

(令和2年11月16日)

< ワンポイントレッスン (実践) >  
( 指標の選択・その2(トレンド系) )

テクニカルにタイミングを測る場合のオシレータ系シグナルに続き、今回はトレンド系のシグナルについて。トレンド系は、順張り・逆張り双方について適用することができるので比較的判り易いシグナルと思います。移動平均線が代表的なものですが、行き過ぎが無い場合は追随、行き過ぎが出ればポジションの解消、あるいは逆張りとなりますが、移動平均線の計算の期間や直近にウェイトにかけるなど応用ができるので自分用に変形できるのも興味のあるところです。また、論理的であっても、13週・26週移動平均線のゴールデン・クロスなどうまくパラメタを設定しないと適合しないケースもあり単純ではありません。個別銘柄への適用よりも指数や平均株価など、市場全体への適用の方が安定している。経験則です。この処の株価上昇で日経平均の13週移動平均乖離率は上昇していますが、下方への乖離の様にファットテールを形成することは少なく、ボラティリティが小さい時には7.5%、一般には10%越えが上昇ピッチを落としてくる一つの目途にしています。

(日経平均・13週移動平均乖離率)

