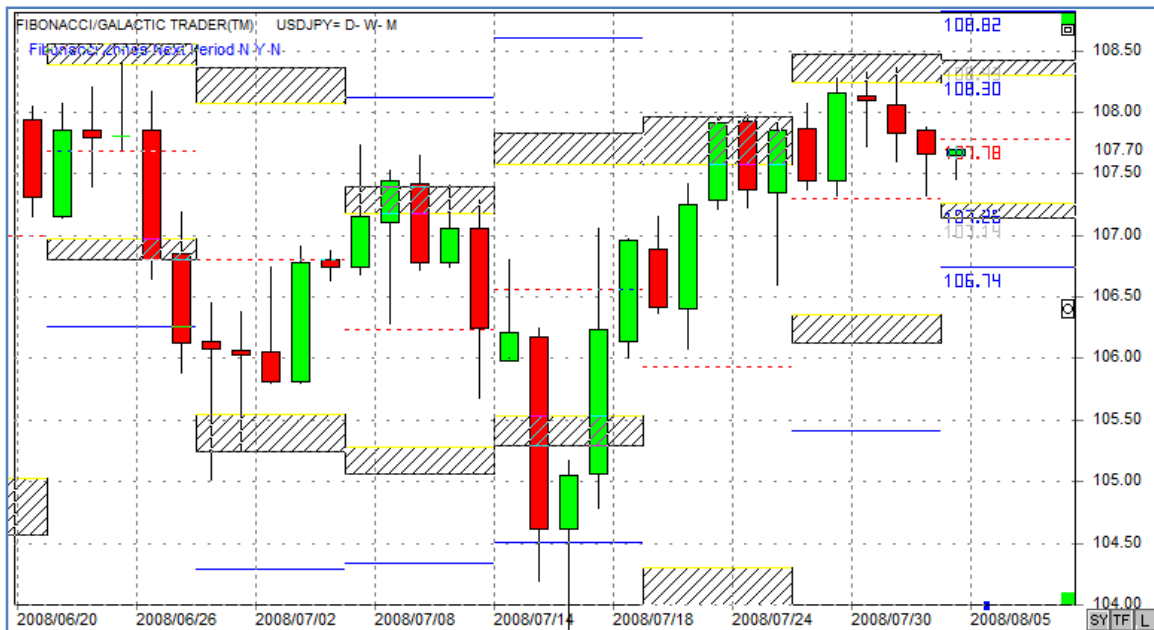


ウィークリー・フィボナッチゾーン

フィボナッチゾーンはピボットに似た手法で、ロバート・クラウス氏により紹介されました。ウィークリー・フィボナッチゾーンは前週の高値(H)、安値(L)、終値(C)を使って求められるピボット・レートの上下に、フィボナッチ比を使用したサポートとレジスタンスのゾーンを示したものです。計算方法は単純で、以下のようになります。式が2つあるのは、ゾーンとして示しているためです。

	$R2 = P + (H - L) * 1.382$		
レジスタンス・ゾーン2	$R2 = P + (H - L) * 1.0$	108.82	*
↑	$R1 = P + (H - L) * 0.618$	108.43	今
レジスタンス・ゾーン1	$R1 = P + (H - L) * 0.5$	108.30	週
[ピボット・レート]	$P = (H + L + C) / 3$	107.78	の
サポート・ゾーン1	$S1 = P - (H - L) * 0.5$	107.26	計
↓	$S1 = P - (H - L) * 0.618$	107.14	算
サポート・ゾーン2	$S2 = P - (H - L) * 1.0$	106.74	例
	$S2 = P - (H - L) * 1.382$		

まず、チャートをご覧ください。

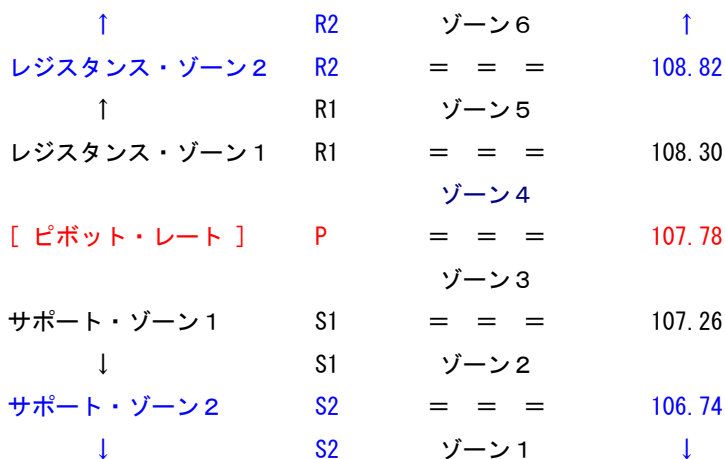


このチャートは2008年6月20日～8月1日の日足チャートにウィークリー・フィボナッチゾーンを重ねたものですが、赤い点線がピボット・レート。その上下にある2つの斜線ゾーンが0.5～0.618のサポートとレジスタンスのゾーン1、青い線が1.0のサポートとレジスタンスのゾーン2の水準となっています。ゾーン1が効いている日は多く、終値でしっかり抜けてきた場合に、ゾーン2が次のターゲットとなっています。

次に、フィボナッチゾーンを用いた統計的な分析です。この分析には相当数のデータが必要なもので、通常は日足のゾーンをデイトレに用いることが一般的ですが、ここでは週足のゾーンを日足に用いてみましょう。この手法は、フィボナッチゾーンを6つに分け、前週の終値と今週の寄付の関係

から、今週どのような値動きが考えられるのかを統計的に推測する手法となります。オリジナルはジョン・ジャクソン氏によるピボット・レートの分析です。

まず、ゾーンを以下のように6つに分けます。ピボット・レートを中心に最初のサポートまでをゾーン3、最初のレジスタンスまでをゾーン4とします。同様に次のサポートまでをゾーン2、次のレジスタンスまでをゾーン5とし、それよりも外側の部分をゾーン1とゾーン6とします。概略図を示すと以下ようになります。



このように分けられたゾーンの中を日足は日々動いていくこととなりますが、特に前週の終値と今週の寄り付きに注目し、前週はどのゾーンで引け、今週はどのゾーンで寄ったのかを6×6=36通りに分け、過去の動き(通常 1000 データ以上)と照らし合わせます。つまり、ゾーン分析とは「前週の終値が2週前のレートから計算されるゾーン(1~6)のどこに入るのか、また今週の寄り付きが前週のレートから計算されるゾーン(1~6)のどこに入るのか、これら終値と寄り付きの36通りの組み合わせから今週の値動きを確率で分析する手法」です。

前回のチャートを見ると、前週はゾーン4で引け(Close 4)、今週(注:8月4日時点)はゾーン3で寄っています(O 3)。この組み合わせを一覧表から探すと、到達確率(Reached)の欄に左から38, 61, 100, 89, 38, 18とあります。これらの数字が各ゾーンへの統計的な到達確率です。つまり、前回の計算例で言えば、106.74未滿のゾーン1への到達確率は38%、108.30以上のゾーン5への到達確率も38%と同率です。各ゾーンへの到達確率が何%なのかを予め知っておくことで、普段使っているテクニカル分析に一段の信頼感を持てるようになるのではないのでしょうか。

Close 1							Close 2							Close 3									
O3	Zones	1	2	3	4	5	6	O3	Zones	1	2	3	4	5	6	O3	Zones	1	2	3	4	5	6
	Resist.	0	0	47	76	75	50		Resist.	0	0	29	66	84	17		Resist.	0	0	19	63	52	52
	Support	65	79	35	0	0	0		Support	33	70	41	0	0	0		Support	46	52	39	0	0	0
	Reached	13	65	100	53	12	3		Reached	17	59	100	71	24	4		Reached	29	61	100	81	30	14
O4	Zones	1	2	3	4	5	6	O4	Zones	1	2	3	4	5	6	O4	Zones	1	2	3	4	5	6
	Resist.	0	0	43	75	100			Resist.	0	0	0	60	75	100		Resist.	0	0	0	50	62	30
	Support	100	80	29	0	0			Support	33	67	47	15	0	0		Support	56	53	64	21	0	0
	Reached	0	14	71	100	57	14		Reached	15	45	85	100	40	10		Reached	13	28	79	100	50	19

Close 4							Close 5							Close 6									
O3	Zones	1	2	3	4	5	6	O3	Zones	1	2	3	4	5	6	O3	Zones	1	2	3	4	5	6
	Resist.	0	0	11	57	54	47		Resist.	0	0	8	52	64	0		Resist.	0	33	50	0	100	
	Support	39	38	39	0	0	0		Support	60	61	48	0	0	0		Support	100	67	0	0	0	
	Reached	38	61	100	89	38	18		Reached	20	52	100	92	44	16		Reached	0	33	100	67	33	33
O4	Zones	1	2	3	4	5	6	O4	Zones	1	2	3	4	5	6	O4	Zones	1	2	3	4	5	6
	Resist.	0	0	0	36	59	42		Resist.	0	0	0	35	57	38		Resist.	0	0	0	35	65	44
	Support	57	52	56	25	0	0		Support	38	50	62	30	0	0		Support	75	86	65	43	0	0
	Reached	16	32	75	100	64	26		Reached	13	26	70	100	65	28		Reached	3	20	57	100	65	23