



# 研究発表レポート⑦

～ モメンタム ～

**West Village Investment** 株式会社  
岩本祐介





# 研究発表

## MULTICHARTS DATA

研究発表のurlは以下のとおりです。

<http://www.panrolling.com/seminar/multicharts/study/>

※インジケータやストラテジーの挿入方法等の基本的な使い方、および、最適化の方法等は、第1回のボリンジャーバンド前編、後編をご覧ください。

2020.07.13 MACDの基本とストラテジーの検証 動画 (資料)

2020.06.17 ストキャスティクスの使い方と活用方法 動画 (資料)

2020.05.12 Relative Strength Index (RSI) の5分足順張りルールの最適化 動画 (資料)

2020.05.12 Average True Range (ATR) とケルトナーチャネルのポイント 動画 (資料)

2020.04.17 移動平均線の押し/戻りの戦略 (聖杯、The Holy Grailのシステム化と検証 動画 (資料)

2020.03.24 コロナショックによる暴落に関して - システムトレード的な見地から考察 -

2020.02.12 ボリンジャーバンドの記述方法と最適化 前編 (資料) | 後編 (資料)



# マルチチャートのモメンタム

- Momentum( 価格, 期間(N) )

Momentumという関数を使います。

$$\text{Momentum} = \text{直近の終値} - \text{N期間前の終値}$$

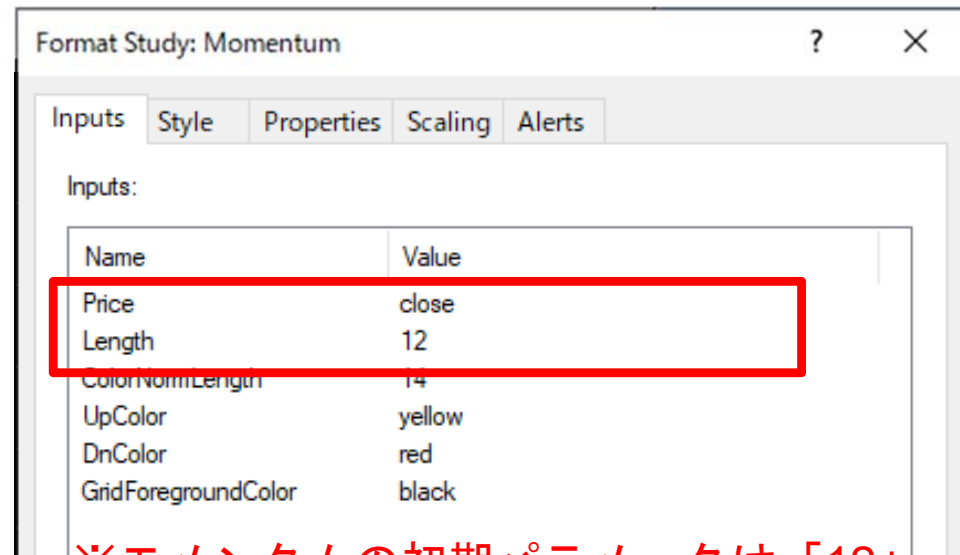
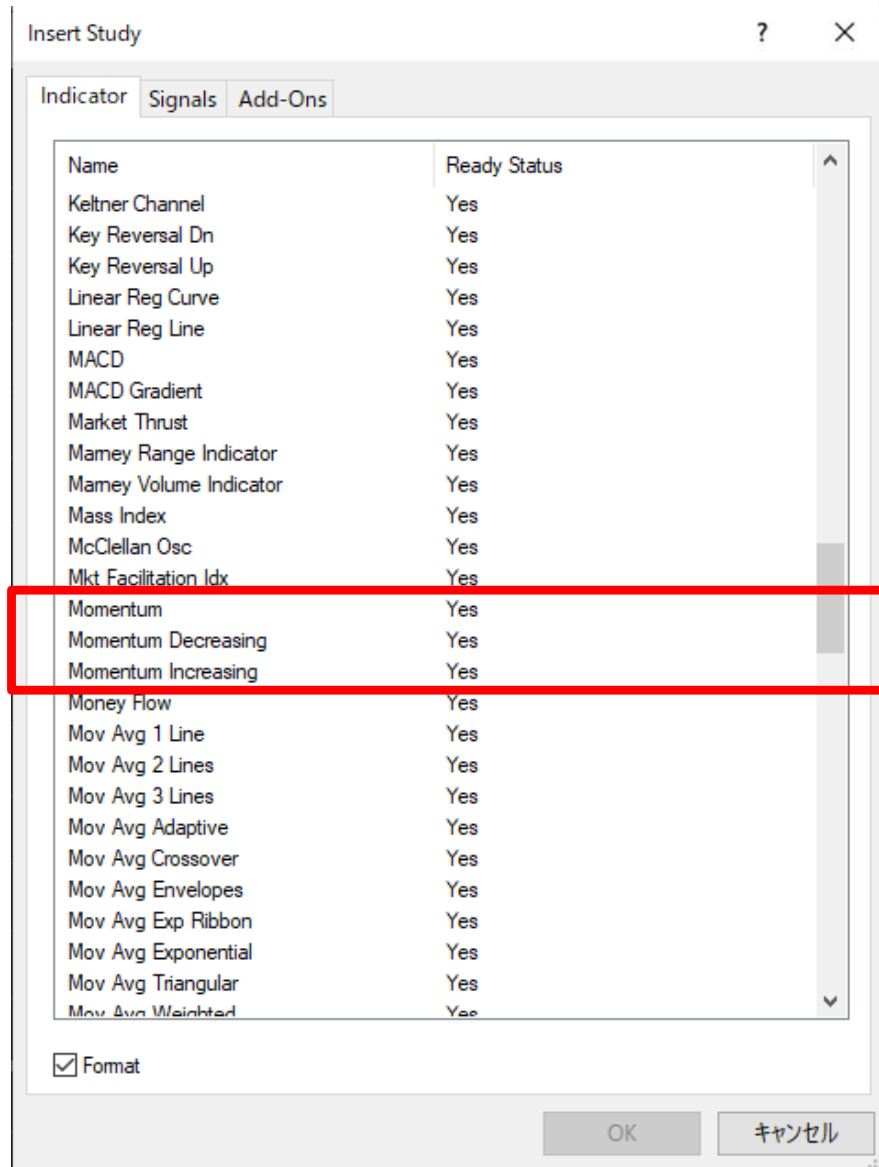
プログラムの記述方法は、Momentum( 価格, 期間 )で表現します。

価格 : Open, High, Low, Closeから選択することが基本

期間 : パラメータ (N期間)



# マルチチャートのモメンタム（インジケータ）



※モメンタムの初期パラメータは「12」

Momentum  
Momentum Decreasing  
Momentum Increasing



# マルチチャートのモメンタム（インジケーター）



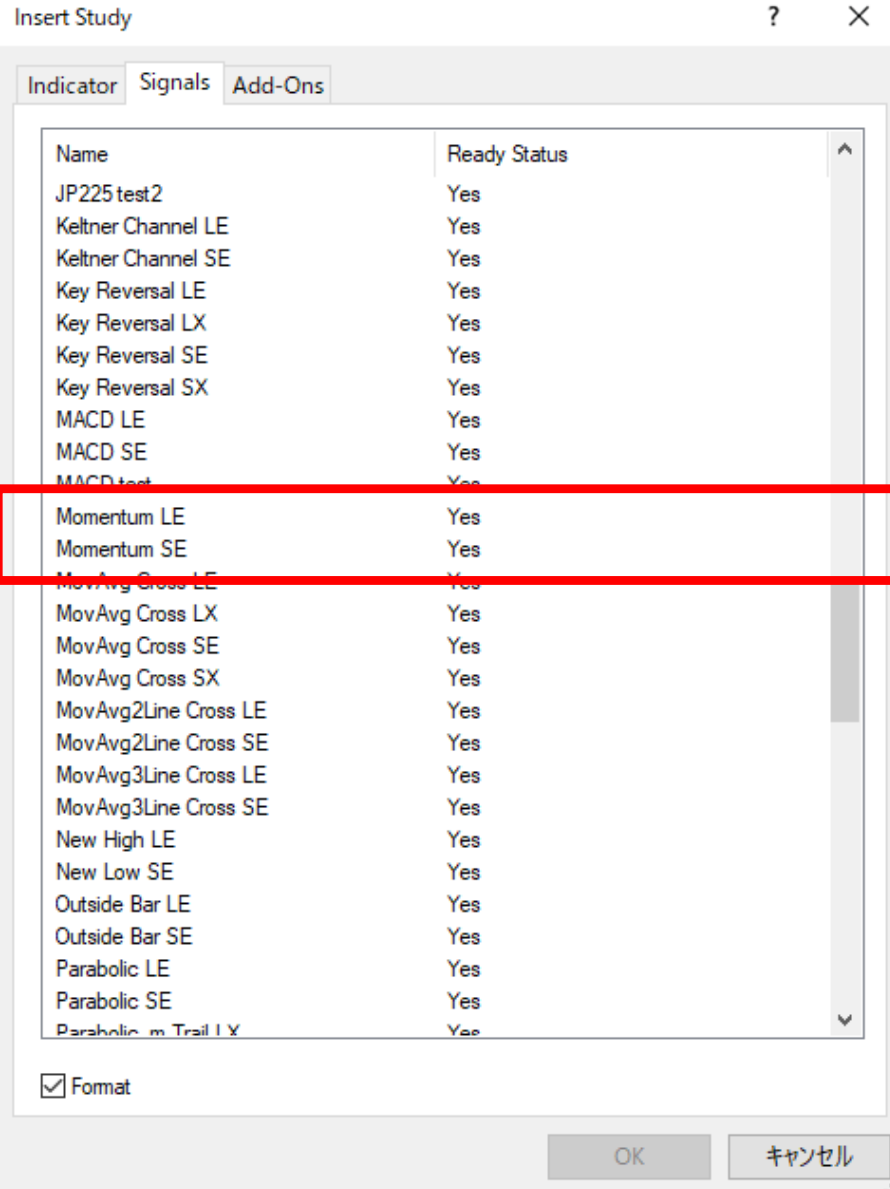


# マルチチャートのモメンタム（インジケーター）





# マルチチャートのモメンタム（ストラテジー）



## ・ Momentum LE

（ロング・エントリー）

モメンタムが0ラインより上にあり、かつ、直近のモメンタムが1つ前のモメンタムよりも高い場合、直近バーの高値よりも1tick上で逆指値の買い

## ・ Momentum SE

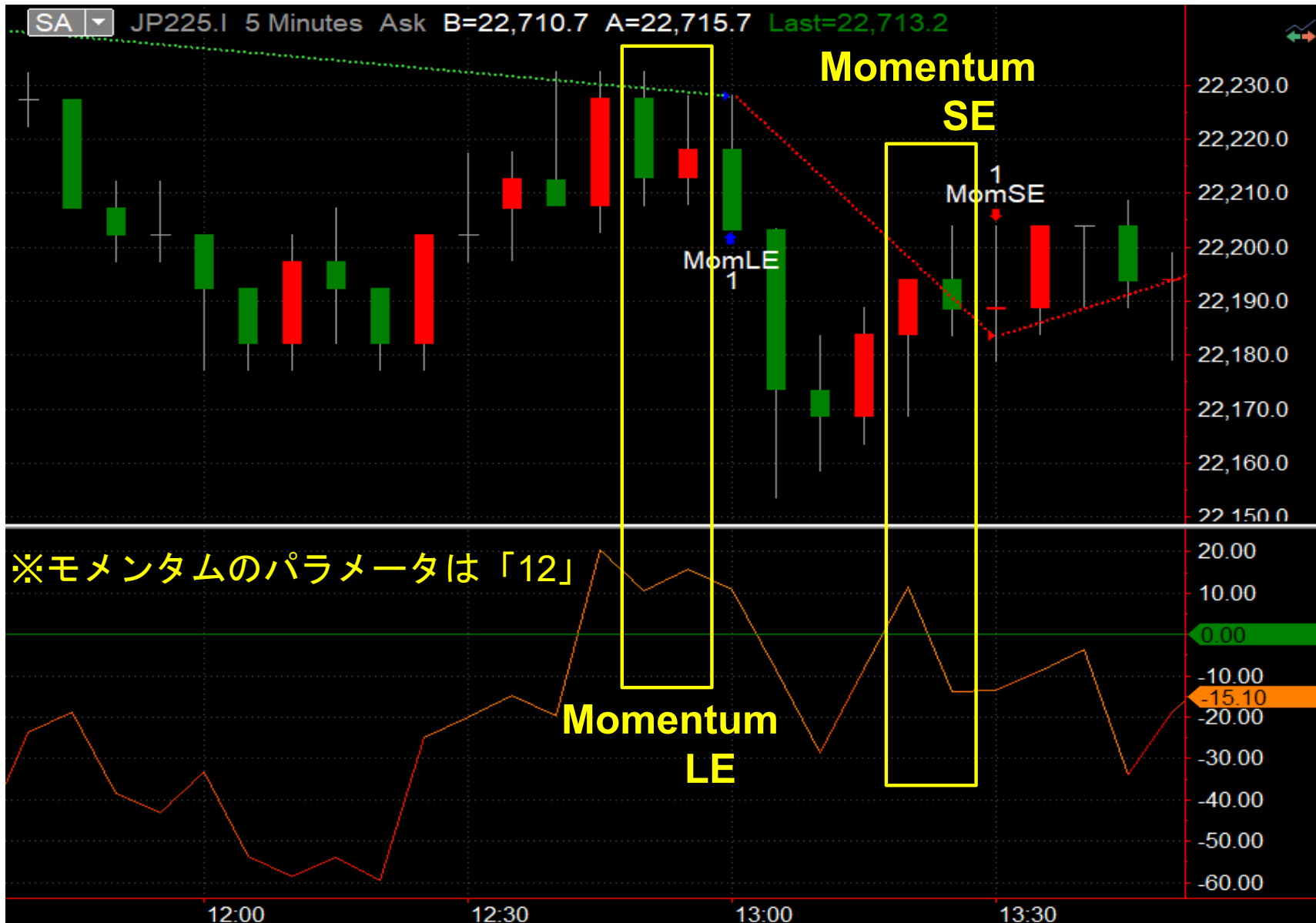
（ショート・エントリー）

モメンタムが0ラインより下にあり、かつ、直近のモメンタムが1つ前のモメンタムよりも低い場合、直近バーの安値よりも1tick下で逆指値の売り

※モメンタムの初期パラメータは「12」



# マルチチャートのモメンタム（ストラテジー）



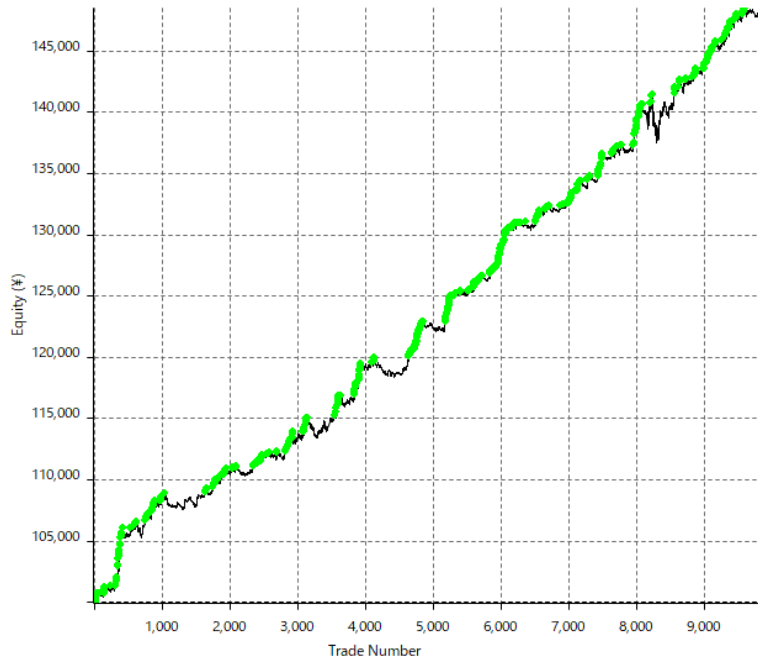




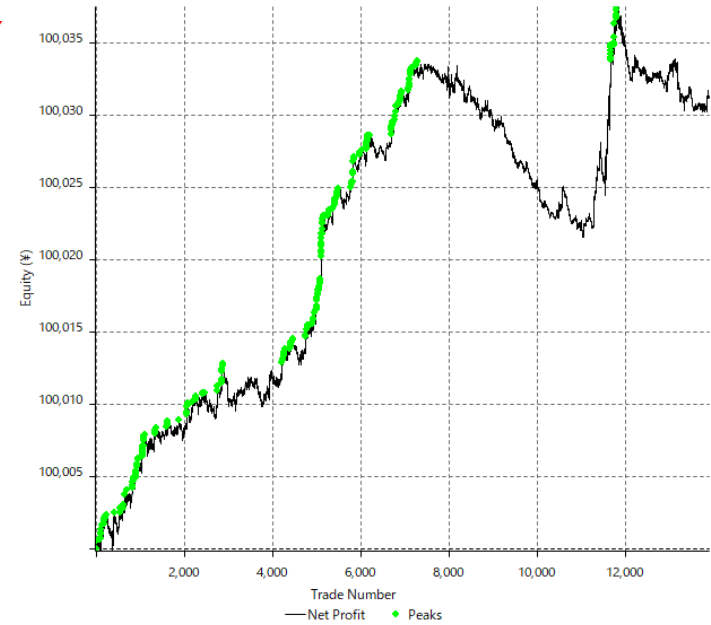
# マルチチャートのモメンタム（ストラテジー）

5分足：2018年1月から2020年7月28日

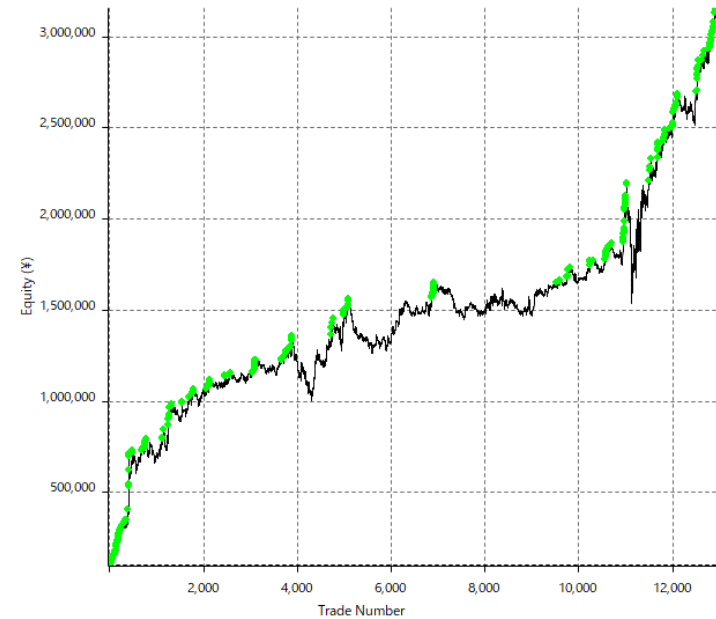
JP225.I



USDJPY



US30.I





# マルチチャートのモメンタム（ストラテジー）：遅行線（スパン）



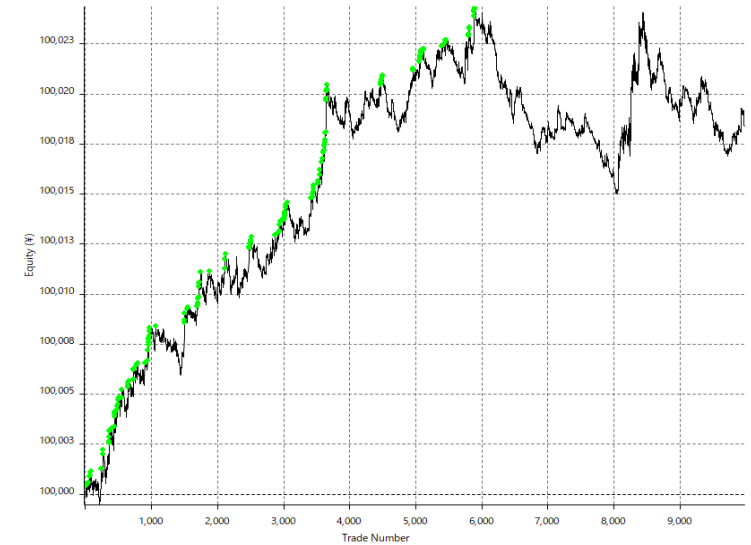
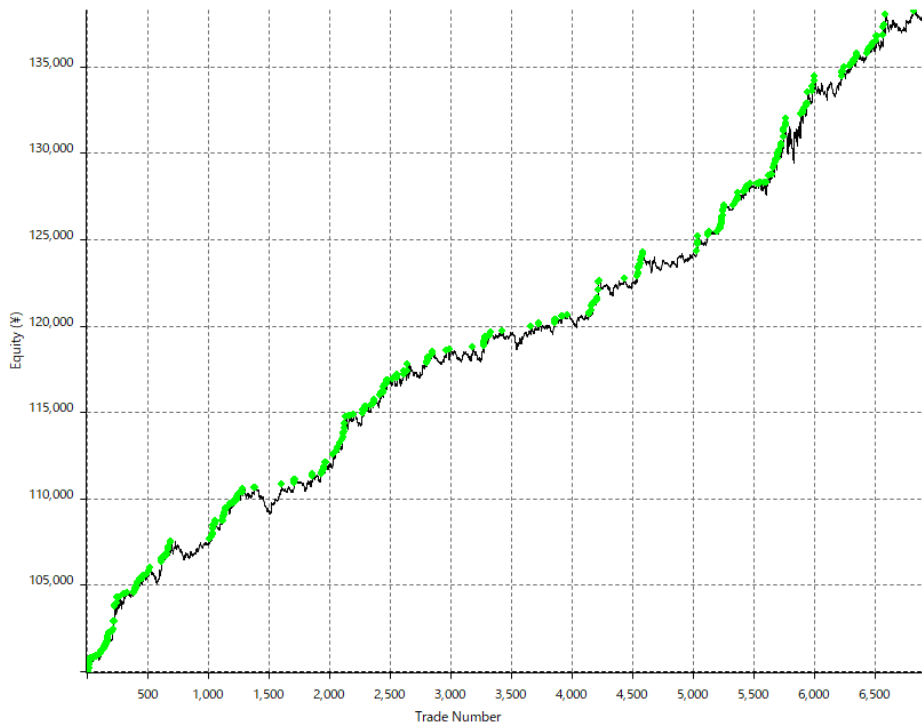


# マルチチャートのモメンタム（ストラテジー）：遅行線（スパン）

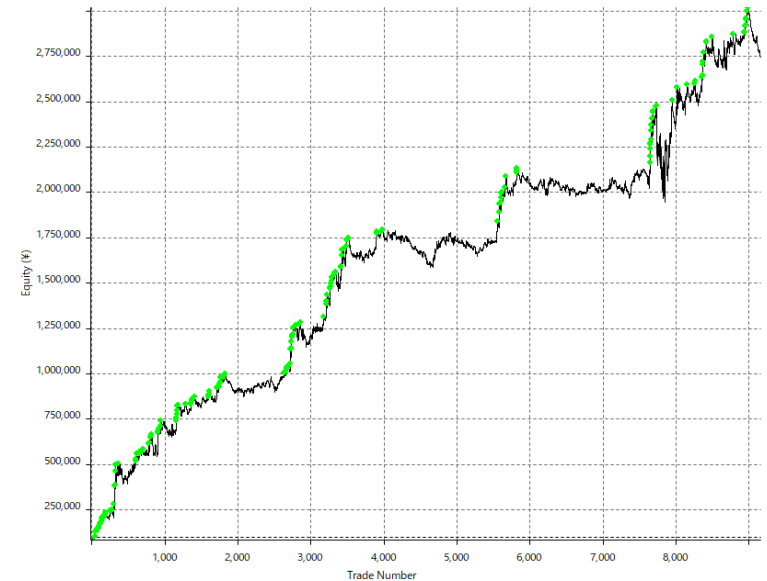
5分足:モメンタムのパラメータは「25」

USDJPY

JP225.I



US30.I





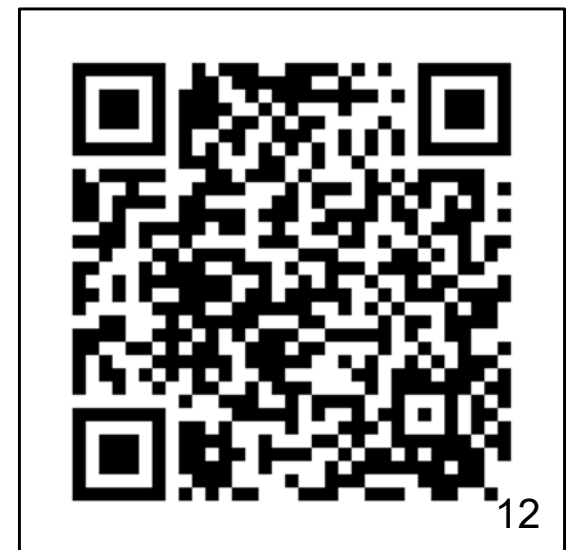
# MULTICHARTS

Raising The Trading Standard

パンローリングはマルチチャートの日本の正規代理店です。マルチチャートの試用版は下記のURLまたは右下のQRコードからお申込みください。

## まずはお試してください！

<http://www.panrolling.com/seminar/multicharts/>





# 2020年 第3回 8月5日開催予定 ロジック・プログラム完全公開セミナー

機関投資家や公募ファンドのシステムとして採用された実績のある  
West Village Investment 株式会社が9年ぶりに個人投資家向けに  
自動売買プログラムを提供とともにロジック・プログラム完全公開の  
セミナーを開催します。

マーケットプロファイル(TPO)の知識をベースとしたロジックの自動  
売買化を実現しました。

1日目:8月5日(水)開催予定

- ・ロジックの説明
- ・ロジックの活用法および留意点
- ・プログラムの説明

2日目:9月2日(水)開催予定

- ・システムトレード全般
- ・マーケット分析
- ・質疑応答 など



<http://www.tradersshop.com/bin/showprod?c=2011396600000>



パンローリングチャンネル



第1回 10分トレードから学ぶエントリー&エグジット編

<https://youtu.be/KJ3gMlfMLpo>

第2回 10分トレードから学ぶ早期エグジット編

<https://youtu.be/rSVRIIs61vKc>

第3回 10分トレードから学ぶ利益確定&ロスカット編

<https://youtu.be/ykErg3MtvA4>

第4回 10分トレードから学ぶまとめ編

<https://youtu.be/OiAlQOeKIKY>