

トレンドインジケータ

トレンド系指標は、その名が示すとおり、株式や証券CFDのトレンドを示すものです。証券CFDのトレーダーは、値動きが一定のトレンドにある時に資金を最大限活用します。したがって、トレンドの方向と、その調整局面を見極められることが極めて重要です。トレンド開始直後にポジションを持ち（エントリー）、トレンド終了直後にトレードを終了（エグジット）することができれば、かなりの成功を収めることができるでしょう。では、以下のいくつかのトレンド系指標について見てみましょう。



Average Directional Index (ADI) Indicator

ウェルズ・ワイルダー・ジュニアが開発したもので、ADX とは平均方向性指数を指します。価格トレンドの存在を確認すると広く考えられています。

「ADX」は、2本の指数を使って「トレンドの存在・方向性・強弱」を判断するオシレーター系のテクニカル指標で、日本名で『方向性指数』と呼ばれます。

下記の4本の構成指数（※）を使って「トレンドの存在・方向性・強弱」を判断し、通常DMIと併せて使用するのが一般的です。



- ADXが上向きに推移している状態は相場に勢いがついていることを示し、一般的に、数値が高い時はトレンドが強い局面（トレンド相場）、低い時はトレンドを失っている局面（レンジ相場）を示します。従って、ADXが「上向きに変化→トレンドの開始」、「上昇中→トレンドの継続」、「下向きに変化→トレンドの終了」、「下降中→トレンドが無い状態」と判断します。
- ADXとADXRの関係で考えた場合、[ADX > ADXR]の状態は勢いがありトレンド相場、[ADX < ADXR]の状態は勢いが無くレンジ相場であると見ます。また、ADXがADXRを上抜いた地点を売買シグナルと判断します。

+DIが-DIを上抜いた後、ADXが-DIを上抜いた時を買いシグナル、+DIが-DIを下抜いた後、ADXが+DIを上抜いた時を売りシグナルと見ます。

- +DI (PDI) : 上昇する方向性指数。上昇の可能性の大きさを表します。
- -DI (MDI) : 下落する方向性指数。下降の可能性の大きさを表します。

計算式

$ADX = MA \left[\frac{(+DI) - (-DI)}{(+DI) + (-DI)} \right] \times 100;$

+DI – 上昇する方向性指数。

-DI – 下落する方向性指数。

Moving Average (MA) Indicator

SMA は、単純移動平均 (Simple Moving Average) の頭文字を取ったものです。価格曲線を滑らかにし、トレンドの特定向上に役立ちます。選択した SMA の期間が長いほど、局線は滑らかなものとなります。

移動平均は最も利用されているテクニカル分析の一つで、ある基準日を基点に、過去の一定期間における価格の平均値を連続して計算しグラフ化したものです。英語表記では「Moving Average (MA)」と表記されます。



一般に移動平均線と言えば「単純移動平均線 (Simple Moving Average)」を指し、その他「指数平滑移動平均 (EMA)」、「加重移動平均 (WMA)」などがあります。

- 一般的な見方として、下記のような見方があります。
- 短・中期の移動平均線が中・長期の移動平均線を上抜いたら買いシグナルとなります。
- 逆に、短・中期の移動平均線が中・長期の移動平均線を下抜いたら売りシグナルとなります。
- また、移動平均線と価格との関係に着目した場合、価格が移動平均線を上抜いたら買いシグナル、下抜いたら売りシグナルと見ます。

移動平均 (Moving Average) はトレンド追随型の代表的なテクニカル指標で、過去の一定期間における価格の平均値を連続して計算しグラフ化したものです。移動平均線の方向性やそれに対する価格の乖離から中長期的なトレンドの判断をします。

- その性質上、実際のトレンドに対して事後的で後れをとる指標の為、期間の長い移動平均線程タイムラグの影響が大きくなります。
- EMA (指数平滑移動平均) とは、このタイムラグを取り除くため、直近価格にウェイトを高めてより最新の価格動向を探ろうとするものです。EMAを用いることにより、トレンドが大きく変換した場合、それ以降の傾向を重視したトレンド反映がされます。

計算式

計算式 (MA) = 「(n日間の終値の合計) ÷ n日」

※過去n日間の場合

計算式 = 「前日のEMA + $\alpha \times$ (当日終値 - 前日のEMA)」

Moving Average of Oscillator (OsMa)

Moving Average of Oscillator (OsMA) は、MACDのシグナルと基準線のクロスや乖離幅を判り易く表したインジケーター。上にOsMA、下にMACDを入れてみました。

MACD のシグナルと同様で、

- 基準線を下から上に抜けた時に、「買い」で、
- 基準線を上から下に抜けた時に、「売り」。

Crossing zero axis:

- If OsMA rises above zero a buy signal arises.
- If OsMA falls below zero a sell signal arises.

計算式

$$\text{OsMA} = \text{MACD} - \text{Signal}$$



Parabolic Indicator

パラボリック(parabolic)とは、大きなトレンドを見る上で役に立つテクニカルチャートです。パラボリックとは「放物線」を意味し、J・ウェルズ・ワイルダー氏が開発したテクニカル指標のことです。

パラボリックは、ローソク足チャート上のSAR(Stop And Reverse・ストップアンドリバース)という点を結ぶと放物線になります。SARは、保有している株をストップ(手仕舞い)し、次にリバース(反対)の取引を行うのに適した価格を指します。

パラボリックのシグナル：

トレンドの確認

- 株価がパラボリックより上にあるとき・・・上昇トレンド
- 株価がパラボリックより下にあるとき・・・下降トレンド

買いと売りのシグナル

- 買いシグナル：下降トレンドでローソク足がパラボリックを下から上に突き抜けた場合
- 売りシグナル：上昇トレンドでローソク足がパラボリックを上から下に突き抜けた場合

パラボリックは株価の大勢を見る場合に利用します。株価の変動が小さい場合、パラボリックは売買シグナルが遅れたり、売買シグナルが頻繁に出現したりします。ボックス圏など小さな動きの場合、パラボリック通りに株価が動く可能性は低くなりますので、他のテクニカルチャートも利用して株取引を行うようにしましょう。

計算式

$$P(t) = P(t-1) + AF \times (EP(t-1) - P(t-1)),$$

P(t) – 指数

P(t-1) – 前の指数

AF – 加速因数・・・0.02で上限は0.2までとする

EP(t-1) – 前の最小/最高の価格

