



# 研究発表レポート

～ 移動平均線とその応用 ～

**West Village Investment** 株式会社  
岩本祐介





# 研究発表

## MULTICHARTS DATA

研究発表のurlは以下のとおりです。

<http://www.panrolling.com/seminar/multicharts/study/>

※インジケータやストラテジーの挿入方法等の基本的な使い方、および、最適化の方法等は、第1回のボリンジャーバンド前編、後編をご覧ください。

第2回

コロナショックによる暴落に関して - システムトレード的な見地から考察 - 

第1回

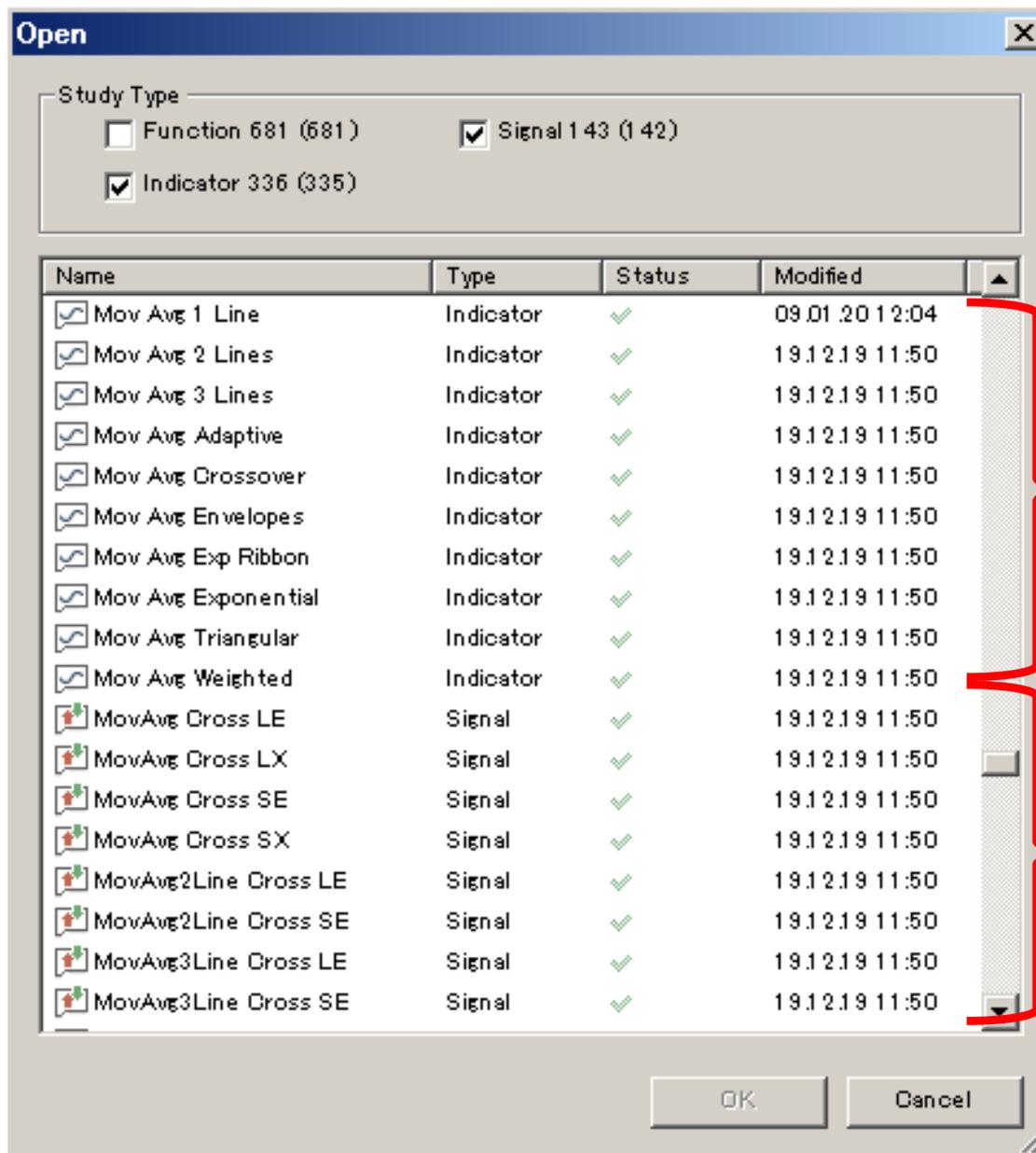
ボリンジャーバンド 前編  (資料 ) | 後編  (資料 )

試用版

マルチチャート 試用版 >> お申込みはこちら 



# マルチチャートでの移動平均線



インジケータは10パターン

ストラテジーは8パターン



# マルチチャートでの代表的な移動平均線インジケータ

## ■ 単純移動平均線 (SMA:simple moving average)

パワーランゲージの記述方法 : **Average(価格、期間)**

## ■ 指数平滑移動平均線 (EMA:exponential moving average)

パワーランゲージの記述方法 : **Xaverage(価格、期間)**

※) 上記した価格と期間には、

- ・ 価格=Open、High、Low、Closeから選択するのが基本。
- ・ 期間=移動平均を計算する期間を選択する (パラメータとして最適化可能) 。



# 指数平滑移動平均線を利用した ストラテジー例①-1

『魔術師リンダ・ラリーの短期売買入門』より  
～押し/戻りの戦略（聖杯、The Holy Grail）の検証例

■買いエントリーのルール（売りは( )内)

- ①.20期間指数平滑移動平均線に向かって、押し（戻り）が入るところを探す。
- ②.14期間ADXが30以上になり、上昇していなければならない
- ③.価格が20期間指数平滑移動平均線に触れたとき、逆指値の買い（売り）注文を置く。





# 指数平滑移動平均を利用した ストラテジー例①-2

- ・サクソバンク証券CFD（225JP）の5分足で検証。  
なお、検証期間は、2018年1月から2020年3月31日まで。

ルールはシンプル化するために下記の通りにした。

## ■買いエントリーのルール

- ①.5分足安値が20期間EMAを下方クロス、ただし、安値がクロスした終値はEMAの上。
  - ②.14期間ADXが30以上
- 以上の条件合致の場合に、買いエントリー（8時45分から14時30分までとした）。

## ■売りエントリーのルール

- ①.5分足高値が20期間EMAを上方クロス、ただし、高値がクロスした終値はEMAの下。
  - ②.14期間ADXが30以上
- 以上の条件合致の場合に、売りエントリー（8時45分から14時30分までとした）。

## ■決済

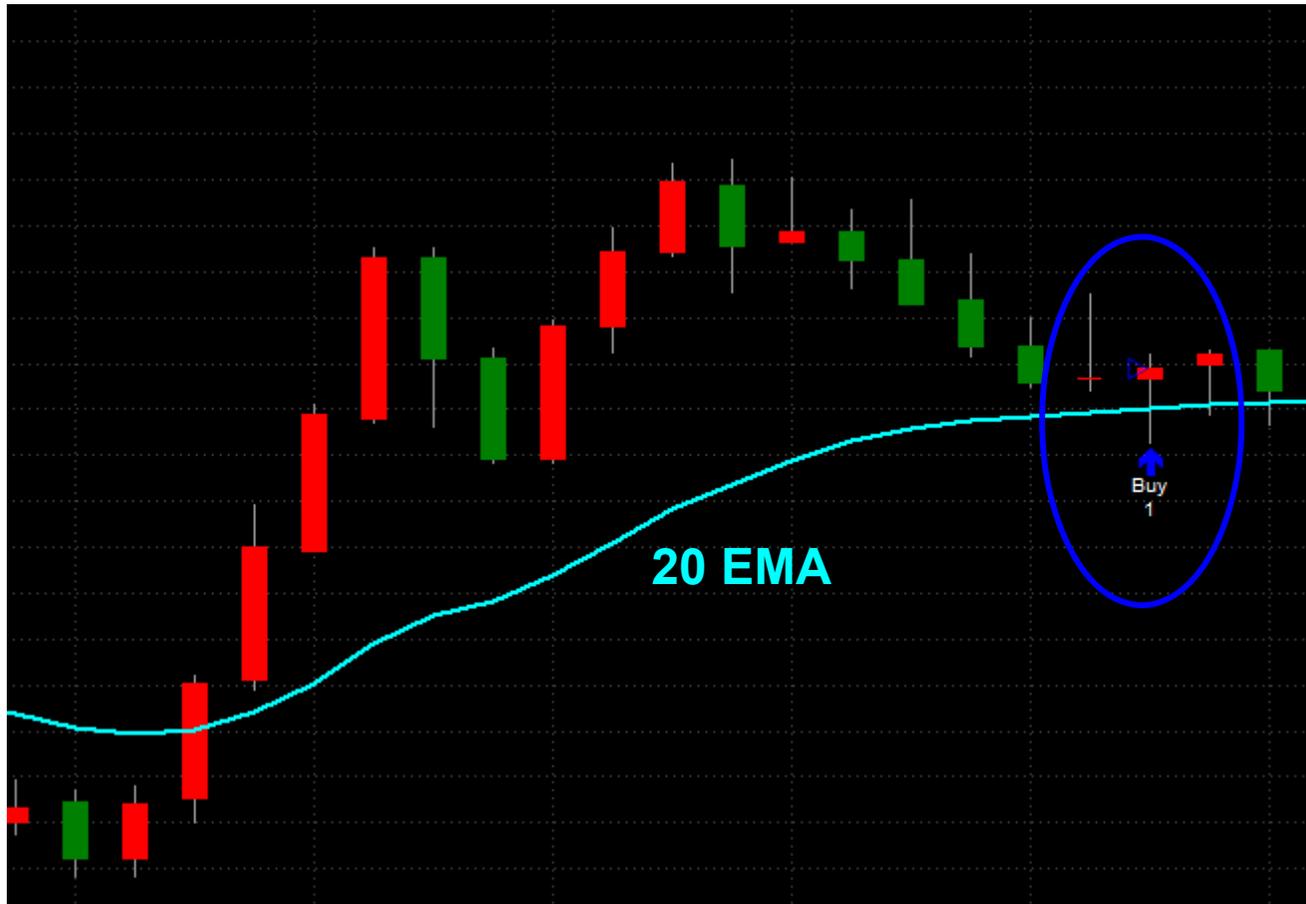
15時に決済を行う。



# 指数平滑移動平均を利用した ストラテジー例①-3

## ■買いエントリーのルール

- ①.5分足安値が20期間EMAを下方クロス、ただし、安値がクロスした終値はEMAの上。
  - ②.14期間ADXが30以上
- 以上の条件合致の場合に、買いエントリー（8時45分から14時30分までとした）。





# 指数平滑移動平均を利用した ストラテジー例①-4

## ■ 売リエントリーのルール

- ①.5分足高値が20期間EMAを上方クロス、ただし、高値がクロスした終値はEMAの下。
  - ②.14期間ADXが30以上
- 以上の条件合致の場合に、売リエントリー（8時45分から14時30分までとした）。

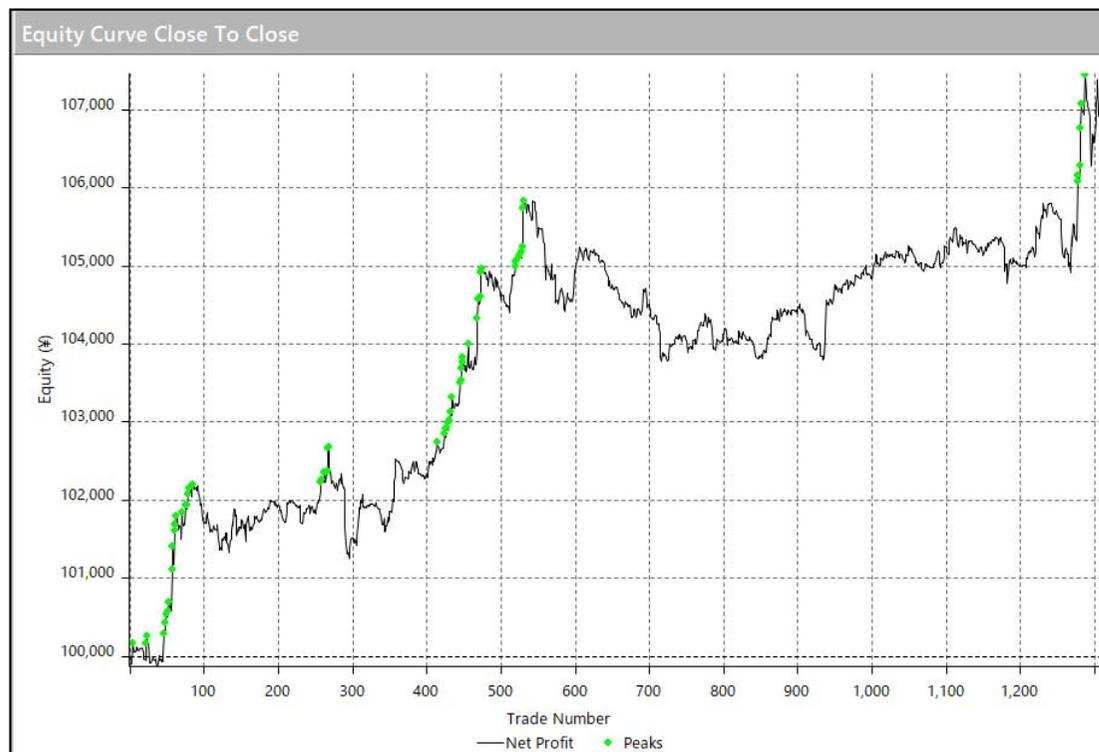




# 指数平滑移動平均を利用した ストラテジー例①-5

■EMA条件のみの場合（ADX条件は入れていない）

Total Trade Analysis			
	All Trades	Long Trades	Short Trades
Total # of Trades	1312	674	638
Total # of Open Trades	0	0	0
Number Winning Trades	547	303	244
Number Losing Trades	761	368	393
Percent Profitable	41.69%	44.96%	38.24%
Avg Trade (win loss)	¥5	¥6	¥4

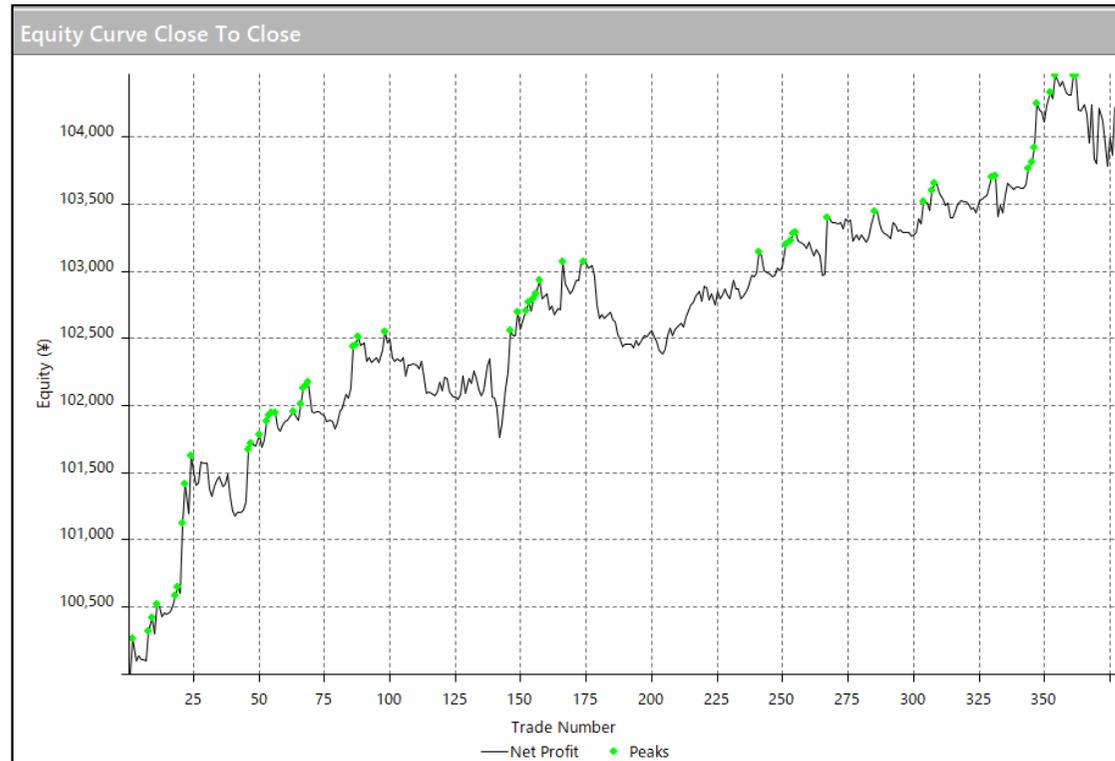




# 指数平滑移動平均を利用した ストラテジー例①-6

## ■EMA and ADX条件の場合

Total Trade Analysis			
	All Trades	Long Trades	Short Trades
Total # of Trades	377	188	189
Total # of Open Trades	0	0	0
Number Winning Trades	193	108	85
Number Losing Trades	183	79	104
Percent Profitable	51.19%	57.45%	44.97%
Avg Trade (win loss)	¥11	¥14	¥8





# 指数平滑移動平均を利用した ストラテジー例①-7

## ■プログラムの例（ロング）

エントリー：

```
if time >= 845 and time <= 1430  
and low cross under Xaverage(close,20)  
and close > Xaverage(close,20)  
and ADX(14) >= 30  
then buy this bar on close;
```

エグジット：

```
if time = 1500  
and marketposition = 1  
then sell this bar on close;
```



# 指数平滑移動平均を利用した ストラテジー例①-8

## ■プログラムの例（ショート）

エントリー：

```
if time >= 845 and time <= 1430  
and high cross over Xaverage(close,20)  
and close < Xaverage(close,20)  
and ADX(14) >= 30  
then sellshort this bar on close;
```

エグジット：

```
if time = 1500  
and marketposition = -1  
then buytocover this bar on close;
```



**MULTI**CHARTS  
Raising The Trading Standard

パンローリングはマルチチャートの日本の正規代理店です。マルチチャートの試用版は下記のURLまたは右下のQRコードからお申込みください。

<http://www.tradersshop.com/bin/showprod?c=2011174100005>

まずはお試しく下さい！

マルチチャート日本語サイトはこちら

<http://www.panrolling.com/seminar/multicharts/>





# West Village Investment 株式会社の トレードシステムの**無料**体験

- ・ 下記のURL、または右下のQRコードからお申込みください。

<http://www.tradersshop.com/bin/showprod?c=2011387800006>

※トレーダーズショップの「ご注文状況」ページからダウンロード頂けます。

## 利用条件・動作環境

- ・ マルチチャート(試用版でもOK)
- ・ サクソバンク証券のLIVE口座
- ・ 4月末までお試しいただけます。





# 2020年5月16日 プロフィール225JPシステム オンライン・セミナー

機関投資家や公募ファンドのシステムとして採用された実績のあるWest Village Investment 株式会社が9年ぶりに個人投資家向けにロジック・プログラム完全公開のセミナーを開催します。

マーケットプロフィール（TPO）の知識をベースとしたロジックの自動売買化を実現しました。

<http://www.tradersshop.com/bin/showprod?c=2011387900003>

## ■セミナーの主要な内容

二回に分けて受講ができますので安心して理解を深めることができます。

1回目 完全ロジック解説、自動売買設定

2回目 システムトレード全般

通常価格 400,000円+税 → **4月30日まで早期割引 300,000円+税**

自動売買システム  
プロフィール  
225JP  
5/16 ±  
ロジックを完全公開!  
オンラインセミナー