

勝つロジックを求めるトレーダーたちへ

ラリー・ウィリアムズ公認自動売買パッケージ

# ラリー・ウィリアムズ

自動売買パッケージマニュアル



Presented by

West Village Investment 株式会社

## 目次

免責事項 .....	- 4 -
ラリー・ウィリアムズの売買手法.....	- 4 -
自動売買パッケージの概要 .....	- 4 -
ウップス.....	- 5 -
エントリールール	- 5 -
ロングの例	- 5 -
INPUTS の設定	- 6 -
その他の設定	- 8 -
パフォーマンスの概要	- 9 -
最高の売りパターン.....	- 11 -
エントリールール	- 11 -
最高の売りの例	- 11 -
INPUTS の設定	- 12 -
その他の設定	- 14 -
パフォーマンスの概要	- 15 -
GSV(GREATEST SWING VALUE:最大変動幅) .....	- 17 -
エントリールール	- 17 -
GSV の例	- 17 -

本資料は、提供されましたお客様限りでご利用下さい。本資料のいかなる部分も West Village Investment Co., Ltd. に帰属しており、電子的または機械的な方法を問わず、いかなる目的であれ、無断で複製または転送等を行わないようお願い致します。

---

INPUTS の設定	- 18 -
その他の設定	- 20 -
パフォーマンスの概要	- 21 -
<b>スペシャリストの罫(ワナ) .....</b>	<b>- 23 -</b>
エン트리ールール	- 23 -
スペシャリストの罫の例	- 24 -
INPUTS の設定	- 25 -
その他の設定	- 27 -
パフォーマンスの概要	- 28 -
<b>スマッシュデイ .....</b>	<b>- 29 -</b>
エン트리ールール	- 29 -
スマッシュデイの例	- 29 -
INPUTS の設定	- 30 -
その他の設定	- 32 -
パフォーマンスの概要	- 33 -
<b>I. GSV (最大変動幅) のコンセプト .....</b>	<b>- 34 -</b>
GSV(最大変動幅)の活用方法	- 35 -
月曜日	- 35 -
火曜日	- 36 -
水曜日	- 36 -
木曜日	- 37 -
金曜日	- 37 -
各曜日ごとのプロフィットファクター比較	- 38 -

---

本資料は、提供されましたお客様限りでご利用下さい。本資料のいかなる部分も West Village Investment Co., Ltd. に帰属しており、電子的または機械的な方法を問わず、いかなる目的であれ、無断で複製または転送等を行わないようお願い致します。



---

ギャップダウンした日	- 39 -
ギャップアップした日	- 39 -
Ⅱ. ウップスのコンセプト	- 41 -
月曜日	- 42 -
火曜日	- 42 -
水曜日	- 43 -
木曜日	- 43 -
金曜日	- 44 -
ウップスの買いの検証例①	- 45 -
ウップスの売りの検証例①	- 46 -
ウップスの買いの検証例②	- 47 -
ウップスの売りの検証例②	- 48 -
Ⅲ. 最高の売りパターンの活用方法	- 49 -
月曜日	- 49 -
火曜日	- 50 -
水曜日	- 50 -
木曜日	- 51 -
金曜日	- 51 -
各曜日ごとのプロフィットファクター比較	- 52 -
月曜日	- 52 -
火曜日	- 53 -
水曜日	- 53 -
木曜日	- 54 -
金曜日	- 54 -



## 免責事項

West Village Investment 株式会社(ウエストビレッジインベストメント以下 WVI)は、ソフトウェア、マニュアル、取扱説明書等、又はどの製品に関しても保証するものではありません。WVI が提供するどの製品も、原則的に、品質保証することなしに供給されるものとします。WVI は、当該製品の信頼性や精度に関して一切の表示や保証書を作らず、当該製品使用の際に生じたデータの紛失や破損に関しても責任を負いかねます。

WVI は、このプログラムが各ご利用(ご購入又はリース)頂くお客様に適しているかは保証致しかねます。また、先物価格の将来のパフォーマンスの見通しができるか否かに関しましても、如何なる保証・陳述することはできません。WVI は、過去の先物価格の実績を分析することで、将来の先物価格の見通しができるか否かに関しましては、特に保証・陳述することはできません。

同封されたソフトウェアとそれに伴う製品に関しては、免許所持者(WVI ライセンスをご利用頂いたお客様)が、先物取引についての最終的な決定を行なうものであり、全責任を負うことになります。WVI の役員、代理店、従業員、販売人(店)は、当該製品を直接的、又は間接的に取扱う際に発生した金銭的な損害に関して、如何なる責任も負いません。

## ラリー・ウィリアムズの売買手法

ラリー・ウィリアムズ氏は先物、株式、為替を 45 年以上トレードしているアメリカの有名なトレーダーです。ウィリアムズ%R 等のインディケーターやウップス等の投資手法を数多く発案してきました。1987 年の米国で有名な先物チャンピオンシップ(ロビンス・カップ)で 11,376%(113.76 倍)の驚異的リターンを叩き出して優勝し一躍世界にその名を轟かせました。未だにこの記録は破られていません。

## 自動売買パッケージの概要

「ラリー・ウィリアムズ自動売買パッケージ」はラリー氏公認のオフィシャルパッケージです。パッケージにはラリー氏が持っている数あるロジックの中で特にプログラムでシステム化に適している、「ウップス」、「最高の売り」、「スマッシュデイ」、「GSV」、「スペシャリストの罠」の 5 つのロジックが入っています。それぞれのロジックは先物・株式対応版と為替版に分かれています。先物・株式版はイブニングセッション非対応です。利益確定ポイントや損切りポイント、また参照期間等のパラメータ設定は任意の値に変更が可能です。下記では日経 225 先物は自動売買ツールにおけるパイオニア TradeStation2000i を、為替は TradeStation8 を使用して説明しています(他のプラットフォームではデータの相違等によりパフォーマンスが異なったり、設定値を変更する必要がある場合があります)。\* 為替データをサポートしていないブローカー用の為替版自動売買パッケージは、ブローカーが為替データに対応後リリースされます。

本資料は、提供されましたお客様限りでご利用下さい。本資料のいかなる部分も West Village Investment Co., Ltd. に帰属しており、電子的または機械的な方法を問わず、いかなる目的であれ、無断で複製または転送等を行わないようお願い致します。



## ウップス

### エントリールール

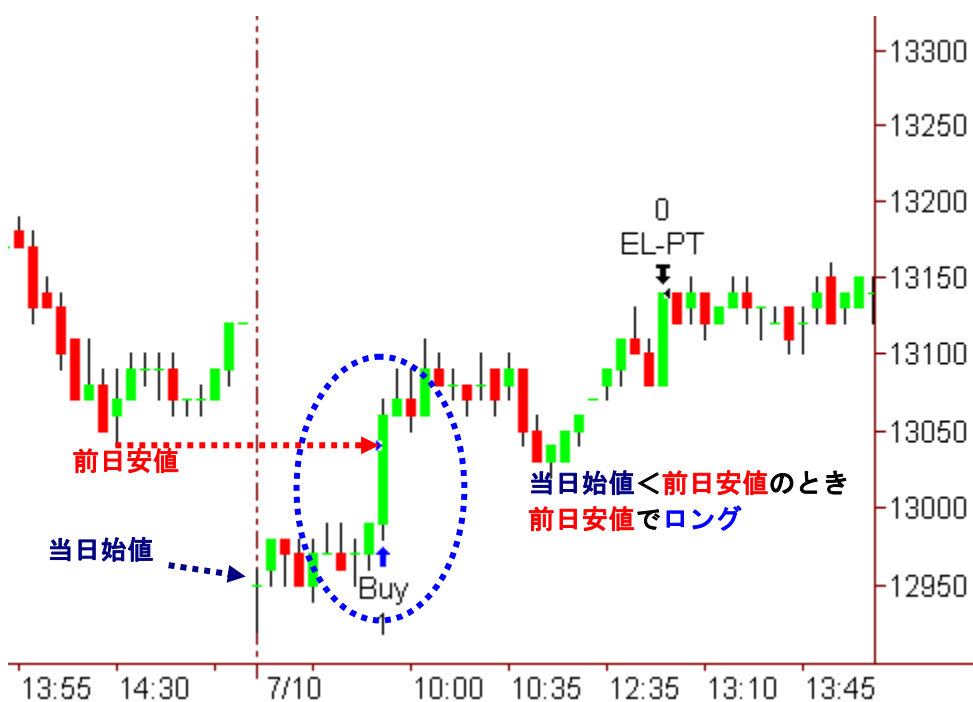
#### <ロング条件>

- 当日始値が前日安値よりも安ければ（当日始値 < 前日安値）、前日安値に買いの逆指値注文を出す。

#### <ショート条件>

- 当日始値が前日高値よりも高ければ（当日始値 > 前日高値）、前日高値に売りの逆指値注文を出す。

### ロングの例



本資料は、提供されましたお客様限りでご利用下さい。本資料のいかなる部分も West Village Investment Co., Ltd. に帰属しており、電子的または機械的な方法を問わず、いかなる目的であれ、無断で複製または転送等を行わないようお願い致します。



## INPUTS の設定

Inputs はストラテジーのチャート適用時に表示される設定画面、またはチャート適用後にストラテジーの設定等から変更可能な設定です。

### 先物・株式版と為替版の共通パラメータ

#### **ContractsNum:**

取引枚数を指定します。

#### **EntryDirection:**

「1」にするとロングのみの売買シグナルが表示されます。

「2」にするとショートのみ売買シグナルが表示されます。

「3」にするとロング、ショートの両方の売買シグナルが表示されます。

#### **ExitMethods:**

「1」にするとエントリーがあった取引日の大引けで決済を行います。

「2」にするとエントリー日の翌取引日の大引けで決済を行います。

「3」にするとエントリー翌取引日の寄り付きで決済を行います。

「4」にするとエントリーがあった取引日以降の含み益が出ている寄り付きで決済を行います。

### 先物・株式版独自のパラメータ

#### **ProfitTarget:**

利益確定幅を呼値単位で指定します。条件を満たした足の終値で成行注文を出します。デフォルト値は 100 です。

#### **StopLoss:**

ロスカット幅を呼値単位で指定します。条件を満たした足の終値で成行注文を出します。デフォルト値は 100 です。

#### **Session1STime:**

前場の寄付時刻(午前 9 時)を指定しています。



**Session1ETime:**

前場の終了時刻(午前 11 時)を指定しています。

**Session2STime:**

後場の寄付時刻(午後 12 時 30 分)を指定しています。

**Session2ETime:**

大引け時刻(午後 3 時 10 分)を指定しています。

為替版独自のパラメータ

**TimeZoneGMTorNot:**

銘柄が GMT 時間を使用している場合 True に、それ以外を使用している場合 False にします。

**ProfitTarget:**

利益確定幅を呼値単位で指定します。条件を満たした足の終値で成行注文を出します。デフォルト値は 0.005 です。

**StopLoss:**

ロスカット幅を呼値単位で指定します。条件を満たした足の終値で成行注文を出します。デフォルト値は 0.005 です。

**SessionSTime:**

取引開始時間(日替わり時間)を指定します。デフォルト値は午前 7 時です。

**SessionETime:**

取引終了時刻を指定しています。デフォルト値は午前 6 時です。

**OpenCalcTime:**

為替の場合前日の高安値と当日始値とのギャップが出にくいいため、この設定により強制的にこの設定時間を当日始値としてギャップを計算します。





## その他の設定

■ 以下の設定はプログラム言語の種類に関わらず、全てのトレードソフトに共通する設定です。

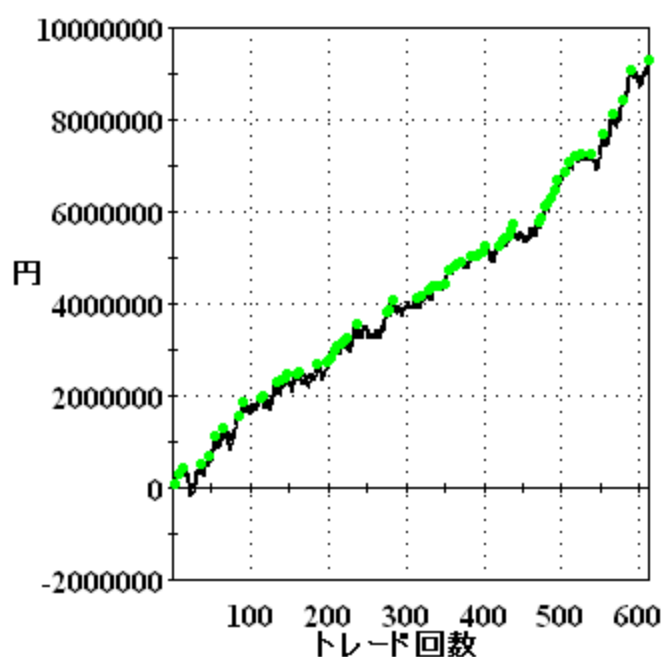
- ・ **ストラテジーを適用するチャートは少なくとも3日間以上のデータで作成してください。**



## パフォーマンスの概要

日経 225 先物ラージの 5 分足で 1 枚売買した結果です。手数料とスリッページは含みません。

1999/3/1-2008/12/30	全取引	買い	売り
総損益	9,320,000	4,570,000	4,750,000
総利益	27,430,000	13,950,000	13,480,000
総損失	18,110,000	9,380,000	8,730,000
トレード回数	612	289	323
勝率(%)	60,78	61,25	60,37
プロフィットファクター	1.51	1.49	1.54
損益レシオ	0.98	0.94	1.01
最大日中ドローダウン	650,000	760,000	600,000
最大連勝回数	9	8	10
最大連敗回数	6	6	5

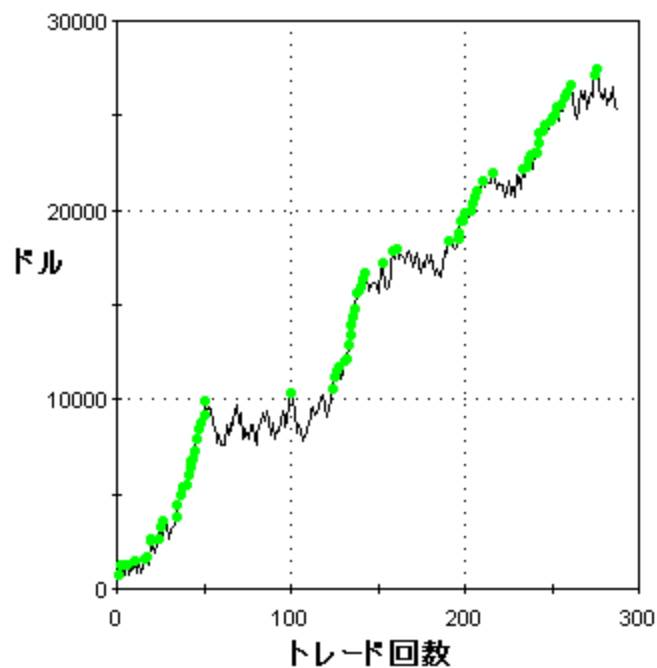


本資料は、提供されましたお客様限りでご利用下さい。本資料のいかなる部分も West Village Investment Co., Ltd. に帰属しており、電子的または機械的な方法を問わず、いかなる目的であれ、無断で複製または転送等を行わないようお願い致します。



ユーロドルで1ロット(10万通貨単位)売買した結果です。手数料とスリッページは含みません。

2002/10/22-2009/1/25	全取引	買い	売り
総損益	25,411.00	14,285.00	11,126.00
総利益	71,640.00	36,282.00	35,358.00
総損失	44,229.00	21,997.00	24,232.00
トレード回数	288	139	149
勝率(%)	59.72	61.87	57.72
プロフィットファクター	1.59	1.65	1.46
損益レシオ	1.01	0.96	1.05
最大日中ドローダウン	3,038.00	3,637.00	3,490.00
最大連勝回数	12	9	9
最大連敗回数	5	4	5



本資料は、提供されましたお客様限りでご利用下さい。本資料のいかなる部分も West Village Investment Co., Ltd. に帰属しており、電子的または機械的な方法を問わず、いかなる目的であれ、無断で複製または転送等を行わないようお願い致します。