GCDC Premium

パラメータ解説マニュアル

ver.1.1.0

本書は GCDC Premium の設定画面に並ぶ全パラメータの解説です。項目は設定画面の並び順に沿って記載しています。

GCDC Premium は、2 本の移動平均線のゴールデンクロス／デッドクロスを売買サインとするストラテジーです。ゴールデンクロスで買いエントリーおよび空売りポジションの決済、デッドクロスで空売りエントリーおよび買いポジションの決済を行います。各種フィルターと決済条件を組み合わせることで、デイトレードから持ち越しまで幅広く設定できます。

ストラテジーコード：TradeStand（トレスタ）のストラテジーコードを入力します。ここに入力した値がアラートメッセージとして送信されます。

【表示】

チャート上への描画を制御します。売買ロジックには影響しません。

・プロット表示：チャートへの描画をまとめて切り替えます。OFF にすると全ての線と背景色が非表示になります。

※ バックテストで多数の組み合わせを検証する際は OFF にすると動作が軽くなります。

・日足移動平均線 表示：「日足 MA 乖離率」で使用する日足の 5MA・25MA・75MA を表示します。

・GCDC 条件移動平均線 表示：売買判定に使用する短期移動平均線・長期移動平均線を表示します。

【トレードモード】

・エントリー選択：エントリーの方向を選択します。

※「買い/空売り」はドテン売買となるためバックテスト専用です。トレスタでドテン売買を再現する場合は、買い用と空売り用の戦略をそれぞれ作成してください。

設定値	動作
買い	ゴールデンクロスで買いエントリーのみ行います。
空売り	デッドクロスで空売りエントリーのみ行います。
買い/空売り	両方向にエントリーします。反対のサインが出ると建玉を決済して反対方向に建て直します（ドテン）。

【基本条件】

バックテストで任意の期間のパフォーマンスを計測する際に使用します。日付は YYYYMMDD、時間は HHMM（時分）の形式で入力します。

・**エントリー開始日：**入力日からエントリーを開始します。

・**時間（開始）：**開始日当日は、入力時間以降からエントリーします。

・**エントリー終了日：**入力日までエントリーします。

・**時間（終了）：**終了日当日は、入力時間までエントリーします。

【デイトレ エントリー条件】

日々エントリータイム

毎日、指定した時間帯のみエントリーを行います。期間の途中で時間帯を切り替えることもできます。

設定値	動作
OFF	時間による制限を行いません。
期間共通	上段の「日々開始時間」「日々終了時間」を全期間に適用します。
期間分割	「期間分割前半」に入力した日より前は下段の時間帯、 その日以降は上段の時間帯を適用します。

・**日々開始時間(時分)〈上段〉：**毎日、入力時間以降にエントリーします。

・**日々終了時間(時分)〈上段〉：**毎日、入力時間までエントリーします。

・**期間分割前半：**時間帯を切り替える基準日を YYYYMMDD で入力します。「期間分割」を選択した場合のみ使用します。

・**日々開始時間(時分)〈下段〉：**基準日より前の期間に適用する開始時間です。

・**日々終了時間(時分)〈下段〉：**基準日より前の期間に適用する終了時間です。

【例】 期間分割前半＝20250401、上段＝900〜1450、下段＝1000〜1130 の場合

⇒ 2025 年 3 月 31 日までは 10:00〜11:30 の間のみエントリー

⇒ 2025 年 4 月 1 日以降は 9:00〜14:50 の間のみエントリー

市場環境の変化に合わせて途中でエントリー時間帯を変えた場合に、その運用を 1 つの戦略で再現できます。

1 日エントリー上限

・1 日エントリー上限：1 日あたりのエントリー回数の上限を設定します。上限に達すると、その日はそれ以上エントリーしません。

※ 0 を入力すると一切エントリーしません。

当日利益確保エントリー制限

・当日利益確保エントリー制限：当日の確定損益が一定の水準に達したら、その日はそれ以上エントリーしないようにします。勝ち逃げ・損失拡大の防止に使用します。

・確保ライン利益率(%)：当日の確定合計損益が入力％以上になった場合、その日はそれ以降エントリーを行いません。

・逃避ライン損失率(%)：当日の確定合計損益が入力％以下（マイナス方向）になった場合、その日はそれ以降エントリーを行いません。

※ 一度どちらかの水準に触れると、その後に損益が戻っても当日のエントリーは再開しません。翌日にリセットされます。

表示足 MA 乖離率

・表示足 MA 乖離率：「GCDC 条件」で設定した表示足の移動平均線から、現在値がどれだけ離れているかで絞り込みます。移動平均線から離れすぎた位置での飛び付きエントリーを抑える目的で使用します。

設定値	基準となる移動平均線
OFF	この条件を使用しません。
短期 MA	GCDC 条件の「短期移動平均線」を基準にします。
長期 MA	GCDC 条件の「長期移動平均線」を基準にします。

・順行率(%)：買いエントリーの場合は乖離率の上限、空売りエントリーの場合は乖離率の下限となります。

・**逆行率(%)：**買いエントリーの場合は乖離率の下限、空売りエントリーの場合は乖離率の上限となります。

【例】 表示足 MA 乖離率＝短期 MA、順行率＝1、逆行率＝-0.5 の場合

⇒ 短期線から下に 0.5%～上に 1%の範囲内に現在値がある場合、買いエントリー

⇒ 短期線から上に 0.5%～下に 1%の範囲内に現在値がある場合、空売りエントリー

【ＧＣＤＣ条件】

・**短期移動平均線：**ゴールデンクロス・デッドクロスを判定するための短期側の移動平均線の値を入力します。

・**長期移動平均線：**ゴールデンクロス・デッドクロスを判定するための長期側の移動平均線の値を入力します。

※ ゴールデンクロスで買いエントリー・空売りポジションの決済、デッドクロスで空売りエントリー・買いポジションの決済を行います。

・**条件に現在値も含む：**短期線がゴールデンクロスした時点で、現在値が短期線を超えていることをエントリー条件に加えます。デッドクロスの場合は、現在値が短期線を割っていることが条件になります。

超短期線が短期線と並行をエントリー条件

・**超短期線が短期線と並行をエントリー条件：**超短期移動平均線が売買方向と同じ向きに傾いていることをエントリー条件に加えます。

※ 買いエントリーは超短期線が 2 本連続で上昇していること、空売りエントリーは 2 本連続で下降していることが条件です。

・**超短期移動平均線：**超短期移動平均線の値を入力します。

移動平均線 2 本の角度乖離値

・**移動平均線 2 本の角度乖離値：**エントリー直前の短期線・長期線の角度の乖離値が、入力した範囲内にある場合のみエントリーします。2 本の線が開きすぎている場面、あるいは閉じすぎている場面を除外する目的で使用します。

・**乖離値 以下(%)：**角度の乖離値の上限を入力します。

・**乖離値 以上(%)：**角度の乖離値の下限を入力します。

※ 入力値＝0 の場合、2 本の線は平行です。

※ 乖離値は、直前 2 本の足から算出した 2 線の角度差を 100 倍した数値です。実際の値を確認しながら範囲を調整してください。

【決済条件】

GCDC Premium の決済は、価格で決まる決済（短期 MA 反転利確・トレーリングストップ・ロスカット）と、時間やサインで決まる決済（反転決済・強制決済）に分かれます。

短期 MA 反転利確

・短期 MA 反転利確：含み益がある場合にのみ、価格が短期移動平均線を割り込んだ時点で利益確定の決済を行います。

設定値	動作
OFF	この決済を使用しません。
MA 上決済	短期移動平均線を逆指値として発注し、ザラ場中にタッチした時点で決済します。
終値確定時	終値が短期移動平均線を割り込んで確定した足の終値で決済します。 ザラ場中の一時的な割り込みでは決済しません。

・発動含み益(%以上)：含み益がこの%以上になっていない場合、この決済は発動しません。わずかな利益での決済を避けたい場合に使用します。

※ 0 を入力すると、含み益が出ていればいつでも発動します。

※ 「MA 上決済」の場合は発動条件を満たした時点で短期線に逆指値が置かれるため、実際の決済価格での利益がこの入力値を下回ることがあります。

強制決済・利確 発動時間

・強制決済・利確 発動時間：指定した時間に決済を行います。銘柄を持ち越さないデイトレード設定に使用します。

設定値	動作
OFF	この決済を使用しません。
強制決済	発動時間に到達したら、含み損益に関わらず決済します。 あわせて、発動時間以降はその日の新規エントリーを行いません。
強制利確	発動時間以降、「利確判断含み益」以上の含み益がある場合のみ決済します。 新規エントリーは制限しません。

・発動時間：決済を発動する時間を HHMM（時分）で入力します。

・利確判断含み益(%)：「強制利確」を選択した場合に、決済の判断基準となる含み益の%を入力します。

※「強制決済」を選択した場合、この値は使用しません。

逆指値（トレーリングストップ）

・逆指値(トレーリングストップ)：含み益が一定の水準を超えた後、そこからの下落幅で利益を確定します。

・％ＴＳ発動値：この含み益（％）を超えた時点でトレーリングストップが作動します。以降、最大含み益を更新し続けます。

・％ＴＳ決済ライン下落率：最大含み益からこの％だけ利益が減少した時点で決済します。

【例】 ％ＴＳ発動値＝5、％ＴＳ決済ライン下落率＝50 の場合

⇒ 含み益が 5％を超えた後、その後の最大含み益から 50％減少した時点で利益確定

（最大含み益が 8％まで伸びた場合、含み益 4％まで下落したところで決済）

ロスカット％

・ロスカット％：含み損が一定の水準に達したら強制的に決済します。

・ロスカット下落％：建値からこの％だけ逆行したら決済します。

※ トレーリングストップとロスカットは、Stop 値を飛び越えて値が付いた場合など、Stop 値ちょうどで約定しないことがあります。

決済ラインの統合について

「短期 MA 反転利確（MA 上決済）」「トレーリングストップ」「ロスカット」は、買い建玉・空売り建玉それぞれ 1 本の逆指値注文にまとめて発注されます。採用されるラインは次のとおりです。

建玉の状態	採用される決済ライン
含み益	有効な利確ライン（MA 上決済・トレーリングストップ）のうち、 より大きな利益が残る方を採用します。
含み損	ロスカットラインを採用します。

条件が成立しなくなった足では逆指値注文を取り消すため、古い価格の注文が残り続けることはありません。

【日足 MA エントリー条件】

・日足 MA 乖離率：選択した日足移動平均線から、指定した基準値の乖離率が指定範囲内にある場合にエン

トリーします。5MA・25MA・75MA から選択します。

※ 日足移動平均線は、前日までの確定値に当日の現在値を加えて算出しています。ザラ場中も当日の値動きが反映されます。

・判定基準値：乖離率を判断する際に基準となる 4 本値を選択します。現在値・始値・高値(買)/安値(売)・安値(買)/高値(売)から選択します。

・順行率(%)：買いエントリーの場合は乖離率の上限、空売りエントリーの場合は乖離率の下限となります。

・逆行率(%)：買いエントリーの場合は乖離率の下限、空売りエントリーの場合は乖離率の上限となります。

【例 1】 判定基準値＝現在値、順行率＝3、逆行率＝-1 の場合

⇒ 移動平均線から下に 1%、上に 3%の範囲内に現在値がある場合、買いエントリー

⇒ 移動平均線から下に 3%、上に 1%の範囲内に現在値がある場合、空売りエントリー

【例 2】 判定基準値＝安値(買)/高値(売)、順行率＝5、逆行率＝2 の場合

⇒ 移動平均線の上方 2%～5%の範囲内にその日の最安値がある場合、買いエントリー

⇒ 移動平均線の下方 2%～5%の範囲内にその日の最高値がある場合、空売りエントリー

【付録】決済コメント一覧

決済時には、どの条件で決済されたかがコメントとして表示されます。トレスタへのアラートでも同じコメントが使用されます。

決済条件	買い建玉の決済	空売り建玉の決済
ゴールデンクロス／デッドクロスによる反転決済	反転:返済売り	反転:返済買い
短期 MA 反転利確	MA 反転利確:返済売り	MA 反転利確:返済買い
強制決済・強制利確	強制決済発動日:返済売り	強制決済発動日:返済買い
トレーリングストップ	ﾄﾚｰﾘﾝｸﾞｽﾄｯﾌﾟ:返済売り	ﾄﾚｰﾘﾝｸﾞｽﾄｯﾌﾟ:返済買い
ロスカット	ロスカット:返済売り	ロスカット:返済買い

決済の優先順位　同じ足で複数の決済条件が成立した場合は、次の順序で 1 つだけが実行されます。

反転決済　＞　短期 MA 反転利確（終値確定時）　＞　強制決済・強制利確　＞　逆指値（MA 上決済・トレーリングストップ・ロスカット）

【付録】ver.1.0.5 からの主な変更点

項目	内容
【表示】セクションの追加	チャートへの描画をまとめて切り替えられるようになりました。
日足移動平均線の算出方式を改善	5MA・25MA・75MA のすべてを同じ基準で算出するようにしました。 従来は 75MA だけ 1 日遅れた値が使われていました。
日々エントリータイム	「期間共通」「期間分割」を選べるようになり、期間の途中で エントリー時間帯を切り替えられるようになりました。
表示足 MA 乖離率の追加	GCDC 条件の移動平均線からの乖離率でエントリーを絞り込めます。
利確条件 → 短期 MA 反転利確	基準線を短期移動平均線に固定し、「MA 上決済」「終値確定時」の 2 方式を選べるようになりました。発動含み益の指定も追加しています。
強制決済の不具合を修正	「強制決済」が含み益の条件に縛られ、時間到達時に決済されない 場合がありました。時間到達で無条件に決済するよう修正しました。
決済処理の統合	価格で決まる決済を 1 本の逆指値にまとめ、条件が外れた足では 注文を取り消すようにしました。
判断足の廃止	常に現在足で判定します。