

※ ご注意ください ※
掲載された設定は参考資料であり、記載されている銘柄やパラメータ数値は弊社が推奨・助言するものではありません。
また、掲載されたパフォーマンスや集計結果はストラテジーテスターによる結果を表示したものであり利益を保証するものではありません。
あくまでご利用の際の参考資料としてご活用ください。

RSI値と5日移動平均線を利用したパラメーター例vol.2

5分足で計測した場合、下記のような条件を満たす場合のパラメータ設定です。

- 【エントリーロジック解説】
- 「条件1」：RSI値が14%以下になり、45%に戻るまでの間
「条件2」：14時55分でエントリー判断
「条件3」：日中に5日移動平均線を0.5%以上超えている
「条件4」：エントリー前日まで、4日以上、終値が5日移動平均線を割り込んだ推移をしている
- 【決済ロジック】
- 「利確」：14時50分に買値より上で、5日移動平均線より下の株価
「損切」：14時50分にエントリー当日と前日を合わせた株価推移の最安値より下の株価

■ストラテジーテスター集計結果

計測日	2021/10/01		
検証銘柄	日経400採用銘柄（2021/10/01 時点）		
足種	5分足		
計測期間	2020/06/01～2021/09/30		
勝ち取引	67回	全合計勝率	77.01%
負け取引	20回	1エントリー利益率	2.01%
勝ち平均利益	3.63%	利益率合計	174.67%
負け平均損失	-3.42%	平均保有期間	7日

■設定したパラメータ

メモ	
表示	
日足エントリー条件 表示	ON
日足移動平均線 表示	ON
日足移動平均線 表示	OFF
基本エントリー	
手数料	0
エントリー開始日	20190301

時間	900
エントリー終了日	20211001
時間	1459
開始日当日限定エントリー	OFF
トレードモード	バックテスト
エントリー選択	買い
日足エントリー条件	ON
逆指値エントリー	OFF
買いトリガー株価	9999
買いエントリー株価	0
空売りトリガー株価	9999
空売りエントリー株価	0
基本エントリーロジック	
エントリーロジック選択	指定時間
指定時間	900
MACD エントリー判定足	1本前
EMA or SMA選択	EMA
短期MA	12
長期MA	16
シグナルMA	9
新値足スタート時間	900
基準新値足	3
連続新値足エントリー	3
新値エントリー条件有効カウント	OFF
デイトレエントリー条件	
最大エントリー回数	上限なし
同日再エントリー制限	OFF
1日エントリー上限	1
日足MA基準エントリー	OFF
判定足	1本前
VWAP基準エントリー	OFF
判定足	1本前
乖離 順行率(%)	100
乖離 逆行率(%)	0
RSI基準 反発/反落狙い	OFF
RSI期間(足数)	14
判定足	1本前
上限(%)	70
下限(%)	30
条件キャンセル%	45-55%
寄付きエントリーキャンセル	OFF

許容 GapUp/Down率	OFF
GapUp率(%以下)	100
GapDown率(%以上)	-100
エントリー株価指定	OFF
株価上限	9999999
株価下限	0
日々エントリータイム	ON
日々開始時間(時分)	1455
日々終了時間(時分)	1459
寄付き様子見/見送り時間	OFF
分数	1
当日利益確保エントリー制限	OFF
確保ライン利益率(%)	9999
逃避ライン損失率(%)	9999
分足MA昇降判定	OFF
5MA昇降判定	OFF
25MA昇降判定	OFF
75MA昇降判定	OFF
決済条件	
日足基準線反転決済	エントリー前当日安/高値
反転決済 判定時間	1450
日足MA 反転利確	5MA
反転利確 判定時間	1450
VWAP 反転決済	OFF
判定足	1本前
MACD 反転決済	OFF
判定足	1本前
強制決済発動日数	10
発動時間	1455
利確チェック開始時間	1450
利確判定含み益(%)	1
銘柄保有日数	5
銘柄保有日数	OFF
利確 株価	99999999
ロスカット 株価	0
トレーリングストップ	
ロスカット下落%	8
第1通常TSトリガー利益率%	99
決済 利益率%	0
第1%TSトリガー 含み益%	5
決済 含み益減少率%	40

第2通常TSトリガー利益率%	8
決済 利益率%	5
第2%TSトリガー 含み益%	10
決済 含み益減少率%	25
後日通常TSトリガー利益率%	0
後日決済 利益率%	0
後日逆指値発動日	999
日足エントリー条件(MA)	
1トレンド1エントリー	OFF
判定開始 昇降率(%)	0
日足MA位置関係	OFF
買い条件	OFF
空売り条件	OFF
移動平均線突破	5MA(場中)
エントリー日 (場中以外)	当日
指定MA	50
突破判断MA乖離率(%)	0.5
逆トレンド判断日数	4
日足MA乖離率 3日間	OFF
指定MA	50
当日 判定基準値	OFF
前日 判定基準値	OFF
2日前判定基準値	OFF
当日 順行率(%)	100
当日 逆行率(%)	-100
前日 順行率(%)	100
前日 逆行率(%)	-100
2日前順行率(%)	100
2日前逆行率(%)	-100
反発回避MA乖離率	OFF
順行率(%)	100
逆行率(%)	-100
MA-MA乖離率 経験後エントリー	OFF
乖離率(%)	0
日足MA昇降率	OFF
5MA 順行率(%)	100
5MA 逆行率(%)	-100
25MA 順行率(%)	100
25MA 逆行率(%)	-100
75MA 順行率(%)	100
75MA 逆行率(%)	-100

日足エントリー条件	
指定値 許容乖離率	OFF
当日指定値 1	当日 始値
前日指定値 1	前日 始値
順行率 1 (%)	100
逆行率 1 (%)	-100
当日指定値 2	当日 始値
前日指定値 2	前日 始値
順行率 2 (%)	100
逆行率 2 (%)	-100
値幅率	OFF
上限(%)	100
下限(%)	0
場中騰落率	OFF
順行率(%)	100
逆行率(%)	-100
前日 順行率(%)	100
前日 逆行率(%)	-100
4 本値 切上/下(空売りは反転)	OFF
高値 切上/下	OFF
安値 切上/下	OFF
始値 切上/下	OFF
終値 切上/下	OFF
0-ソク足高値 切上/下	OFF
0-ソク足安値 切上/下	OFF
最高/安値更新	OFF
最高/安値 検出期間(営業日)	1
突破判断最高/安値乖離率(%)	0
抵抗/反発 髭率	OFF
当日 抵抗/反発	OFF
抵抗 髭率(%以内)	100
反発 髭率(%以上)	0
前日 抵抗/反発	OFF
抵抗 髭率(%以内)	100
反発 髭率(%以上)	0
日足 RSI(14) 反発/反落	反発
エントリー日	当日
当日判定時間	1455
上限%	90
下限%	14
条件キャンセル%	45-55%

新値足用パラメータ	
1分足MA基準 新値足エントリー	OFF
判定足	1本前
新値足エントリー想定ロス回避	OFF
回避想定ロス上限(%)	0
回避想定ロス上限(呼値)	0
新値足反転ロスカット	OFF
TOPIX100 対応呼び値	OFF
呼値 逆指値	OFF
第 1 呼値 逆指値発動	999
逆指呼値 1	0
第 2 呼値 逆指値発動	999
逆指呼値 2	0
分足25or75MA 新値足逆指値	OFF
利確条件 含み益%	0.3