

# RCIについて

北辰物産株式会社  
大塚 亮

# RCIとは

- ◆ 価格の上昇幅や下落幅、および価格水準を敢えて無視し、一定期間における価格データの順位関係のみに着目。
- ◆ 相場が連騰していれば、日々の順位は日付の順位と一致する。
- ◆ 逆に連敗であれば日々の順位は日付の順位とまったく逆になる。
- ◆ それでは普段は連騰に近いのか、連敗に近いのかという疑問。
- ◆ スピアマンの順位相関係数を利用して開発されたものがRCIである。

# RCIの求め方

- ◆ 直近時点を含む過去n期間の終値を価格水準の高いものからランキングし、順位をつける。
- ◆ それぞれの時点ごとに終値順位と日付順位の差を求め、2乗する。
- ◆ これらの2乗の値の直近n期間における合計値( )を求める。

$$RCI = 100 \times \left[ 1 - \frac{6 \times}{(n^3 - n)} \right]$$

$$\text{修正RCI} = 0.5 \times (RCI + 100)$$

# 具体的な計算例

|            | 終値     | 日付順位 | 価格順位 | 差  | 差の2乗 |
|------------|--------|------|------|----|------|
| 26.09.2007 | 101.03 | 10   | 10   | 0  | 0    |
| 27.09.2007 | 101.71 | 9    | 9    | 0  | 0    |
| 28.09.2007 | 101.90 | 8    | 8    | 0  | 0    |
| 01.10.2007 | 103.40 | 7    | 5    | 2  | 4    |
| 02.10.2007 | 102.22 | 6    | 7    | -1 | 1    |
| 03.10.2007 | 103.17 | 5    | 6    | -1 | 1    |
| 04.10.2007 | 103.43 | 4    | 4    | 0  | 0    |
| 05.10.2007 | 104.96 | 3    | 2    | 1  | 1    |
| 08.10.2007 | 104.97 | 2    | 1    | 1  | 1    |
| 09.10.2007 | 104.81 | 1    | 3    | -2 | 4    |

◆ 差の2乗の合計・・・12

◆ 10日 RCI・・・92.7

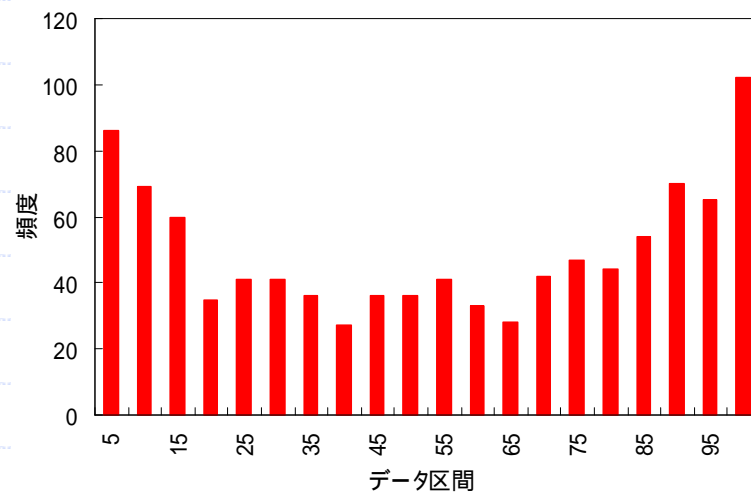
# RCIの特徴

- ◆ RCIの変動範囲は  $-100 \sim 100$  である。これはスピアマンの順位相関係数の取りうる範囲が  $-1 \sim 1$  である事に対応している。
- ◆ 修正RCIを用いれば、変動範囲を  $0 \sim 100$  の範囲にする事ができる。RSIなどとの関連を考え、ここからは修正RCIを用いる事にする。
- ◆ 終値ベースで上昇を続ければRCIは100に下落を続ければ0になる。期間が短いものであれば、0や100になることは別に珍しい事ではない。

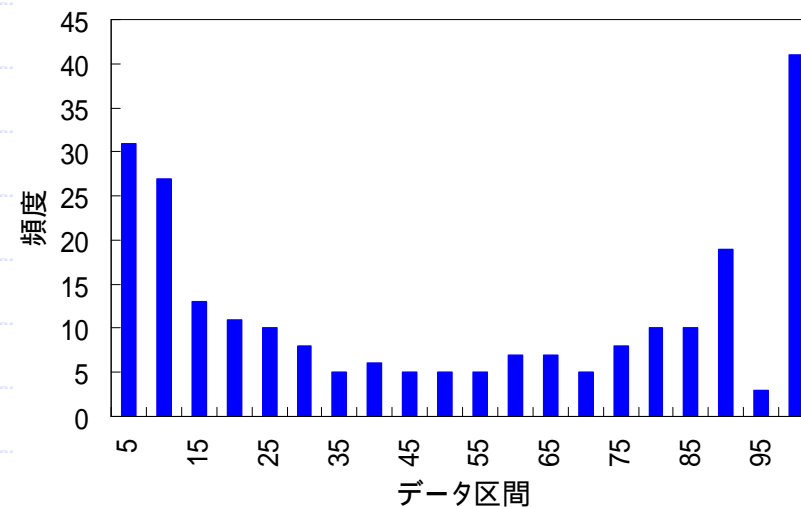
# RCIの経験的確率分布

- ◆ RCIの特徴に、ヒストグラムを作成すると、両端あたりにピークがあり、真ん中あたりがくぼんでいる。これはRSIとは逆である。
- ◆ この特徴から考えると、RCIは両端の領域で長く推移する事がわかり、オシレーター系に分類されているものの、トレンドを見る上で役に立つものと思われる。

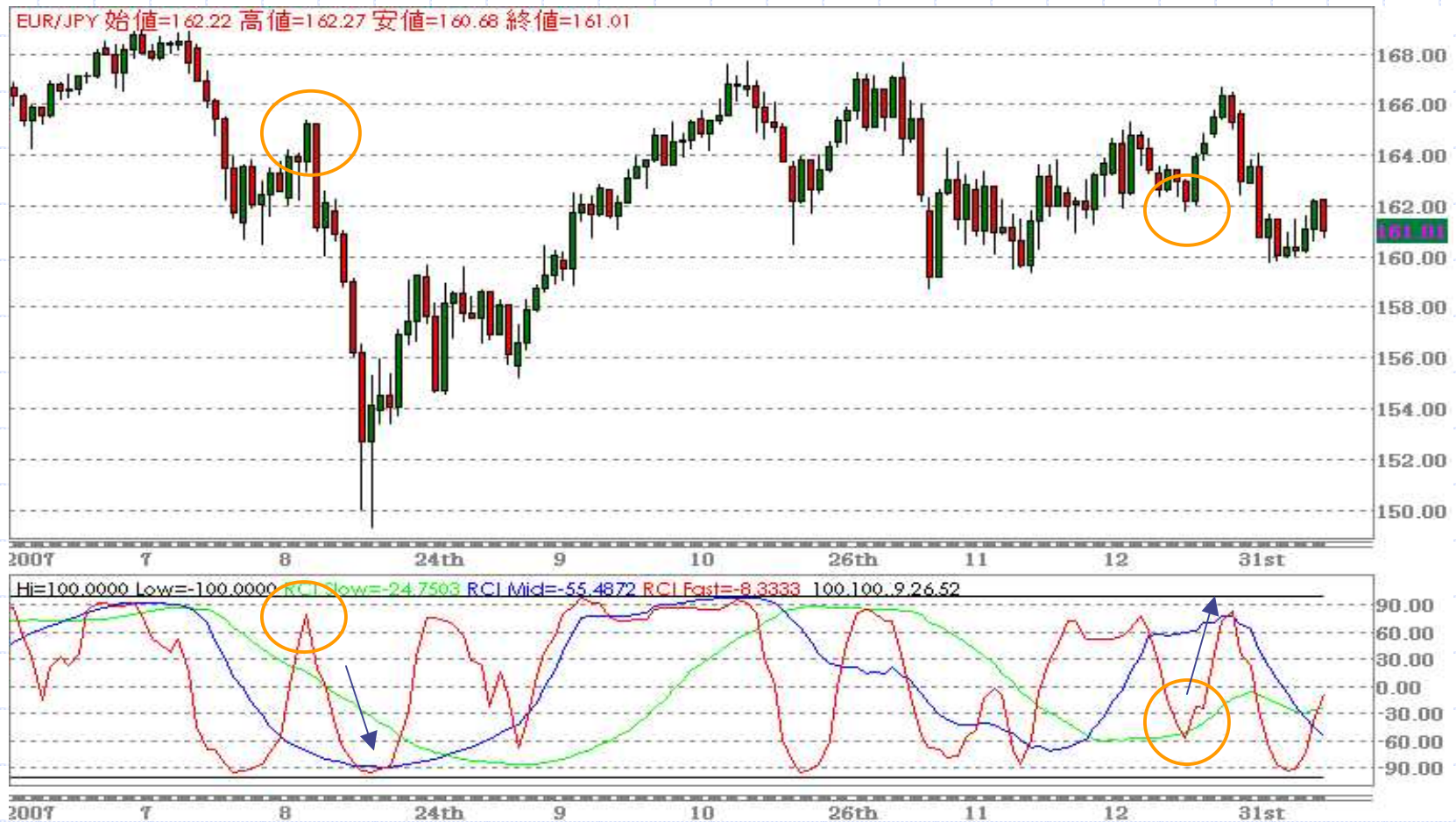
ドル/円 9週RCI



豪ドル/円 52月RCI



# 具体的な見方



◆ 長期線で大きな流れ、短期線でその時の修正を見る、等。

# 注意事項

本レポートの情報に関する正確性や完全性につき、いかなる保証をするものではなく、内容に関しては予告なく変更する事がございます。また、本レポートについて当社の許可なく無断で使用、複製、改変することを禁止します。また、本レポートは勧誘を目的としたものではありません。最終的な投資決定は、お客様ご自身の判断でなさるようお願い致します。本レポートの内容に関するお問合せ・質問にはお答え致しかねますのでご了承ください。

オンライン外国為替保証金取引「DRAGON FX 24」は、総取引金額の約1%の保証金を必要とする(予め差入れた保証金の約100倍の金額の外国為替を売買する)取引であり、元本及び利益が保証されたものではなく、為替及び金融指標の数値の変動によっては損失が生じる場合があります。また、相場急変時等には預入金額以上の損失が生じる場合がありますので、ご自身の取引経験・資産状況等を考慮の上でリスク等内容を十分にご理解頂き、ご自身の判断と責任においてお取引下さい。尚、取引手数料は0円で、弊社の提示する売気配と買気配は一致せず、当該気配値の差は通貨及び取引数量・時間帯に応じて変動します。

電話取引「HOXSIN FX」は総取引金額の約3%から約10%程度の保証金を必要とする(予め差入れた保証金の約10倍から約30倍程度の金額の外国為替を売買する)取引であり、元本及び利益が保証されたものではなく、為替及び金融指標の数値の変動によっては損失が生じる場合があります。また、相場急変時等には預入金額以上の損失が生じる場合がありますので、ご自身の取引経験・資産状況等を考慮の上でリスク等内容を十分にご理解頂き、ご自身の判断と責任においてお取引下さい。尚、取引手数料は1通貨あたり10銭(片道)で、弊社の提示する売気配と買気配は一致せず、当該気配値の差は通貨及び取引数量・時間帯に応じて変動します。

【商号】北辰物産株式会社

【金融商品取引業者としての登録番号】関東財務局長(金商)第295号

【加入している金融商品取引業協会】社団法人金融先物取引業協会