

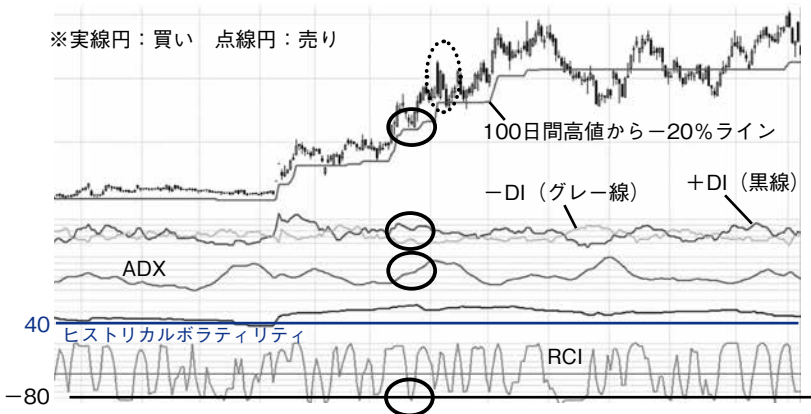
2) 売買ルール (システムトレード的な条件)

① 買い条件 (仕掛け)

- ◎ 過去10日以内に高値が100日間高値をブレイクアウトした日が存在
- ◎ 当日の終値が100日間高値から-20%以内
- ◎ 当日の14日+DIが当日の14日-DIより大きい
- ◎ 当日のADXが1日前のADXより大きい
- ◎ 当日の50日ヒストリカルボラティリティが40より大きい
- ◎ 1日前の5日RCIが-80より大きい
- ◎ 当日の5日RCIが-80より小さい

② 売り条件 (決済)

- ◎ 当日の評価損益率が-15より小さい、または保有期間が8より大きい



① 買い条件

株価が100日間高値から-20% (のライン) の上に位置している状態 & ADXが上昇 & 14日間+DIが14日間-DIの上に位置している状態 & 50日ヒストリカルボラティリティが [40] 以上 & RCIが [-80] を下回ったら買い

② 売り条件

8日経過で売り。または、損益率 [-15 (%)] で売り