

Williams %R

Outlines



- Dataset
- ส่วนประกอบ indicator
- ตัวอย่างใช้งาน
- ทดลอง Optimize Parameters
- จุดแข็ง จุดอ่อน

Williams %R: Dataset

	timestamp	open	high	low	close	adj close	volumn
0	2021-11-04 17:00:00	1.154734	1.155135	1.154734	1.155135	1.155135	0
1	2021-11-04 17:15:00	1.155135	1.155535	1.155001	1.155135	1.155135	0
2	2021-11-04 17:30:00	1.155001	1.155535	1.155001	1.155135	1.155135	0
3	2021-11-04 17:45:00	1.155001	1.155535	1.155001	1.155001	1.155001	0
4	2021-11-04 18:00:00	1.155135	1.155535	1.155135	1.155535	1.155535	0
...
15369	2022-06-30 15:45:00	1.046682	1.048438	1.046572	1.047120	1.047120	0
15370	2022-06-30 16:00:00	1.047120	1.047340	1.046463	1.046792	1.046792	0
15371	2022-06-30 16:15:00	1.046682	1.047779	1.046682	1.047669	1.047669	0
15372	2022-06-30 16:30:00	1.047889	1.048218	1.047230	1.047449	1.047449	0
15373	2022-06-30 16:45:00	1.047779	1.048878	1.047779	1.048438	1.048438	0

15374 rows × 7 columns

Asset: ตลาด forex คู่เงิน EURUSD

Timefame: 1 ชั่วโมง

Datasource: Yahoo Finance

Start: 04/11/2021 17:00

End: 30/08/2022 17:00

Williams %R: ส่วนประกอบ indicator



- %R มีค่าตั้งแต่ -100 ถึง 0
- ตั้งค่าเริ่มต้น length = 14
- ค่า -20 คือ Overbought, ค่า -80 คือ Oversold
- %R ตัดขึ้นหรือลงที่ค่า -50

Williams %R: ตัวอย่างใช้งาน

นิยมใช้งานร่วมกับ indicator ตัวอื่น เช่น ประยุกต์ Williams %R กับ EMA

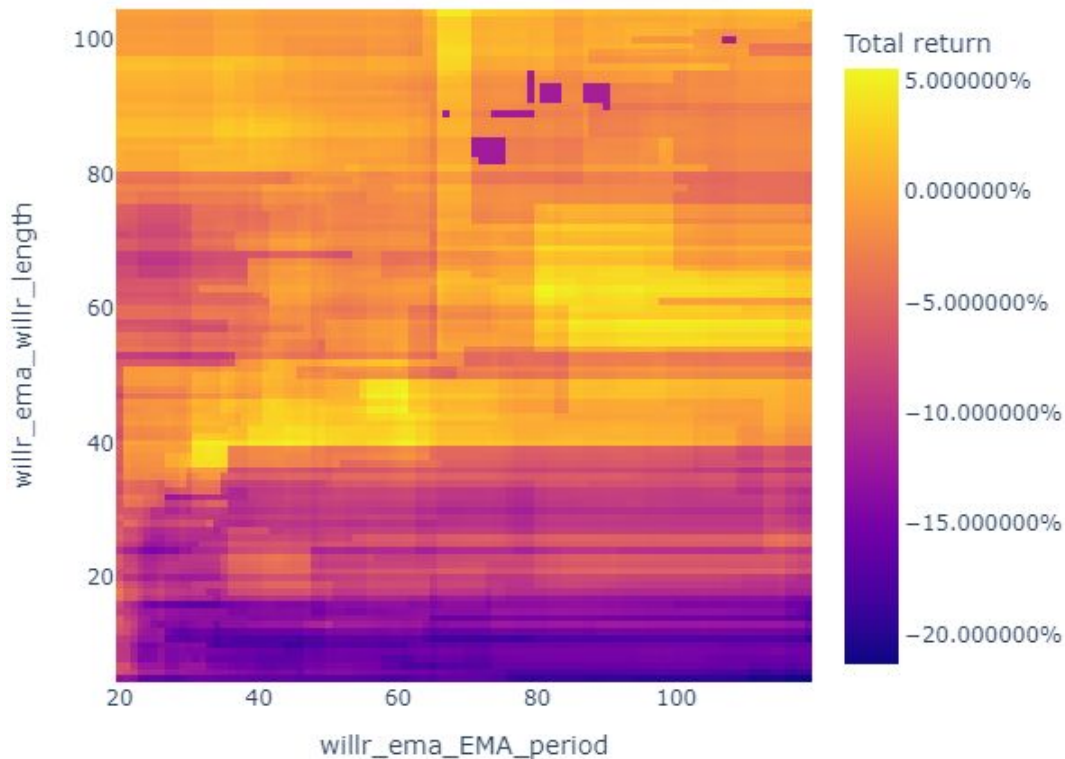
กรณี long

- ค่า Williams %R ตัดขึ้นที่ค่า -50 และราคา low มากกว่าค่า EMA ให้เข้า order
- ค่า Williams %R เกิด overbought (มากกว่า -20) ให้ปิด order

กรณี short

- ค่า Williams %R ตัดลงที่ค่า -50 และราคา high น้อยกว่าค่า EMA ให้เข้า order
- ค่า Williams %R เกิด oversold (น้อยกว่า -80) ให้ปิด order

Williams %R: ทดลอง Optimize Parameter



ทดสอบค่า EMA ตั้งแต่ค่า 20 ถึง 120
ทดสอบค่า Williams %R ตั้งแต่ค่า 5 ถึง 105
กำหนดว่า total trade > 30

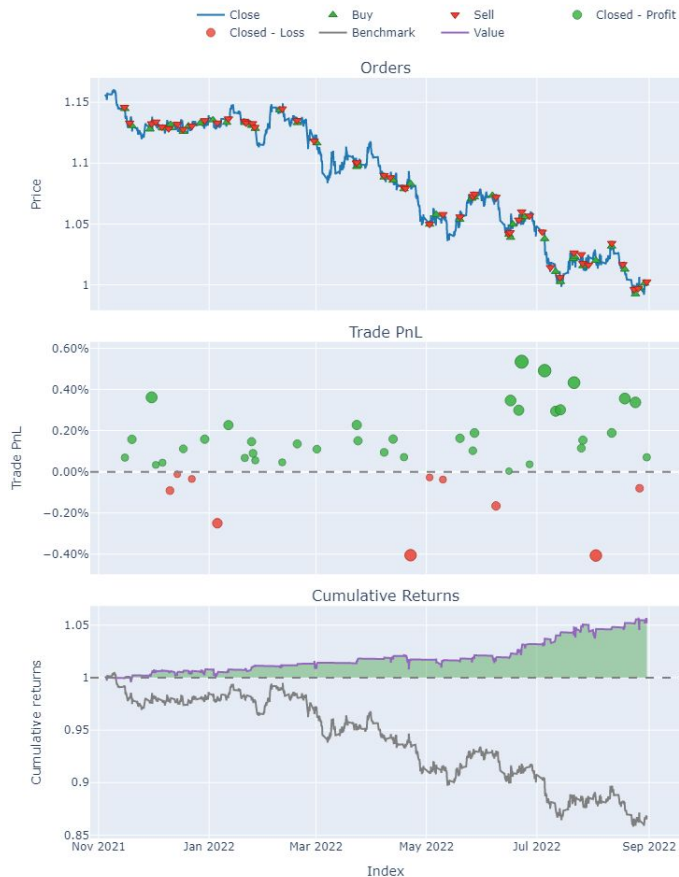
parameter ที่ดีที่สุดได้แก่

EMA = 61

Williams %R = 47

return 5.55 %

Williams %R: ทดลอง Optimize Parameter



Start	2021-11-04 17:00:00
End	2022-08-30 16:00:00
Period	5010
Start Value	100.0
End Value	105.551414
Total Return [%]	5.551414
Benchmark Return [%]	-13.185608
Max Gross Exposure [%]	100.0
Total Fees Paid	1.960678
Max Drawdown [%]	1.344377
Max Drawdown Duration	969.0
Total Trades	48
Total Closed Trades	48
Total Open Trades	0
Open Trade PnL	0.0
Win Rate [%]	79.166667
Best Trade [%]	0.534575
Worst Trade [%]	-0.406575
Avg Winning Trade [%]	0.182272
Avg Losing Trade [%]	-0.151065
Avg Winning Trade Duration	16.5
Avg Losing Trade Duration	38.4
Profit Factor	4.577802
Expectancy	0.115654

Williams %R: จุดแข็ง จุดอ่อน วิธีแก้ไข

จุดแข็ง

- ใช้งานได้ดีช่วงที่กราฟเป็นเทรน
- ช่วงเกิด overbought, oversold ราคา มักเคลื่อนที่

จุดอ่อน

- ค่า Williams %R มีโอกาสเกิด Whipsaw
- ช่วงเกิด overbought, oversold ราคาอาจ sideways

วิธีแก้ไข

- ปรับค่า length เพื่อลด Whipsaw
- ใช้งานร่วมกับ indicator ตัวอื่น



Williams %R: แหล่งข้อมูล

[Williams %R คืออะไร สร้างโดยแฮมป์เทรตปี 1987 \(lucid-trader.com\)](#)

[การใช้งาน Williams Percent Range สำหรับการเทรด Forex \(admiralmarkets.sc\)](#)

[Two effective trading strategies using Williams % R \(elearnmarkets.com\)](#)