

# Grok銘柄分析レポート

データ期間: 2025-11-04 ~ 2025-11-07

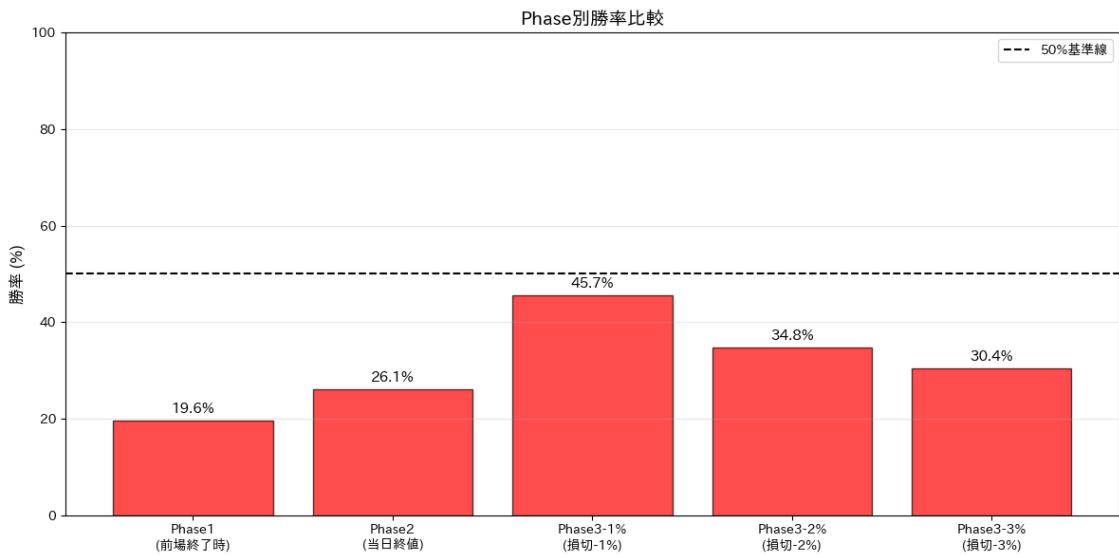
分析銘柄数: 46銘柄

ユニーク銘柄数: 43銘柄

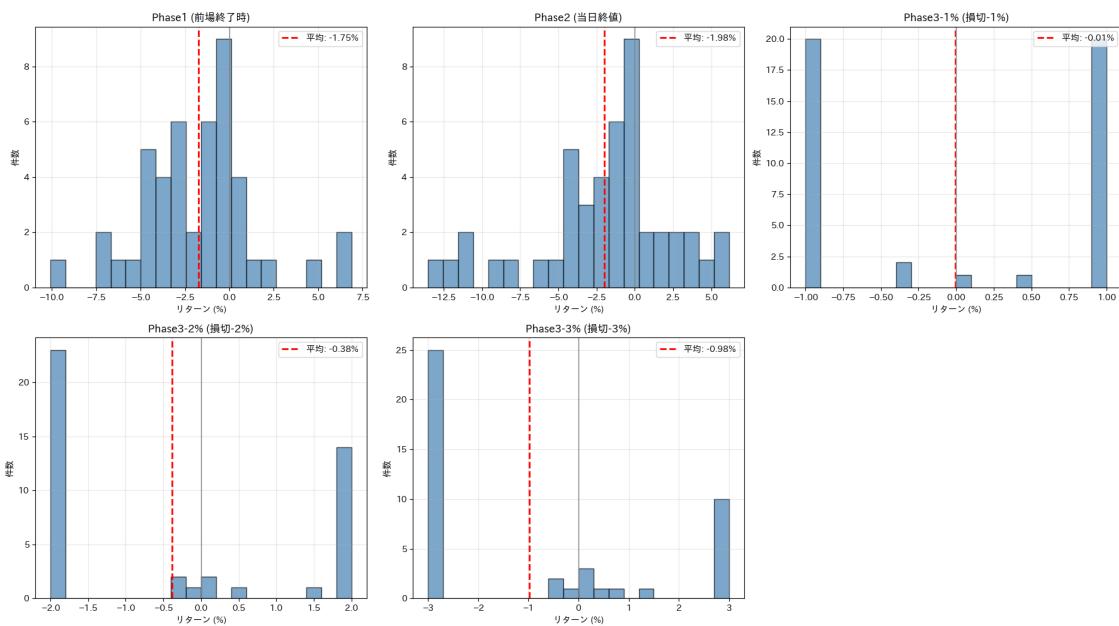
## 1. 基本統計サマリー

Phase	勝率	平均リターン	中央値	勝ち数	負け数
Phase1 (前場終了時)	19.6%	-1.75%	-1.36%	9	37
Phase2 (当日終値)	26.1%	-1.98%	-1.29%	12	34
Phase3-1% (損切-1%)	45.7%	-0.01%	-0.16%	21	25
Phase3-2% (損切-2%)	34.8%	-0.38%	-2.00%	16	30
Phase3-3% (損切-3%)	30.4%	-0.98%	-3.00%	14	32

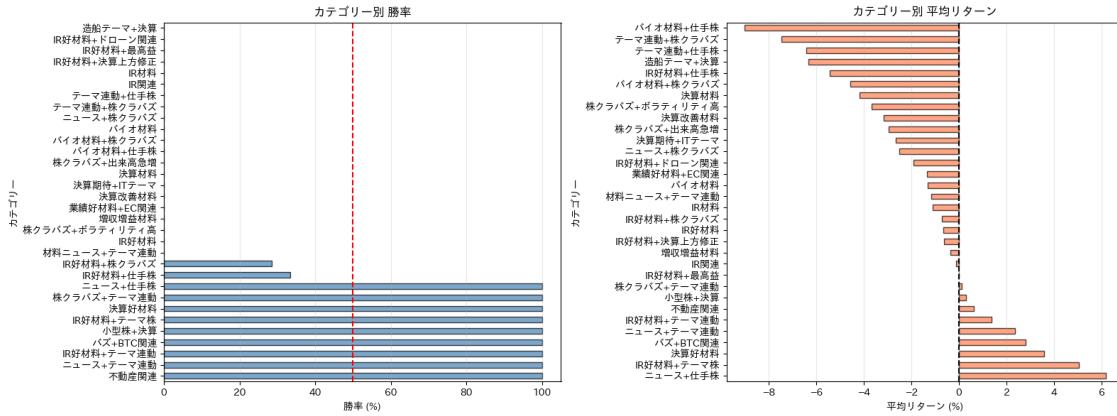
## 2. Phase別勝率比較



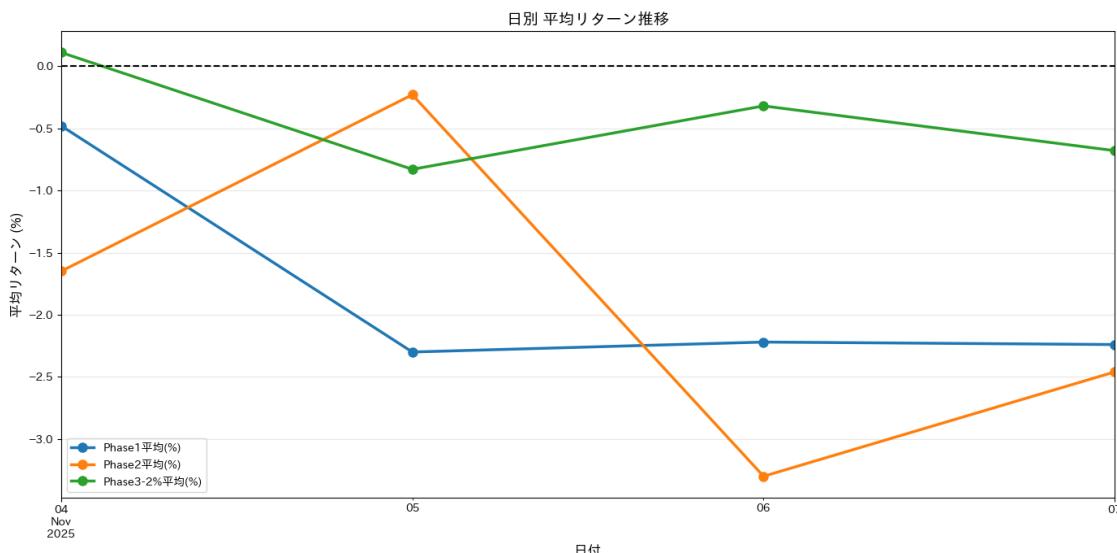
## 3. リターン分布



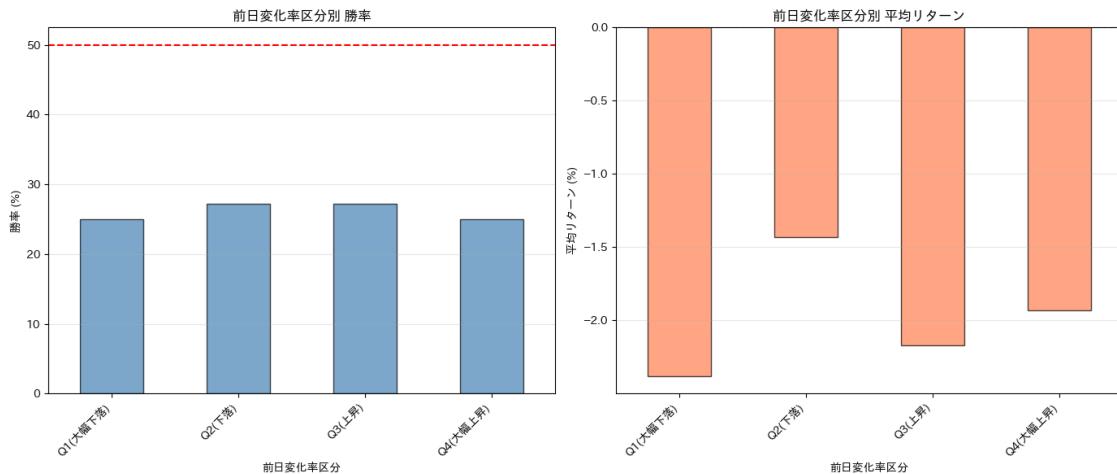
## 4. カテゴリー別分析



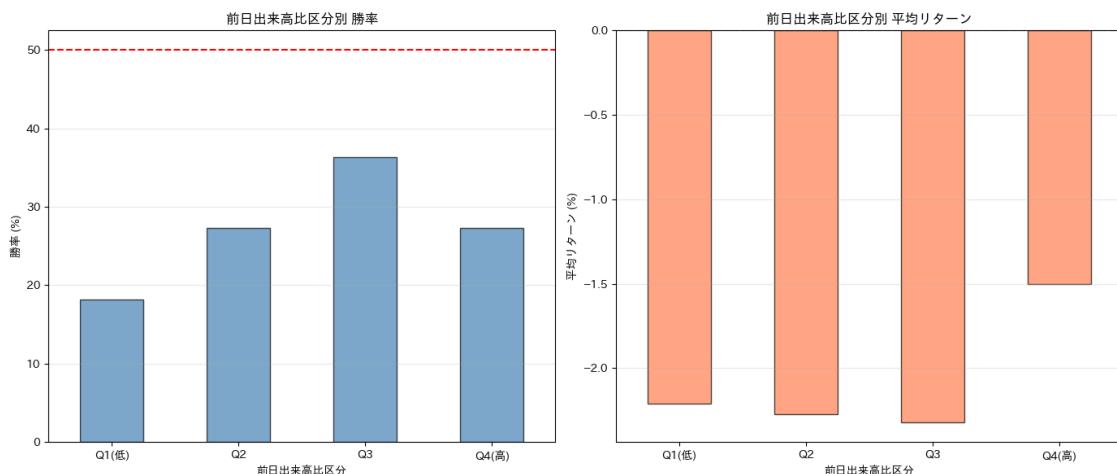
## 5. 日別平均リターン推移



## 6. 前日変化率による分析



## 7. 前日出来高比による分析

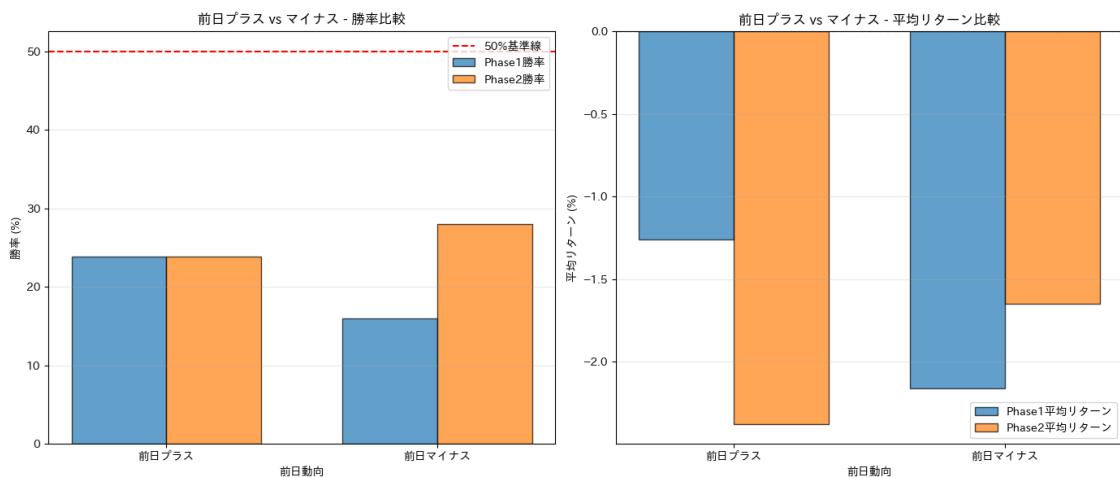


## 8. 前日プラス vs マイナス銘柄の比較

**結論：**前日マイナス銘柄の方がパフォーマンスが良い (Phase2勝率: 28.0% vs 23.8%、平均リターン: -1.65% vs -2.38%)

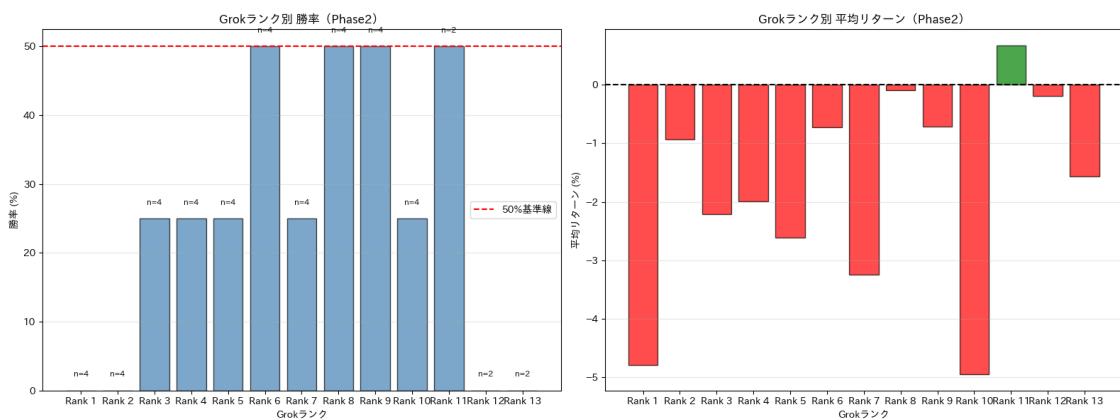
**解説：**前日下落した銘柄はリバウンド効果や割安感から買いが入りやすく、前日上昇した銘柄は利益確定売りに押される傾向

前日動向	銘柄数	Phase1 勝率	Phase2 勝率	Phase1平均リターン	Phase2平均リターン
前日プラス	21	23.8%	23.8%	-1.26%	-2.38%
前日マイナス	25	16.0%	28.0%	-2.16%	-1.65%



## 8. Grokランク別分析 ★ NEW

**重要な発見:** Grokランク1位が必ずしも勝率が高いわけではありません。ランク別の傾向を確認してください。

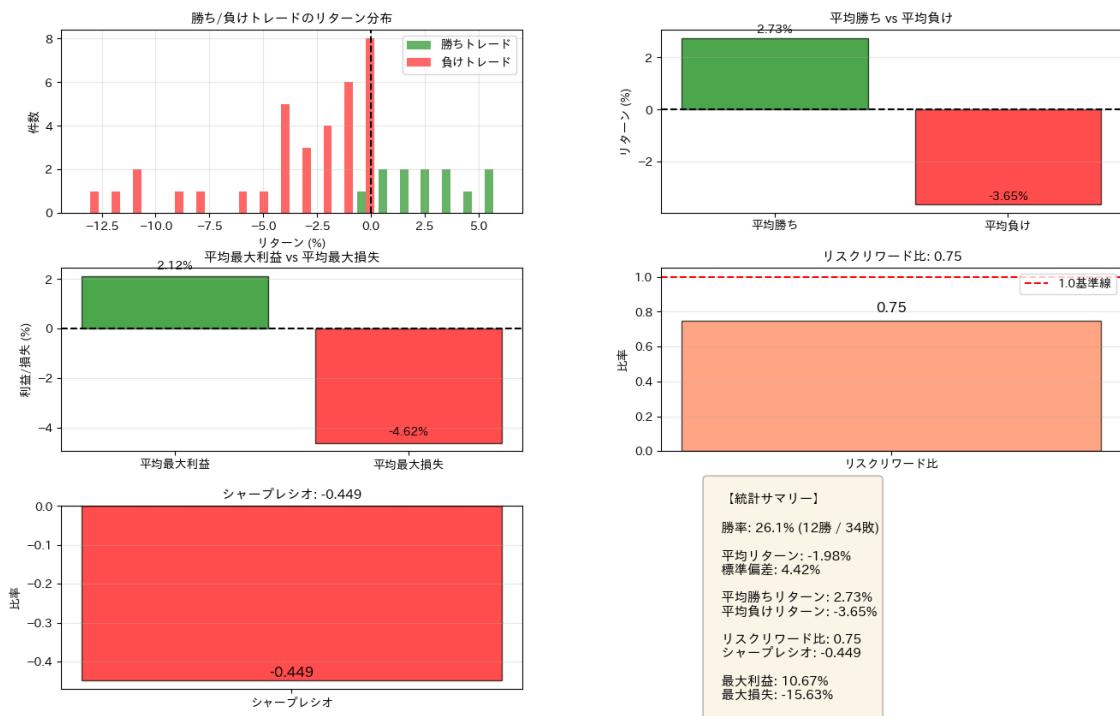


Grokランク	データ数	勝率	平均リターン
Rank 1	4	0.0%	-4.79%
Rank 2	4	0.0%	-0.93%
Rank 3	4	25.0%	-2.21%
Rank 4	4	25.0%	-1.99%
Rank 5	4	25.0%	-2.62%
Rank 6	4	50.0%	-0.73%
Rank 7	4	25.0%	-3.25%
Rank 8	4	50.0%	-0.09%
Rank 9	4	50.0%	-0.71%
Rank 10	4	25.0%	-4.95%
Rank 11	2	50.0%	0.67%
Rank 12	2	0.0%	-0.19%
Rank 13	2	0.0%	-1.57%

## | 9. リスクリワード分析 ☆ NEW

リスクリワード比: 平均勝ちトレード / 平均負けトレード = 0.75

シャープレシオ: 平均リターン / 標準偏差 = -0.449 (0以上が望ましい)

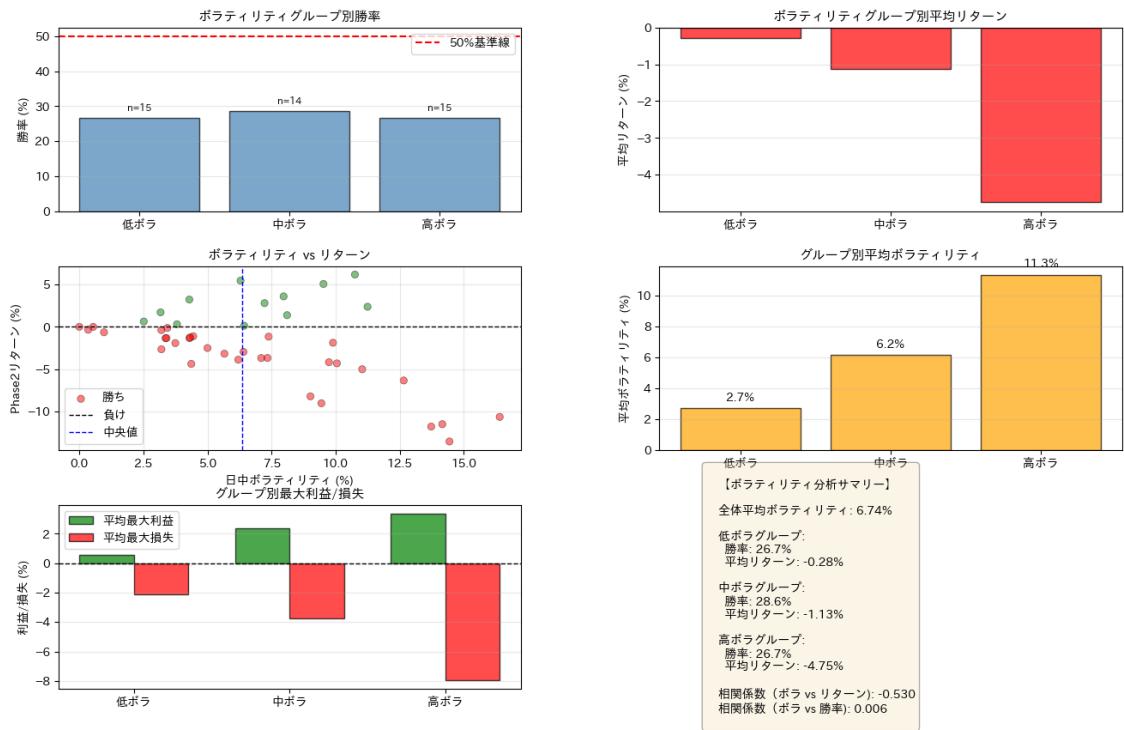


## 解説:

- ・ **リスクリワード比 0.75:** 1.0未満。勝ちトレードの平均利益が負けトレードの平均損失を下回っています。
- ・ **シャープレシオ -0.449:** 負の値。リターンに対してリスクが大きすぎます。
- ・ **勝率 26.1%:** 勝率が50%未満のため、リスクリワード比1.5以上が理想的です。

## 10. ボラティリティと勝率の関係 ★ NEW

**目的:** 値動きの激しい銘柄（高ボラティリティ）は勝ちやすいのか？損切りライン設定に役立つか？



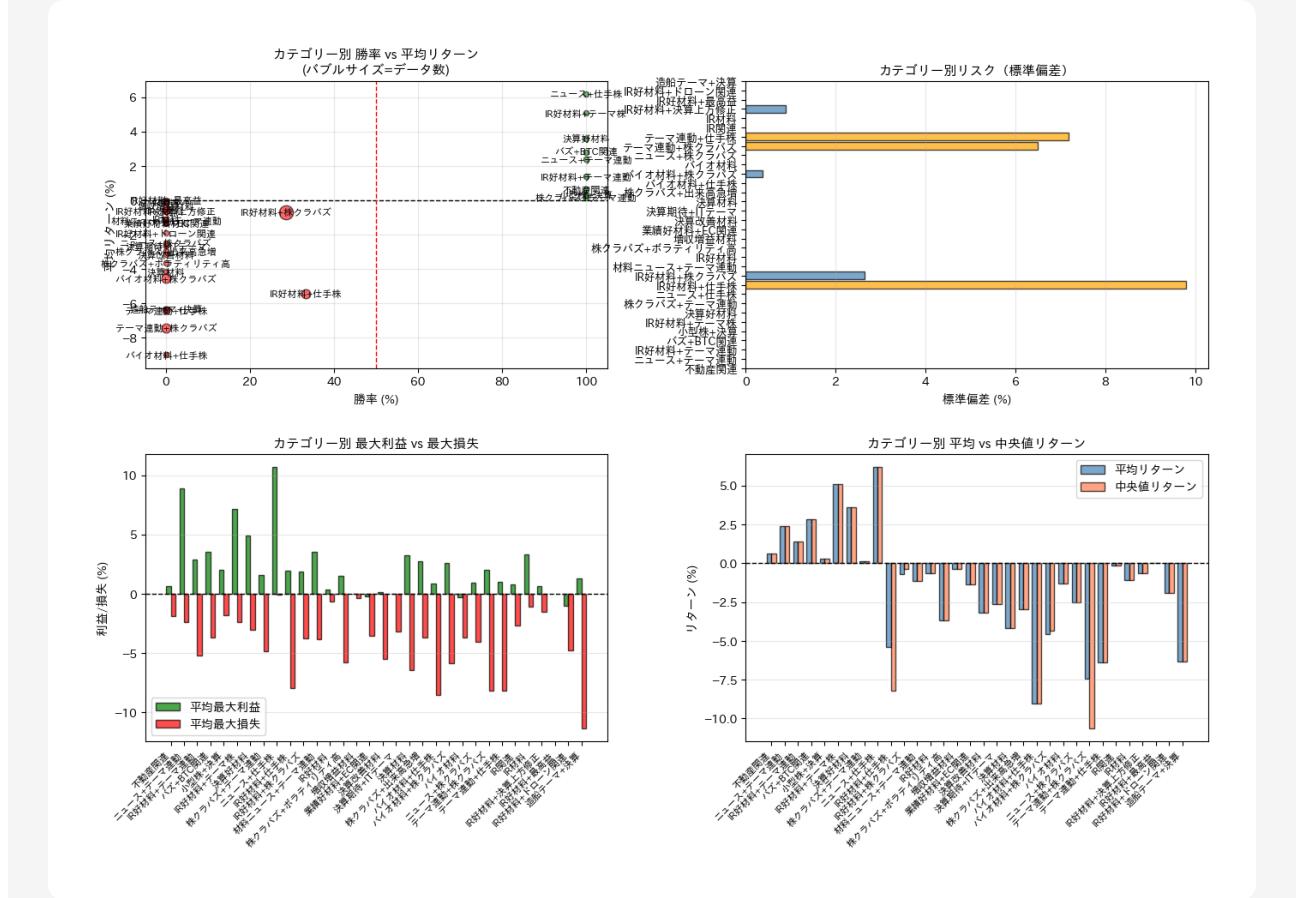
ボラティリティ	データ数	勝率	平均リターン	平均ボラ	平均最大利益	平均最大損失
低ボラ	15	26.7%	-0.28%	2.69%	0.59%	-2.10%
中ボラ	14	28.6%	-1.13%	6.15%	2.39%	-3.76%
高ボラ	15	26.7%	-4.75%	11.34%	3.39%	-7.95%

## 解説:

- 相関係数 (ボラ vs リターン) -0.530:** 負の相関。ボラティリティが高いほどリターンが低い傾向。
- 相関係数 (ボラ vs 勝率) 0.006:** ほぼ相関なし。ボラティリティと勝率に明確な関係はありません。
- 実践的示唆:** ボラティリティグループ別の平均最大損失を見て、適切な損切りライン (-2% vs -3%など) を設定すると良いでしょう。

## 11. カテゴリー詳細分析 ☆ NEW

**目的:** セクション4のカテゴリー分析をさらに深掘り。各カテゴリーのリスク・リターン特性を詳細に分析



カテゴリー	データ数	勝率	平均リターン	中央値リターン	標準偏差	平均最大利益	平均最大損失
不動産関連	1	100.0%	0.63%	0.63%	nan%	0.63%	-1.89%
ニュース+テーマ連動	1	100.0%	2.37%	2.37%	nan%	8.88%	-2.37%
IR好材料+テーマ連動	1	100.0%	1.38%	1.38%	nan%	2.91%	-5.20%
バズ+BTC関連	1	100.0%	2.80%	2.80%	nan%	3.50%	-3.73%
小型株+決算	1	100.0%	0.30%	0.30%	nan%	1.98%	-1.83%
IR好材料	1	100.0%	5.06%	5.06%	nan%	7.14%	-2.38%

カテゴリー	データ数	勝率	平均リターン	中央値リターン	標準偏差	平均最大利益	平均最大損失
+テーマ株							
決算好材料	1	<b>100.0%</b>	3.59%	3.59%	nan%	4.90%	-3.07%
株クラバズ +テーマ連動	1	<b>100.0%</b>	0.13%	0.13%	nan%	1.57%	-4.86%
ニュース+仕手株	1	<b>100.0%</b>	6.17%	6.17%	nan%	10.67%	-0.08%
IR好材料+仕手株	3	<b>33.3%</b>	-5.42%	-8.20%	9.79%	1.91%	-8.01%
IR好材料+株クラバズ	7	<b>28.6%</b>	-0.70%	-0.38%	2.65%	1.84%	-3.80%
材料ニュース +テーマ連動	1	<b>0.0%</b>	-1.16%	-1.16%	nan%	3.55%	-3.84%
IR好材料	1	<b>0.0%</b>	-0.64%	-0.64%	nan%	0.32%	-0.64%
株クラバズ +ボラティリティ高	1	<b>0.0%</b>	-3.67%	-3.67%	nan%	1.53%	-5.81%
增收増益材料	1	<b>0.0%</b>	-0.35%	-0.35%	nan%	0.00%	-0.35%
業績好材料 +EC関連	1	<b>0.0%</b>	-1.35%	-1.35%	nan%	-0.22%	-3.59%
決算改善材料	1	<b>0.0%</b>	-3.17%	-3.17%	nan%	0.13%	-5.53%

カテゴリー	データ数	勝率	平均リターン	中央値リターン	標準偏差	平均最大利益	平均最大損失
決算期待+ITテーマ	1	0.0%	-2.65%	-2.65%	nan%	0.00%	-3.20%
決算材料	1	0.0%	-4.17%	-4.17%	nan%	3.25%	-6.49%
株クラバズ+出来高急増	1	0.0%	-2.96%	-2.96%	nan%	2.71%	-3.69%
バイオ材料+仕手株	1	0.0%	-9.01%	-9.01%	nan%	0.86%	-8.58%
バイオ材料+株クラバズ	3	0.0%	-4.56%	-4.37%	0.38%	2.61%	-5.88%
バイオ材料	1	0.0%	-1.32%	-1.32%	nan%	-0.32%	-3.72%
ニュース+株クラバズ	1	0.0%	-2.50%	-2.50%	nan%	0.94%	-4.06%
テーマ連動+株クラバズ	3	0.0%	-7.46%	-10.62%	6.49%	1.99%	-8.23%
テーマ連動+仕手株	2	0.0%	-6.41%	-6.41%	7.17%	1.02%	-8.21%
IR関連	1	0.0%	-0.13%	-0.13%	nan%	0.76%	-2.67%
IR材料	1	0.0%	-1.11%	-1.11%	nan%	3.33%	-1.11%
IR好材料+決算上方修正	2	0.0%	-0.63%	-0.63%	0.88%	0.63%	-1.54%

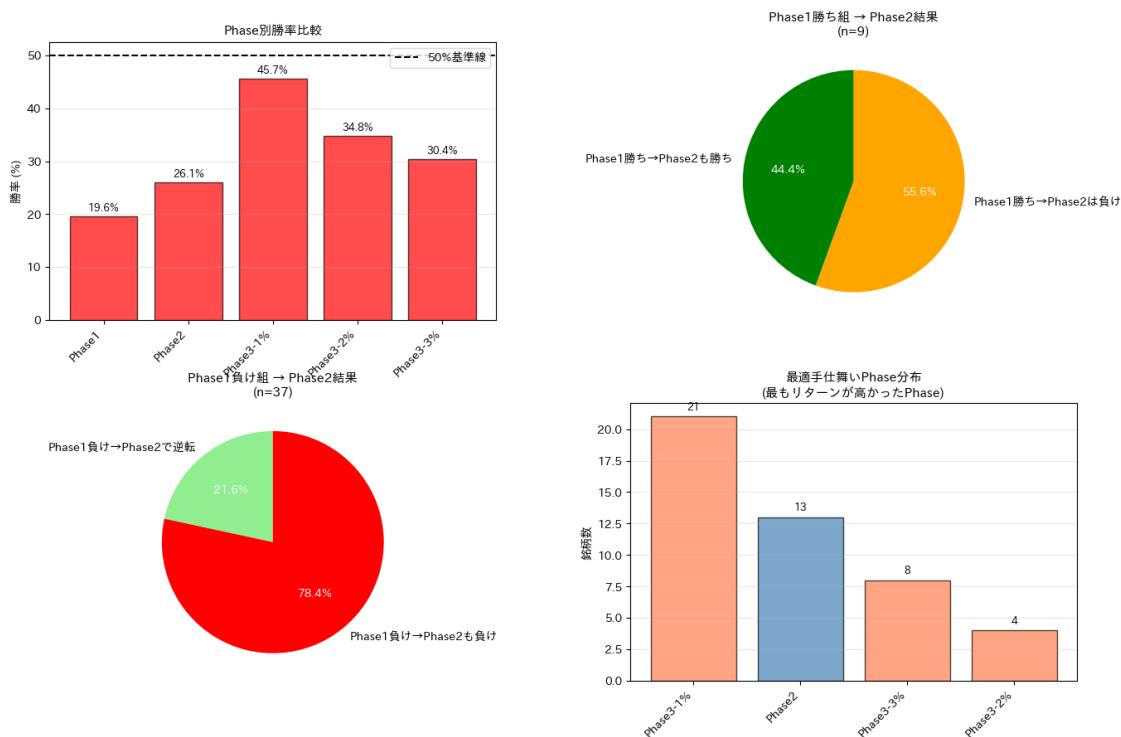
カテゴリー	データ数	勝率	平均リターン	中央値リターン	標準偏差	平均最大利益	平均最大損失
IR好材料+最高益	1	0.0%	0.00%	0.00%	nan%	nan%	nan%
IR好材料+ドローン関連	1	0.0%	-1.92%	-1.92%	nan%	-1.06%	-4.80%
造船テーマ+決算	1	0.0%	-6.33%	-6.33%	nan%	1.29%	-11.36%

### 解説:

- ・ **勝率 vs 平均リターン散布図:** 右上のカテゴリーが理想的（高勝率 × 高リターン）
- ・ **標準偏差（リスク）:** 高いほどリターンのブレが大きい。安定志向なら低標準偏差のカテゴリーを選ぶ
- ・ **平均 vs 中央値リターン:** 大きく乖離している場合、外れ値（大勝ち/大負け）に注意
- ・ **最大利益/損失:** カテゴリーごとの損切りラインの目安になる

## 12. 手仕舞い戦略分析 ☆ NEW

**目的:** Phase1で利確すべきか、Phase2まで待つべきか？損切りラインはどこが最適か？



## 重要な発見:

- Phase1勝ち組がPhase2も勝つ確率: 44.4%
- Phase1負け組がPhase2で逆転する確率: 21.6%
- 最適手仕舞いPhase: Phase3-1% (45.7%の銘柄で最高リターン)

## 実践的な戦略:

- Phase1で勝っている場合:**
  - Phase2まで保有すると44.4%の確率で勝ち続ける
  - Phase1で利確した方が安全
- Phase1で負けている場合:**
  - Phase2で逆転する確率は21.6%
  - 損切りを検討
- 損切りライン設定:**
  - 最も多くの銘柄で最高リターンを記録したのは「Phase3-1%」
  - このPhaseの設定を基本戦略として採用することを推奨

## | 13. 全銘柄一覧 (Phase2リターン順)

ティッcker	銘柄名	カテゴリー	日付	Phase1 リターン	Phase2 リターン	前場出来高
9552.T	M&A総研ホールディングス	ニュース+仕手株	2025-11-04	6.88%	6.17%	653,900
6366.T	千代田化工建設(株)	IR好材料+仕手株	2025-11-06	6.08%	5.45%	4,517,600
1798.T	守谷商会	IR好材料+テマ株	2025-11-04	4.46%	5.06%	11,600
5994.T	ファインシスター	決算好材料	2025-11-05	-0.07%	3.59%	60,600
4436.T	ミンカブ・ジ・インフォノイド	IR好材料+株クラバズ	2025-11-04	2.58%	3.22%	19,700
3350.T	メタプラネット	バズ+BTC関連	2025-11-05	-2.56%	2.80%	17,813,000
3997.T	トレードワクス	ニュース+テマ連動	2025-11-04	-0.59%	2.37%	478,500
2445.T	タカミヤ	IR好材料+株クラバズ	2025-11-04	-0.24%	1.71%	195,000
6240.T	ヤマシンフィルタ(株)	IR好材料+テマ連動	2025-11-06	-1.07%	1.38%	1,028,100
8912.T	エリアクエスト	不動産関連	2025-11-05	0.00%	0.63%	28,600
6524.T	湖北工業	小型株+決算	2025-11-07	-1.07%	0.30%	126,800

ティック カード	銘柄名	カテゴリー	日付	Phase1 リターン	Phase2 リターン	前場出来高
6994.T	指月電機製作(株)	株クラバズ+テーマ連動	2025-11-06	-1.97%	0.13%	431,700
3082.T	(株)きちりホールディングス	テーマ連動+株クラバズ	2025-11-06	0.22%	0.00%	3,200
7069.T	(株)サイバー・バズ	IR好材料+株クラバズ	2025-11-06	0.00%	0.00%	nar
3110.T	日東紡績	IR好材料+最高益	2025-11-07	0.00%	0.00%	nar
2700.T	木徳神糧	IR好材料+決算上方修正	2025-11-07	0.00%	0.00%	0
6035.T	IRジャパン	IR関連	2025-11-05	-2.67%	-0.13%	37,800
7255.T	桜井製作所	增收増益材料	2025-11-05	-0.35%	-0.35%	200
8014.T	蝶理	IR好材料+株クラバズ	2025-11-04	0.38%	-0.38%	10,300
4237.T	フジプレアム(株)	IR好材料	2025-11-06	0.00%	-0.64%	3,400
7859.T	アルメディオ	IR材料	2025-11-05	-1.11%	-1.11%	396,100
4082.T	第一稀元素化学工業	材料ニュース+テーマ連動	2025-11-04	1.01%	-1.16%	3,597,000
6328.T	荏原実業	IR好材料+決	2025-11-07	0.11%	-1.25%	69,800

ティッcker	銘柄名	カテゴリー	日付	Phase1 リターン	Phase2 リターン	前場出来高
算上方修正						
2160.T	ジーエヌアイグループ	バイオ材料	2025-11-05	-3.64%	-1.32%	515,500
4259.T	エクサウェイザーズ	テーマ連動+仕手株	2025-11-04	-1.48%	-1.33%	654,000
3660.T	アイスタイル	業績好材料+EC関連	2025-11-05	-3.59%	-1.35%	785,700
6022.T	赤阪鐵工所(株)	IR好材料+株クラバズ	2025-11-06	-0.85%	-1.88%	44,800
6232.T	ACSL	IR好材料+ドローン関連	2025-11-05	-4.61%	-1.92%	509,800
1844.T	大盛工業	ニュース+株クラバズ	2025-11-04	-2.81%	-2.50%	190,900
3798.T	ULSグループ	決算期待+ITテーマ	2025-11-07	-2.79%	-2.65%	45,500
7746.T	岡本硝子	株クラバズ+出来高急増	2025-11-07	-3.20%	-2.96%	2,955,900
7983.T	ミロク	決算改善材料	2025-11-05	-4.45%	-3.17%	13,200
8105.T	堀田丸正	株クラバズ+ボラティリティ高	2025-11-07	-4.43%	-3.67%	1,440,700

ティッcker	銘柄名	カテゴリー	日付	Phase1 リターン	Phase2 リターン	前場出来高
7729.T	(株)東京精密	IR好材料+株クラバズ	2025-11-06	-4.08%	-3.68%	285,200
7826.T	フルヤ金属	IR好材料+株クラバズ	2025-11-07	-1.24%	-3.88%	1,758,700
7711.T	助川電気工業	決算材料	2025-11-07	-5.26%	-4.17%	534,300
4875.T	メディシノバ	バイオ材料+株クラバズ	2025-11-04	0.48%	-4.31%	356,100
219A.T	Heartseed(株)	バイオ材料+株クラバズ	2025-11-06	-3.63%	-4.37%	551,000
4570.T	(株)免疫生物研究所	バイオ材料+株クラバズ	2025-11-06	-3.28%	-5.00%	1,655,300
7018.T	内海造船	造船テーマ+決算	2025-11-07	-4.48%	-6.33%	181,300
2743.T	ピクセルカンパニーズ	IR好材料+仕手株	2025-11-04	-4.92%	-8.20%	458,800
4875.T	メディシノバ	バイオ材料+仕手株	2025-11-06	-7.30%	-9.01%	137,700
7746.T	岡本硝子	テーマ連動+株クラバズ	2025-11-04	-1.85%	-10.62%	3,833,000
3914.T	JIG-SAW	テーマ連動	2025-11-04	-10.08%	-11.48%	83,000

ティック マーク	銘柄名	カテゴリー	日付	Phase1 リターン	Phase2 リターン	前場出来高
		+仕手 株				
6993.T	大黒屋ホール ディングス(株)	テーマ 連動 +株クラバズ	2025-11-06	-5.88%	-11.76%	11,338,100
4082.T	第一稀元素化 学工業(株)	IR好材 料+仕 手株	2025-11-06	-7.11%	-13.52%	1,307,100

生成日時: 2025-11-10 19:05:04