度を表します。この部分は比較的重要なウェイトを持ち、最新版スコアリング体系の重要な特徴です。

有効共振の組み合わせ	最大ボーナス	説明
Monthly + Weekly + Daily	最大 +30	3周期すべてで有効な予測ゴールデクロスが現れる場合、最も強い共振となります。
Monthly + Weekly	最大 +24	長周期と中周期がともに強化し、中長期共振に該当します。
Weekly + Daily	最大 +16	中短周期共振であり、リズムのトリガーと修復確認に近い性質を持ちます。
Monthly + Daily	最大 +12	長短周期が同時に現れますが、週足の接続を欠くため、月足+週足の組み合わせより強度は低くなります。
単一周期のみ有効	+0	多周期共振を構成せず、単一周期の手がかりとして扱います。

スコアの読み方

新版スコア = 将来予測ゴールデックロスの有効性スコア + 多周期共振強度ボーナス。システムは実行基準日より後の6つの予測結果のみを集計します：MA 日足/週足/月足、MACD 日足/週足/月足。既存クロス、当日クロス、過去クロスは採点対象外であり、Excel の日付欄にも表示されません。Excel の日付色は30日以内の時間的近接関係を示すだけで、スコアを変更しません。

Final Score 範囲	システム判定	お客様向け解釈
80 以上	Strong Resonance	MA と MACD の将来予測共振が比較的強く、優先観察対象とできます。
60-79	Moderate Resonance	将来予測共振が良好であり、候補観察リストに入れることができます。
40-59	Watch	一部の将来予測シグナルは存在しますが、共振度合いはなお確認が必要です。
40 未満	Filter	将来予測共振が不足しており、通常は優先候補リストに入りません。

6. Excel 出力結果の説明

システムが生成する Excel は、お客様向けの主要な成果物です。同一行内で複数の予測日が30日以内に近接している場合、同じフォント色で表示し、時間的に近いシグナル群を直感的に確認できるようにします。時間的な近接関係を形成しない日付は黒色のままです。

ワークシート	用途
Resonance Ranking	メインランキング表です。1 銘柄 1 行で、Final Score、MA/MACD スコア、6 つの予測ゴールデックロス日、Remark を表示します。

	同一行内で 30 日以内に近接する予測日は同じフォント色で示されます。
Run Parameters	実行パラメータ表です。基準日、銘柄プールファイル、データソース、ローカル相場 DB パス、スコア式、ウェイト、判定閾値、日付色ルールを記録します。
Error Log	一部銘柄を分析できない場合、失敗コードと理由を記録します。未登録コードがあっても全体実行は中断されません。

Resonance Ranking 項目の説明と判断ロジック

項目	意味	判断ロジック
Ticker	銘柄コード	ticker.csv に由来します。システムはまずローカル相場 DB のマッピングを確認し、例えば 1301 は 1301.T として解決できます。
Final Score	最終スコア	Final Score = (MA Score + MACD Score) / 2。
MA Score	移動平均線予測共振スコア	月足・週足・日足の MA 予測ゴールデンクロス有効性スコアに、MA 多周期共振ボーナスを加算します。
MACD Score	MACD 予測共振スコア	月足・週足・日足の MACD 予測ゴールデンクロス有効性スコアに、MACD 多周期共振ボーナスを加算します。
Resonance Level	共振レベル	Final Score に基づき、Strong Resonance、Moderate Resonance、Watch、Filter に分類します。

MA Daily Cross	日足 MA ゴールデンクロス予測日	日足 MA5 と MA20 の将来予測ゴールデンクロス日です。空欄の場合、有効な将来予測がない、予測日が当日/過去日である、または当該周期がすでにゴールデンクロス状態であることを示します。
MA Weekly Cross	週足 MA ゴールデンクロス予測日	週足 MA5 と MA20 の将来予測ゴールデンクロス日です。空欄の場合、有効な将来予測がない、予測日が当日/過去日である、または当該周期がすでにゴールデンクロス状態であることを示します。
MA Monthly Cross	月足 MA ゴールデンクロス予測日	月足 MA5 と MA20 の将来予測ゴールデンクロス日です。空欄の場合、有効な将来予測がない、予測日が当日/過去日である、または当該周期がすでにゴールデンクロス状態であることを示します。
MACD Daily Cross	日足 MACD ゴールデンクロス予測日	日足 DIF と DEA の将来予測ゴールデンクロス日です。空欄の場合、有効な将来予測がない、予測日が当日/過去日である、または当該周期がすでにゴールデンクロス状態であることを示します。
MACD Weekly Cross	週足 MACD ゴールデンクロス予測日	週足 DIF と DEA の将来予測ゴールデンクロス日です。空欄の場合、有効な将来予測がない、予測日が当日/過去日である、または当該周期がすでにゴールデンクロス状態であることを示します。
MACD Monthly Cross	月足 MACD ゴールデンクロス予測日	月足 DIF と DEA の将来予測ゴールデンクロス日です。空欄の場合、有効な将来予測がない、予測日が当日/過去日である、または当該周期がすでにゴールデンクロス状態であることを示します。
Remark	備考	MA と MACD について、どの将来予測周期が共振を形成しているか、その強弱、単一周期の将来シ

		<p>グナルにとどまるかを説明します。既存クロスと当日クロスは Remark に記載されません。日付色は同一行内で 30 日以内の予測日クラスターを示すためだけに用いられます。</p>
--	--	--

コード照合と未登録銘柄の処理

項目	説明
ticker.csv コード形式	銘柄プールでは、1301、130A のようなサフィックスなしコードを保持できます。
ローカル DB 優先照合	システムはまず DuckDB の symbols(code -> symbol)マッピングを読み込み、一致が見つかればローカル DB 上の実際の symbol を使用します。
日本市場のサフィックス規則	現在のローカル DB では daily_close.symbol はいずれも.T 形式です (例: 1301.T)。日本の Yahoo/TSE では.T サフィックスが一般的に使われます。
未登録コード	あるコードがローカル DB マッピングにない場合、例えば新規コードが未登録の場合、その銘柄は Error Log に記録され、プログラムは後続銘柄の処理を継続します。
非中断原則	全銘柄が失敗しない限り、個別コードの失敗がバッチスクリーニングを停止させることはありません。

Remark 項目の読み方例

Remark 例	意味
MA: Monthly+Weekly strong resonance; ... MACD: Weekly+Daily moderate resonance; ...	MA は中長期の強い共振を示し、MACD は中短期の中程度共振を示します。
MA: Daily, no multi-timeframe resonance; Daily already golden	日足 MA のみ確認済みであり、多周期共振は形成していません。
MACD: no valid multi-timeframe golden-cross forecast	MACD には有効な多周期予測ゴールデンクロスがありません。

読み方の提案

お客様はまず Final Score の高い順に並べ替え、その後 MA Score と MACD Score が均衡しているかを確認できます。Final Score が高くても MA または MACD の片側だけに依存している場合、Remark で共振の出所を確認し、単一指標シグナルを二系統共振と誤読しないようにしてください。

7. お客様の利用フロー

1. 銘柄リストの準備：ticker.csv にスキャン対象の銘柄コードが含まれていることを確認します。
2. 相場データベースの更新：ローカル相場メンテナンスプログラムにより、DuckDB 内の daily_close テーブルを更新します。
3. システムの実行：バッチ共振銘柄選定スクリプトを実行し、今回分析の基準日を入力します。
4. ランキング確認：Excel の Resonance Ranking を開き、Final Score の高い順に候補銘柄を確認します。
5. 詳細確認：候補銘柄について Timeframe Details を確認し、月足・週足・日足の構造的な出所を確認します。
6. 人的確認：ファンダメンタルズ、業界、財務、バリュエーション、流動性、リスク選好を組み合わせて最終判断を行います。

推奨ワークフロー

まず Resonance Ranking で初期スクリーニングを行い、Strong Resonance および Moderate Resonance の銘柄を人的確認に進めることを推奨します。Filter 銘柄は優先調査対象としては推奨されませんが、後日の振り返り用に保持できます。

8. リスク開示と利用範囲

- 本システムは投資リサーチ補助ツールであり、投資助言、売買指示、収益予測、リスク保証を構成するものではありません。
- テクニカル指標とカルマン予測は過去の価格系列に基づくものであり、企業ファンダメンタルズの急変、政策変更、流動性ショック、財務不正、ブラックスワン事象などの非価格要因をカバーすることはできません。
- 予測クロス日は買いシグナルと同義ではありません。お客様は独自調査とリスク管理ルールを組み合わせる必要があります。
- モデルパラメータ、スコアリングウェイト、データ品質はいずれも出力結果に影響します。自動スクリーニング結果は必ず人的確認が必要です。
- ローカル相場データベースが適時に更新されていない場合、売買停止データが欠落している場合、またはコードマッピングに異常がある場合、出力結果が歪む可能性があります。

9. よくある質問

質問	回答
システムは毎日インターネット接続が必要ですか？	標準では不要です。現行バージョンはローカル DuckDB 相場データベースを優先して読み込みます。auto モード使用時のみ外部データソースを試行します。
なぜ一部銘柄が Error Log に入るのですか？	主な理由は、ローカル DB にコードがない、履歴データが短すぎる、基準日前に有効な終値がない、などです。
Final Score が高いことは買いを意味しますか？	意味しません。高スコアは将来予測ゴールデンクロス共振が良好であることを示すだけであり、ファンダメンタルズ、バリュエーション、リスク、売買計画を合わせて確認する必要があります。
なぜ Excel のヘッダーは英語なのですか？	英語ヘッダーは後続のデータ処理、国際化表示、チーム協業に適しています。中国語の説明は本マニュアルで確認できます。
スコアリングウェイトは調整できますか？	可能です。現在の標準ウェイトは月足 40、週足 35、日足 25 です。今後、バックテスト結果またはお客様の戦略スタイルに応じて調整できます。
なぜ一部の予測日は色付きなのですか？	色は、同一銘柄内で複数の予測日が 30 日以内に近接していることを示すだけです。時間的に近いシグナル群を素早く識別するためのものであり、色自体は Final Score を変更せず、独立した買い推奨を意味しません。

付録：項目説明

項目カテゴリ	代表項目	説明
基本情報	Ticker	銘柄コードです。出力を簡潔に保つため、最新相場日、最新終値、データソースはメイン表から削除されています。
スコア結果	Final Score, MA Score, MACD Score, Resonance Level	ソート、スクリーニング、候補優先度判断に使用します。Action 列は削除されています。
周期状態	Remark	どの周期が将来予測共振を形成しているか、および共振強度を1つの備考で要約します。
予測日	MA Daily/Weekly/Monthly Cross; MACD Daily/Weekly/Monthly Cross	6つの主要な将来予測ゴールデンクロス日です。既存クロス、当日クロス、過去日、または有効な予測がない場合は空欄です。同一行内で複数の日付が30日以内に近接する場合、同じフォント色で表示されます。
構造指標	Run Parameters	基準日、銘柄プール、データソース、ローカル相場DB、スコア式、ウェイトを記録します。
モメンタム指標	Error Log	未登録、履歴不足、その他分析不能なコードを記録します。全体実行は中断されません。
モデルパラメータ	なし	構造指標はメイン表に含めず、出力が横に広がりすぎることを防ぎます。
説明項目	なし	旧版の Risk Flags、Reasons、Core Rationale は Remark に統合されています。

最終説明

洛水投資は、本システムを独立した売買システムではなく、「候補発見と構造確認のためのツール」として利用することを推奨します。モデル出力が標準化されるほど、投資規律、リスク予算、リサーチ判断と組み合わせて利用する必要があります。