



研究発表レポート⑤

～ ストキャスティクス ～

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5回 Relative Strength Index (RSI) 動画▶ (資料📄)

第4回 Average True Range (ATR) 動画▶ (資料📄)

第3回 移動平均線とその応用 動画▶ (資料📄)

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↓



ストキャスティクスとは

■ストキャスティクス (Stochastic) の計算式

・ファスト・ストキャスティクス

$$\%K = (\text{Close} - \text{Low}(n)) \div (\text{High}(n) - \text{Low}(n)) \times 100(\%)$$

High(n) : n期間の高値

Low(n) : n期間の安値

$\%D = m$ 期間の $\%K$ の平均 (通常は、単純移動平均)

・スロー・ストキャスティクス

$$\text{Slow}\%K = \%D$$

$\text{Slow}\%D = x$ 期間の $\text{Slow}\%K$ の平均 (通常は、単純移動平均)



マルチチャートのストキャステイクス

Stochastic(PriceH, PriceL, PriceC, StochLength, SmoothingLength1, SmoothingLength2, SmoothingType, var0, var1, var2, var3)

PriceH : 高値

PriceL : 安値

PriceC : 終値

StochLength : %Kの計算期間

SmoothingLength1 : %Dの計算期間

SmoothingLength2 : Slow%Dの計算期間

SmoothingType : 移動平均の計算方法

var0 : %K

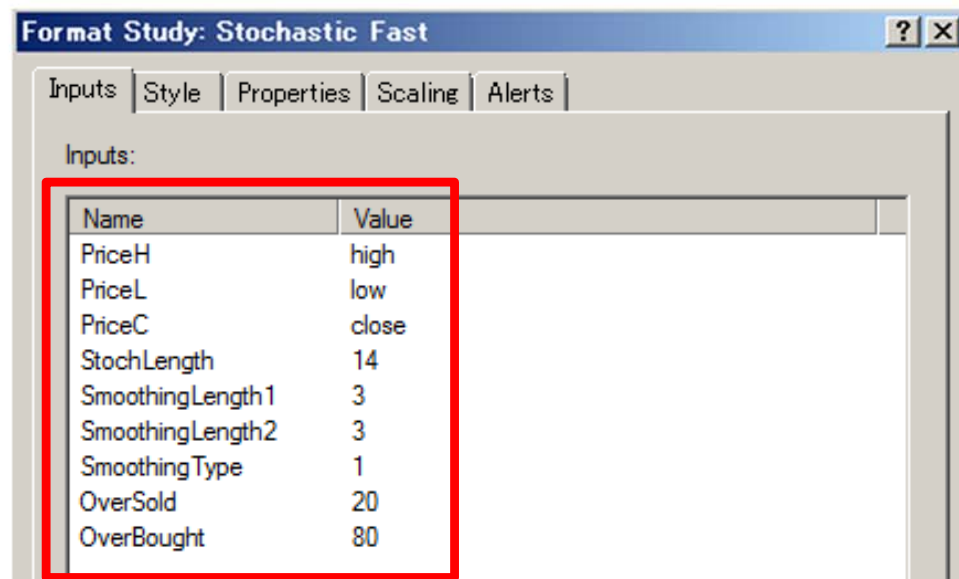
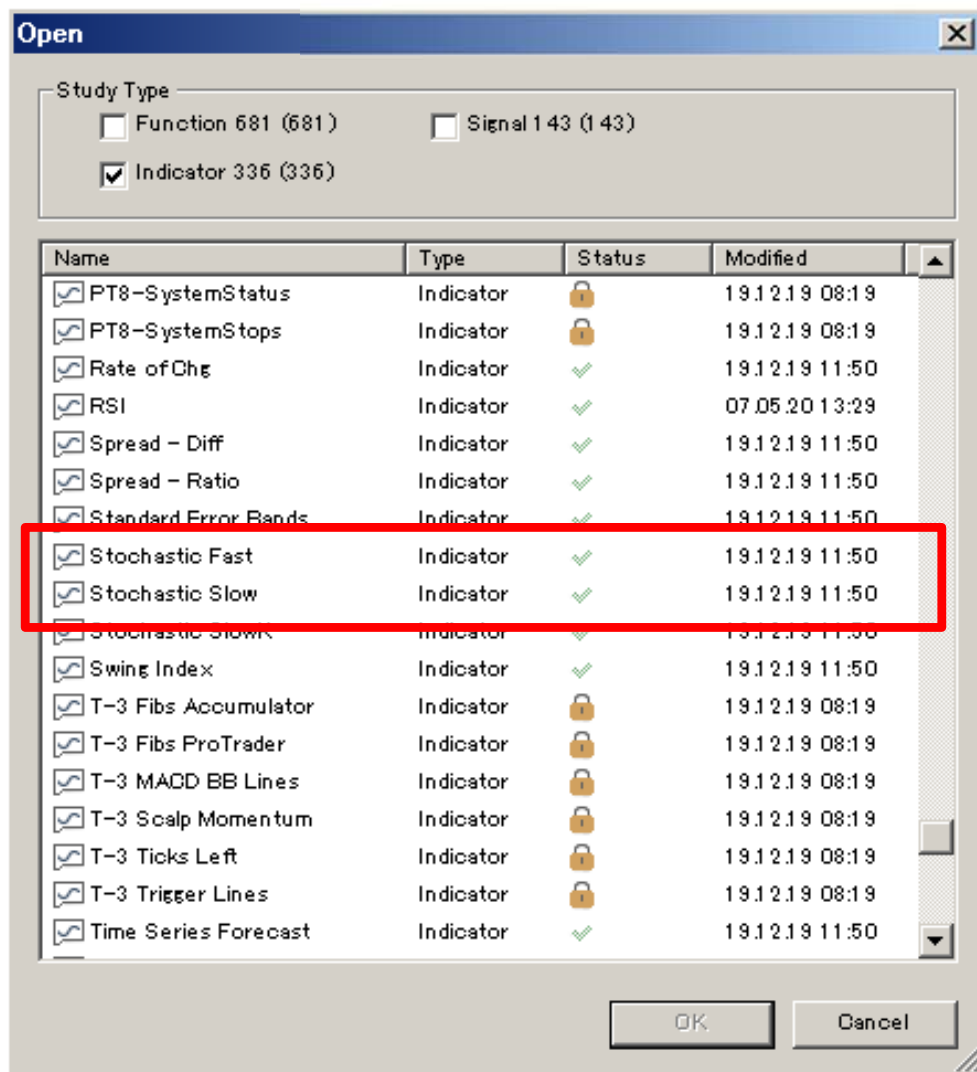
var1 : %D

var2 : Slow%K

var3 : Slow%D



マルチチャートでのストキャステイクス（インジケータ）



Smoothing Type :

1:単純移動平均

2:指数平滑移動平均

OverSold : 売られ過ぎの数値

OverBought : 買われ過ぎの数値

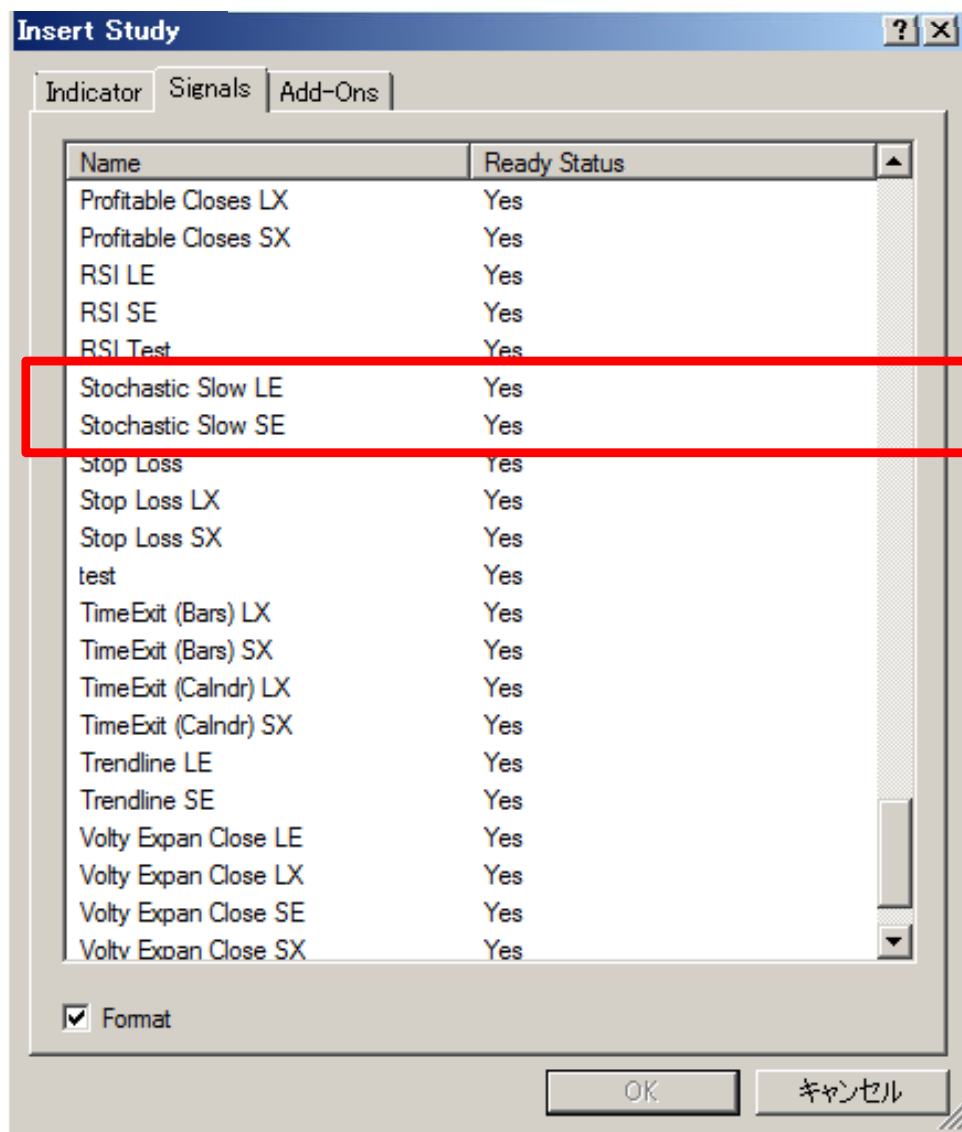


マルチチャートでのストキャスティクス (インジケーター)





マルチチャートでのストキャスティクス（ストラテジー）



- ・ Stochastic Slow LE
（ロング・エントリー）
Slow%KはOverSold(20) より下 and
Slow%KがSlow%Dを上方クロスしたら
（Cross Over）ロング
- ・ Stochastic Slow SE
（ショート・エントリー）
Slow%KはOverBought(80) より上 and
Slow%KがSlow%Dを下方クロスしたら
（Cross Under）ショート



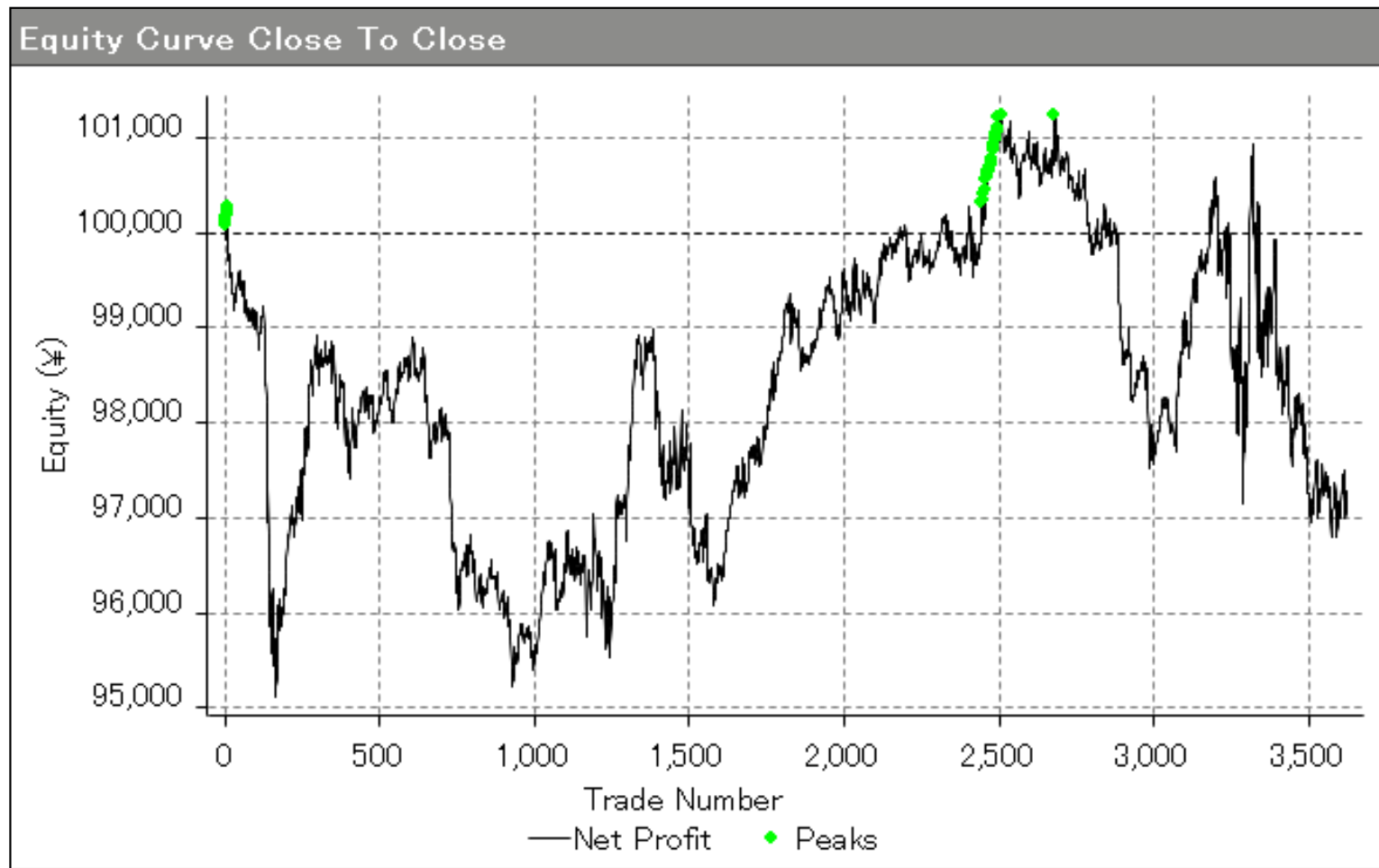
マルチチャートでのストキャステイクス (ストラテジー)





マルチチャートでのストキャスティクス（ストラテジー）

5分足：JP225.I（CFD）、2018年1月から2020年6月3日まで





マルチチャートでのストキャスティクス（ストラテジー）

『アルゴトレードの入門から実践へ』

著者 ケビン・J・ダービー

仕掛け23 ストキャスティクスの交差

・パラメータ

%K : 8 , %D(Slow%K) : 23 , Slow%D : 22

・ Stochastic Slow LE (ロング・エントリー)

Slow%KがSlow%Dを上方クロスしたら(Cross Over)ロング

・ Stochastic Slow SE (ショート・エントリー)

Slow%KがSlow%Dを下方クロスしたら(Cross Under)ショート

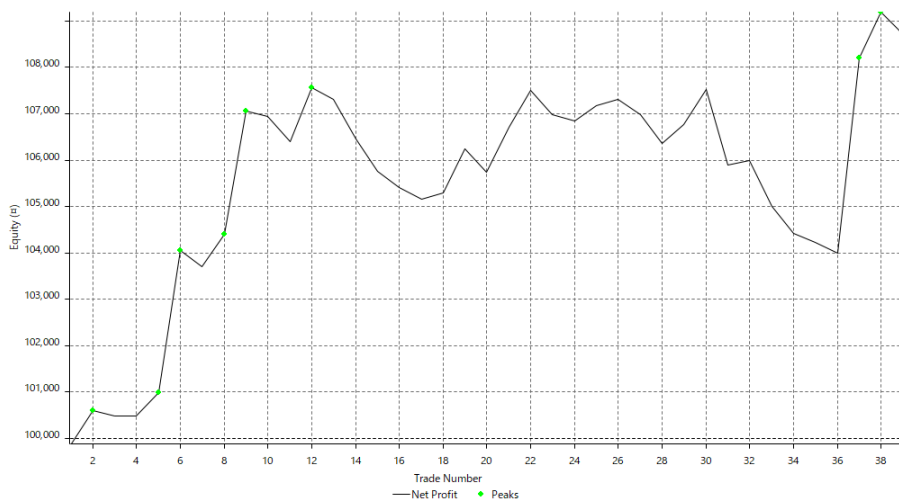




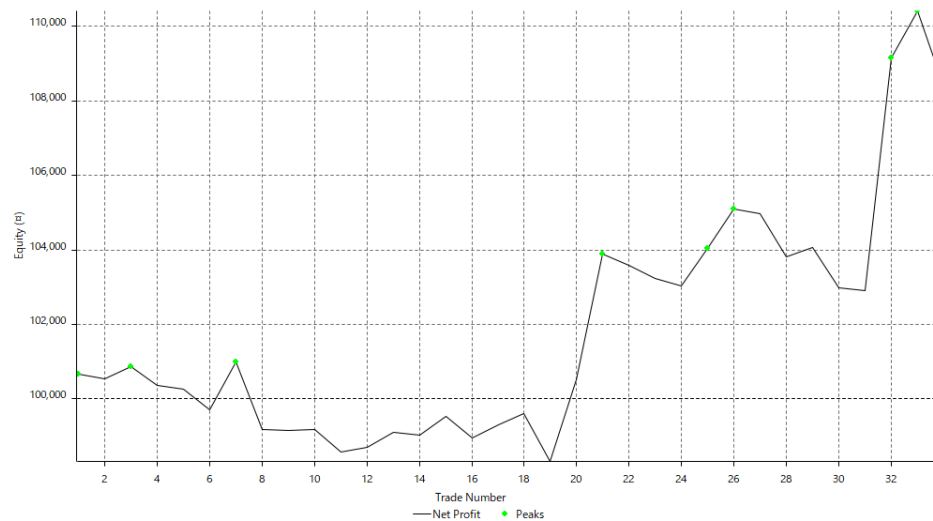
マルチチャートでのストキャステイクス (ストラテジー)

2017年1月から2020年6月3日まで

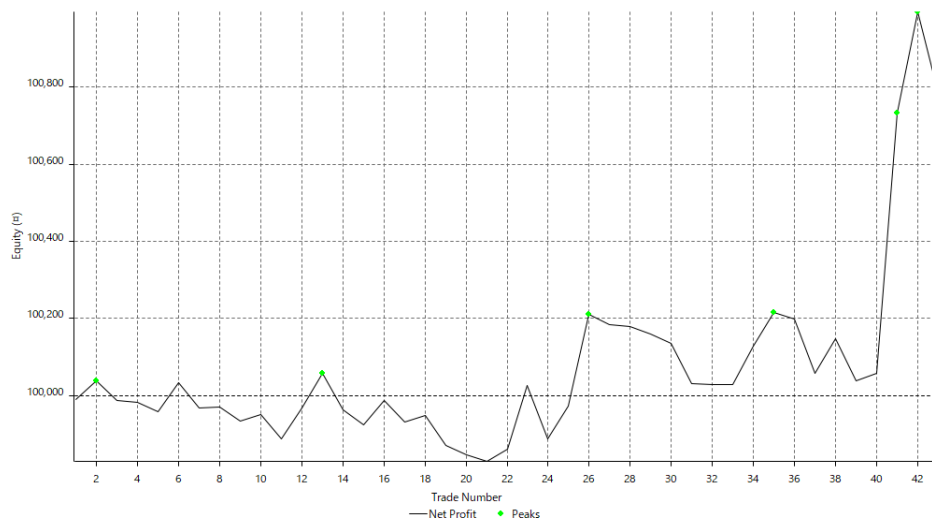
JP225.I (日足)



US30.I (日足)



US500.I (日足)





マルチチャートでのストキャスティクス（ストラテジー）

『バースタインのデイトレード入門』

著者 ジェイク・バーンスタイン
ストキャスティック・ポップ

（パラメータ）

%K : 14 , %D(Slow%K) : 3 , Slow%D : 3 , OverBought(75) ,
OverSold(25)

< Entry >

（ロング・エントリー）

Slow%KがOverBoughtを上方クロスしたら(Cross Over)、ロング
（ショート・エントリー）

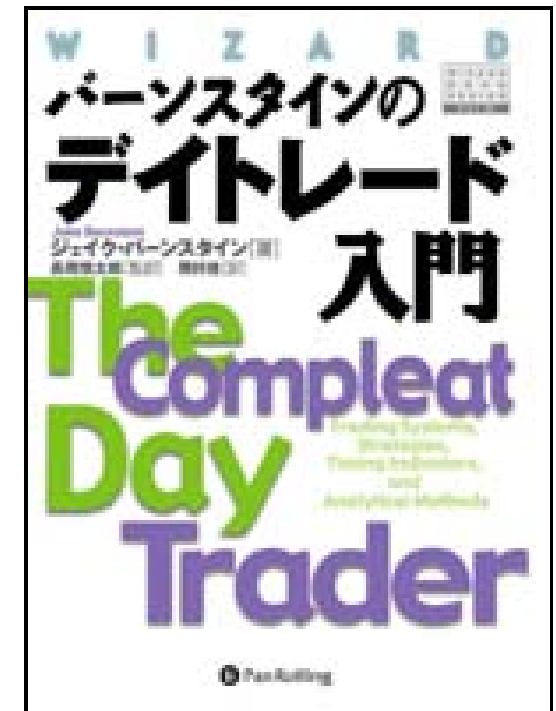
Slow%KがOverSoldを下方クロスしたら(Cross Under)、ショート

< Exit >

（ロング・エグジット）

Slow%KがSlow%Dを下方クロスしたら、ロングのエグジット
（ショート・エグジット）

Slow%KがSlow%Dを上方クロスしたら、ショートのエグジット





マルチチャートでのストキャステイクス (ストラテジー)

(参考)

```
inputs: Length( 14 ), OverBought( 75 ), OverSold( 25 );  
vars: var0( 0 ), var1( 0 ), var2( 0 ), var3( 0 );
```

```
Value1 = Stochastic( H, L, C, Length, 3, 3, 1, var0, var1, var2, var3 );
```

```
//Entry
```

```
if var2 crosses over OverBought then  
    Buy ( "StochPop_LEn" ) this bar on close ;
```

```
if var2 crosses under OverSold then  
    Sell Short ( "StochPop_SEn" ) this bar on close ;
```

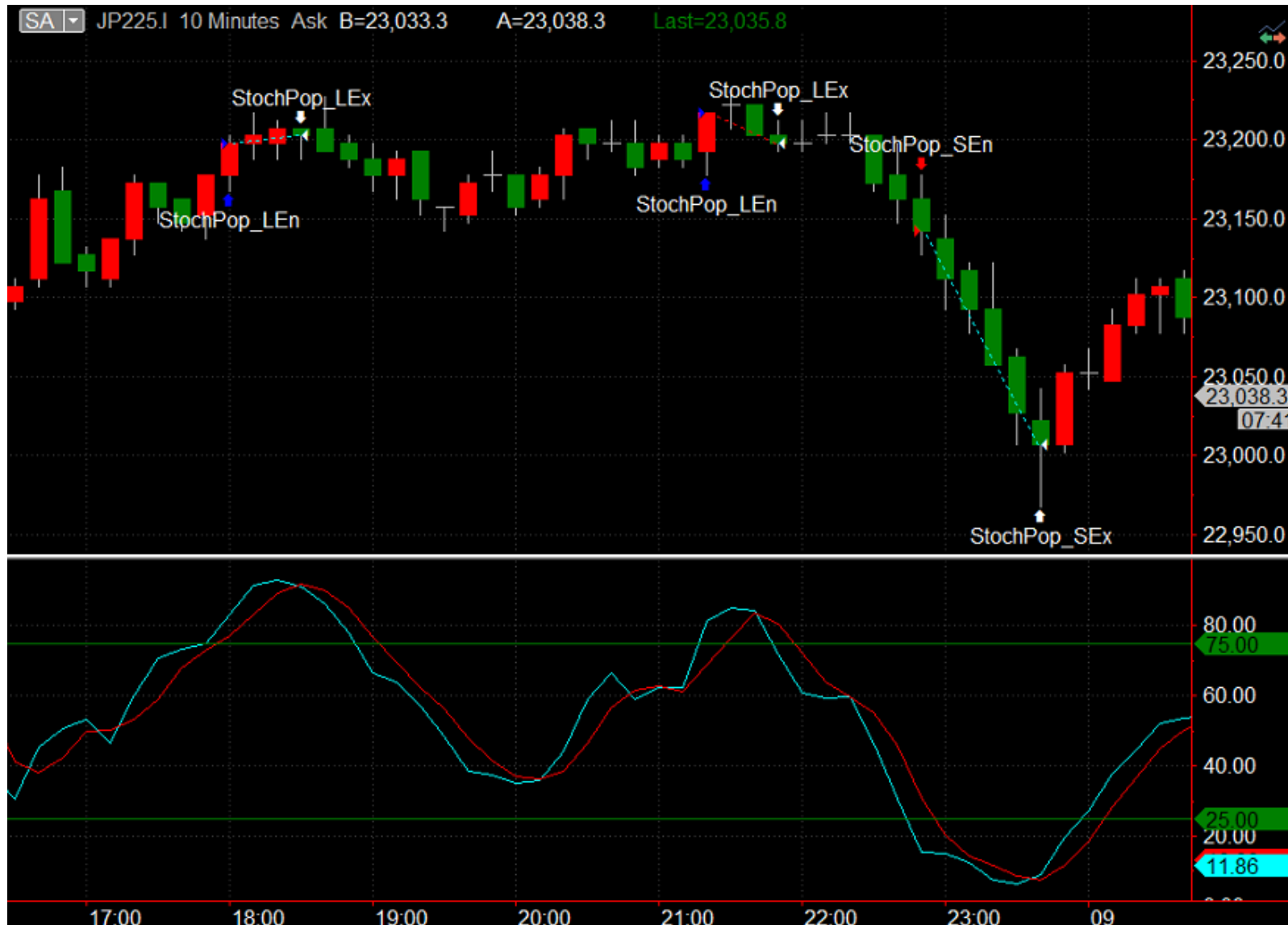
```
//Exit
```

```
if var2 crosses under var3 then  
    Sell ( "StochPop_LEx" ) this bar on close ;
```

```
if var2 crosses over var3 then  
    Buytocover ( "StochPop_SEx" ) this bar on close ;
```



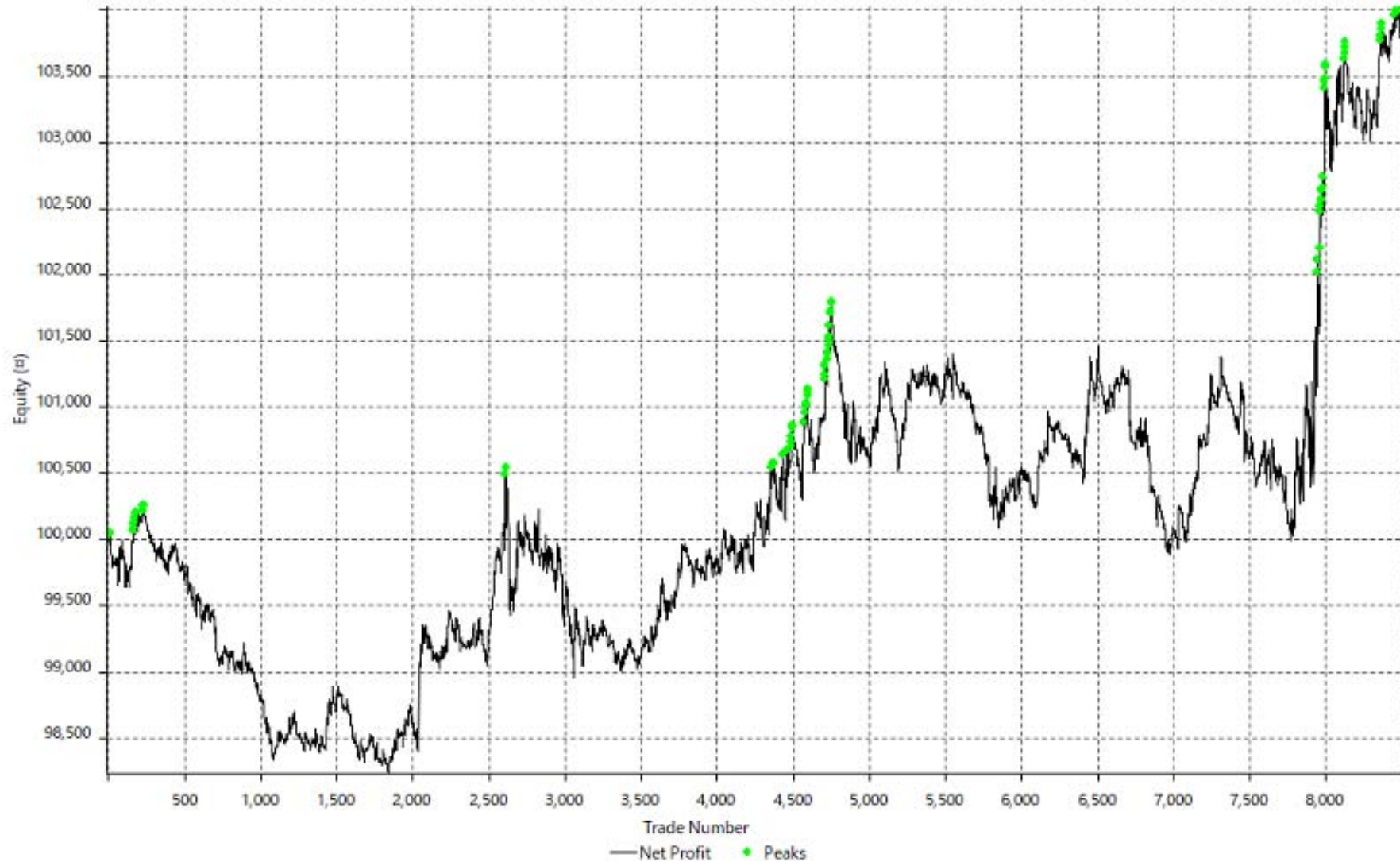
マルチチャートでのストキャステイクス (ストラテジー)





マルチチャートでのストキャステイクス (ストラテジー)

Equity Curve Close To Close





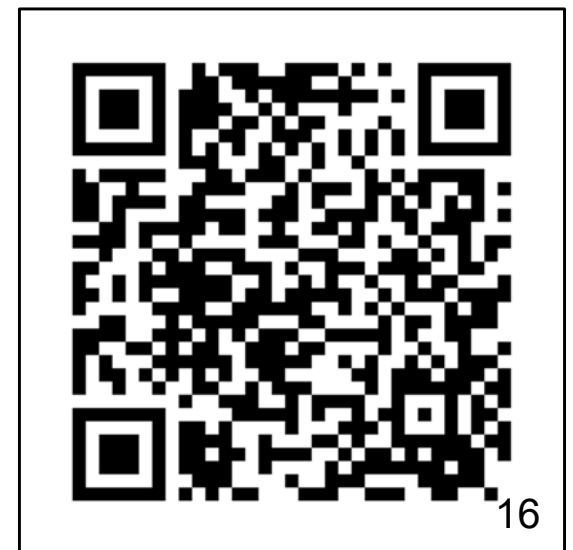
MULTICHARTS

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。

まずはお試してください！

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





パンローリングチャンネル



第1回 10分トレードから学ぶエントリー&エグジット編

<https://youtu.be/KJ3gMlfMLpo>

第2回 10分トレードから学ぶ早期エグジット編

<https://youtu.be/rSVRIIs61vKc>

第3回 10分トレードから学ぶ利益確定&ロスカット編

<https://youtu.be/ykErg3MtvA4>

第4回 10分トレードから学ぶまとめ編

<https://youtu.be/OiAlQOeKIKY>