

# Mogalef Trading

The background of the slide features a blurred image of a person's hands holding a yellow pen over a document. The document contains several financial charts, including candlestick charts and line graphs, which are semi-transparent and overlaid on the scene. The overall aesthetic is professional and focused on financial analysis.

"There's no certitude, only opportunities." V

Conférence du 4 octobre 2022

## Figures, Indicateurs: les comprendre, les utiliser Partie 2

Présenté par Eric Lefort de Mogalef-Trading

Avec la collaboration de WHSelfinvest

# Sommaire

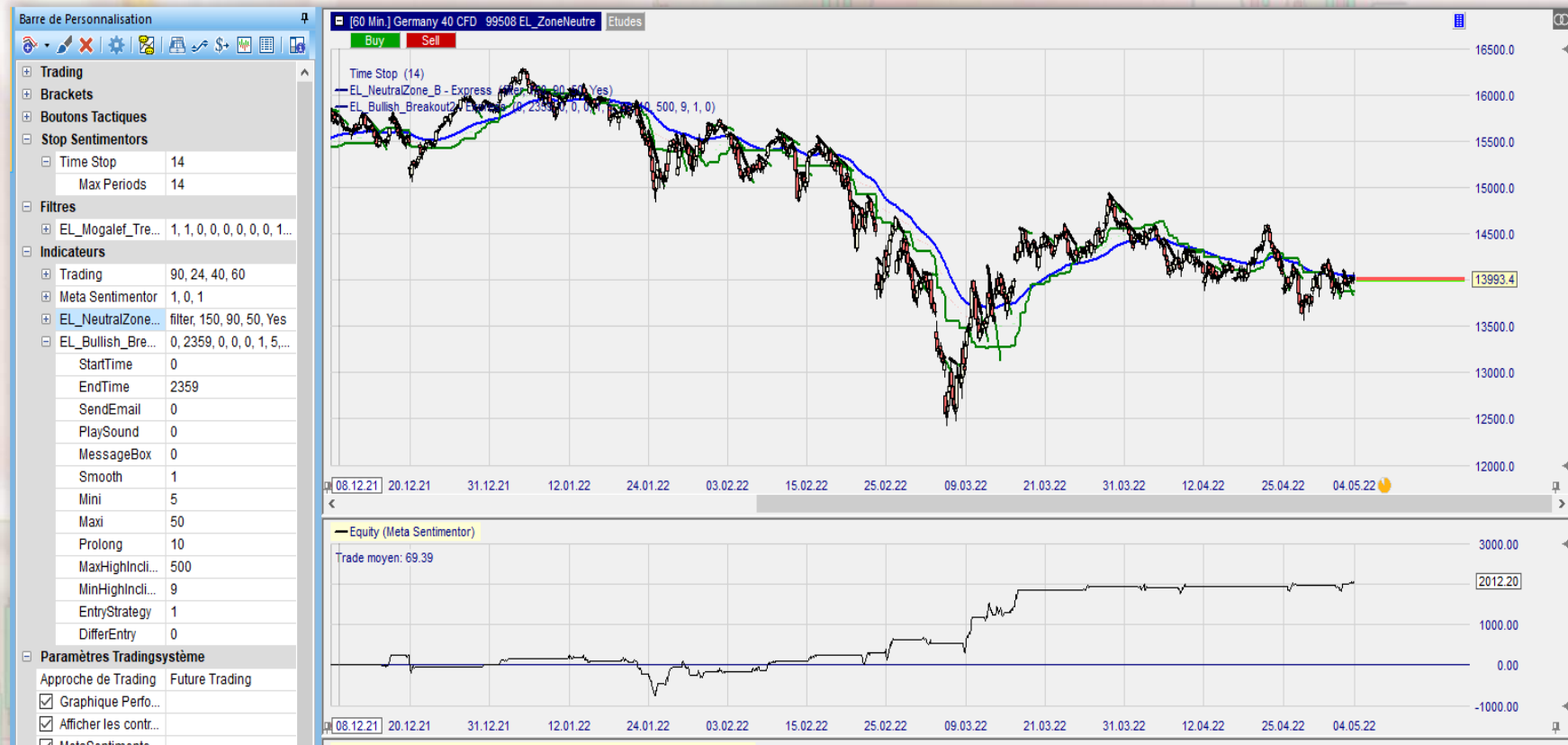


- Suivi de système cassure haussière sur Germany 40
- Suivi de système RSI sur FDAX
- Suivi de système Stochastique sur FDAX
- Suivi de système STPMT sur FDAX



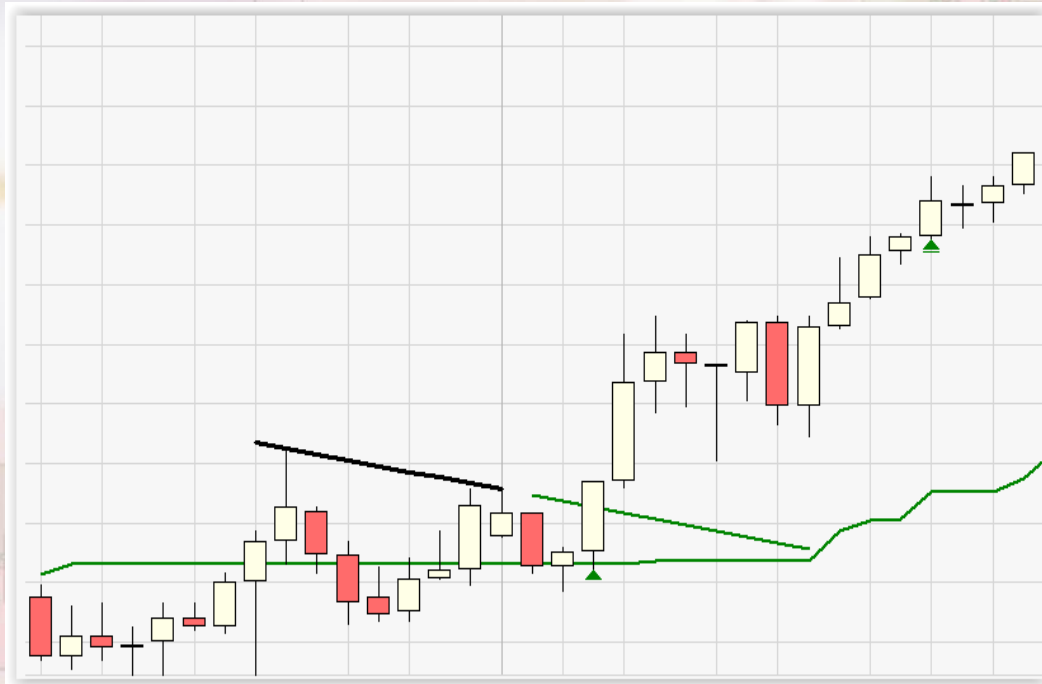
# Suivi de système cassure haussière sur Germany 40

- Résultats de l'étude Sans filtre



# Bullish breakout, rappel

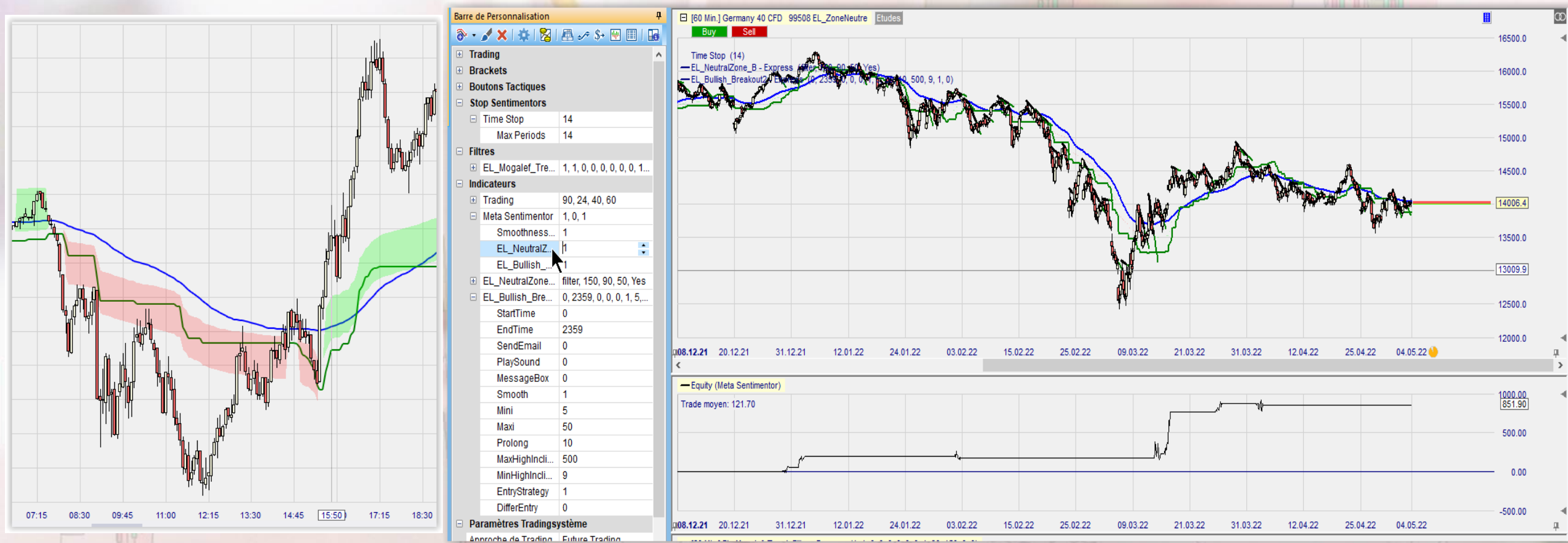
Les paramètres réglables  
pour l'indicateur de  
cassure haussière :



EL_Bullish_Breakout...	0, 2359, 0, 0, 0,...
StartTime	0
EndTime	2359
SendEmail	0
PlaySound	0
MessageBox	0
Smooth	1
Mini	4
Maxi	19
Prolong	10
MaxHighInclination	500
MinHighInclination	0
EntryStrategy	1
DifferEntry	0

# Suivi de système cassure haussière sur Germany 40

- Résultats de l'étude, avec filtre Zone Neutre



# Suivi de système cassure haussière sur Germany 40

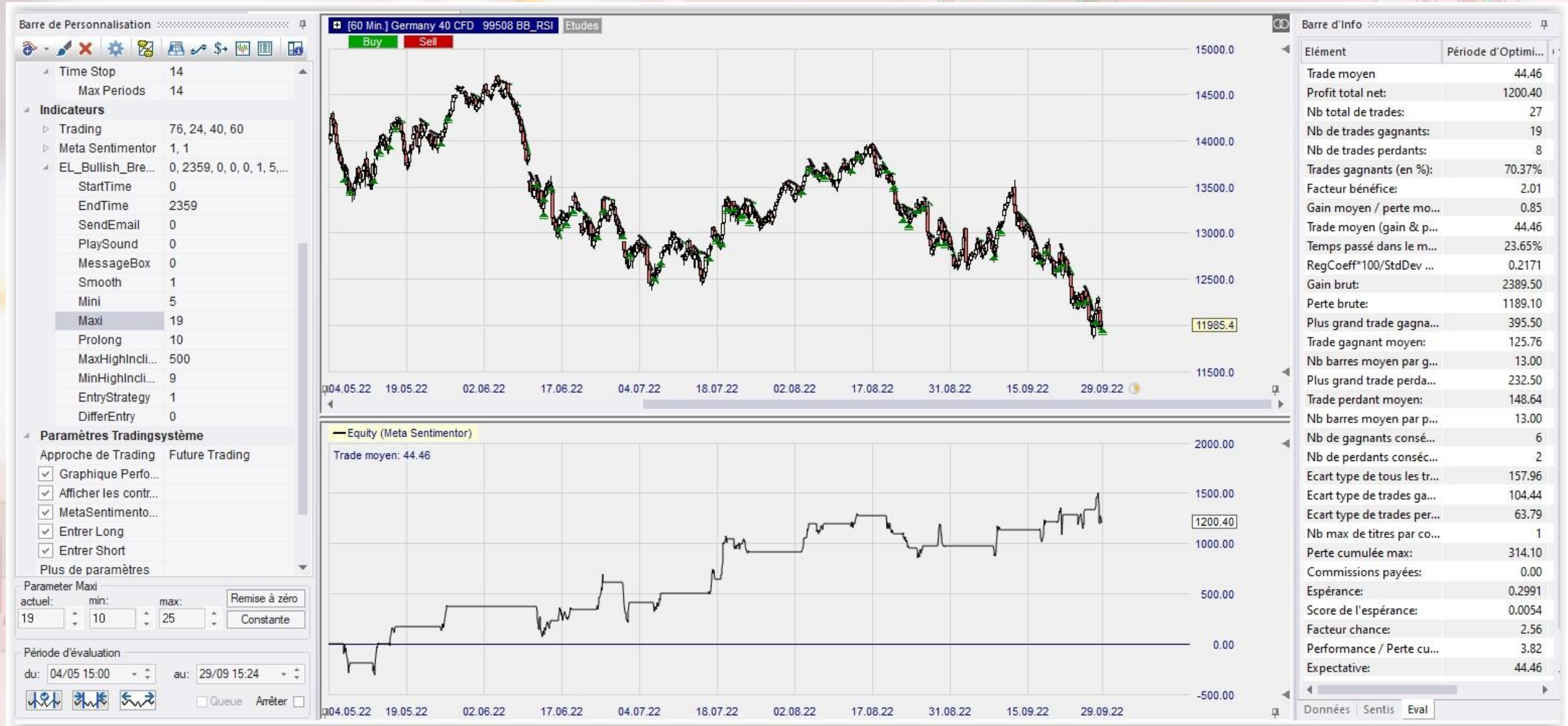
- Résultats de l'étude  
Avec filtre MTF



# Résultat de la période suivante (non vue dans le test)

- Résultats de l'étude, sans filtre

69,39



# Résultat de la période suivante (non vue dans le test)

- Résultats de l'étude, avec filtre Zone neutre

121,70



# Résultat de la période suivante (non vue dans le test)

- Résultats de l'étude, avec **filtre Mogalef Trend Filter**

92,28



# RSI

## Relative Strenght Index

Le RSI est un indicateur de gain en clôture.

$$RSI(x) =$$

- Gain depuis 1 période +
- Gain depuis 2 périodes +
- ... +
- Gain depuis x périodes.

Puis on ramène ce gain entre 0 et 100  
(autour de 50 qui est gain=0)

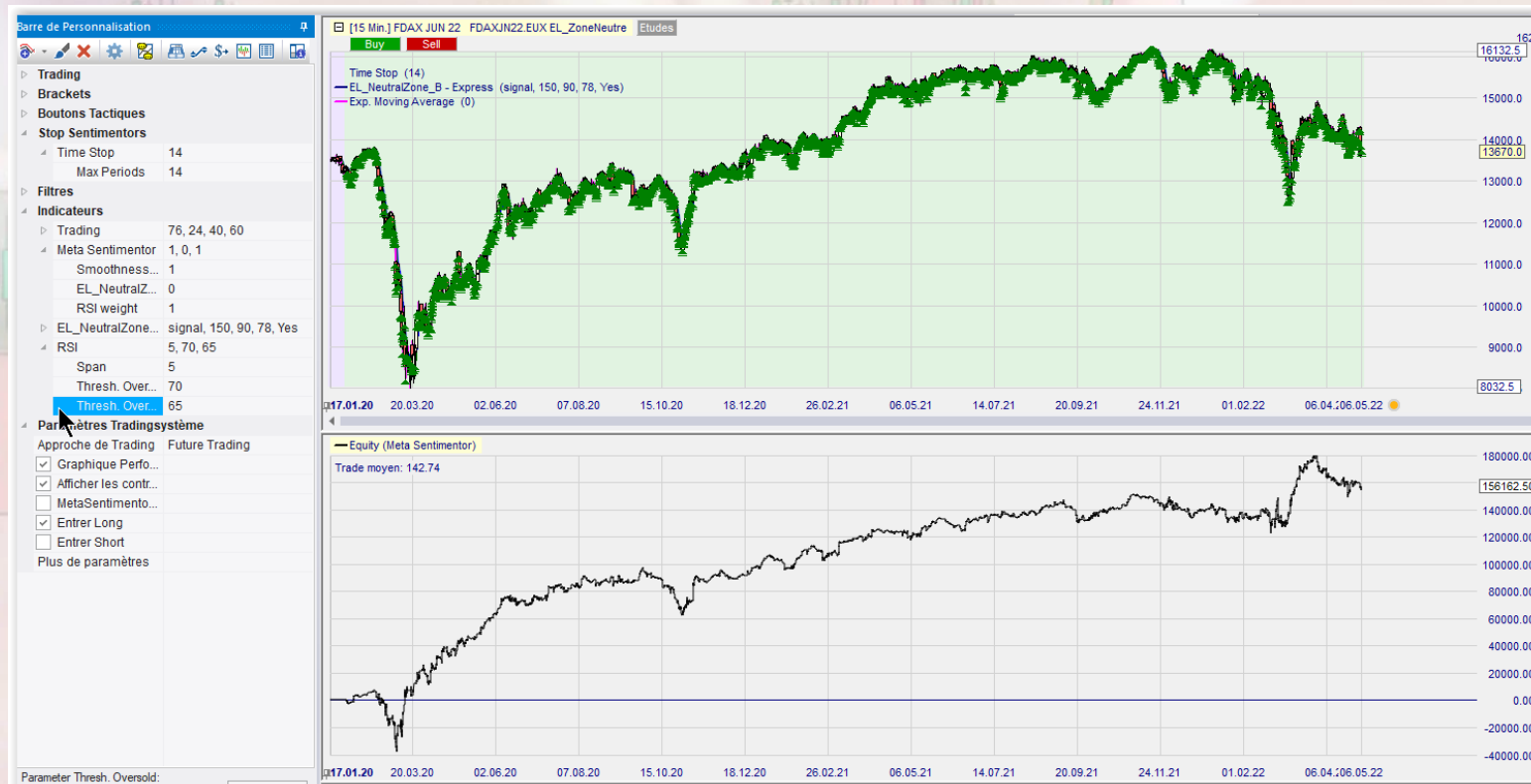
### Relative Strength Index



L'indicateur **Relative Strenght Index** (RSI) est un oscillateur qui permet d'identifier pour une valeur donnée des situations de sur-achat ou de sur-vente. Ces situations sont intéressantes pour les traders car elles peuvent être suivies d'un retournement de tendance. Le RSI évolue entre 0 et 100. Lorsque le RSI descend sous le niveau de 30, on considère que la valeur est survendue et on peut anticiper un retournement de tendance à la hausse. Lorsque le RSI monte au dessus du niveau de 70, on considère que la valeur est surachetée et on peut anticiper un retournement de tendance à la baisse.

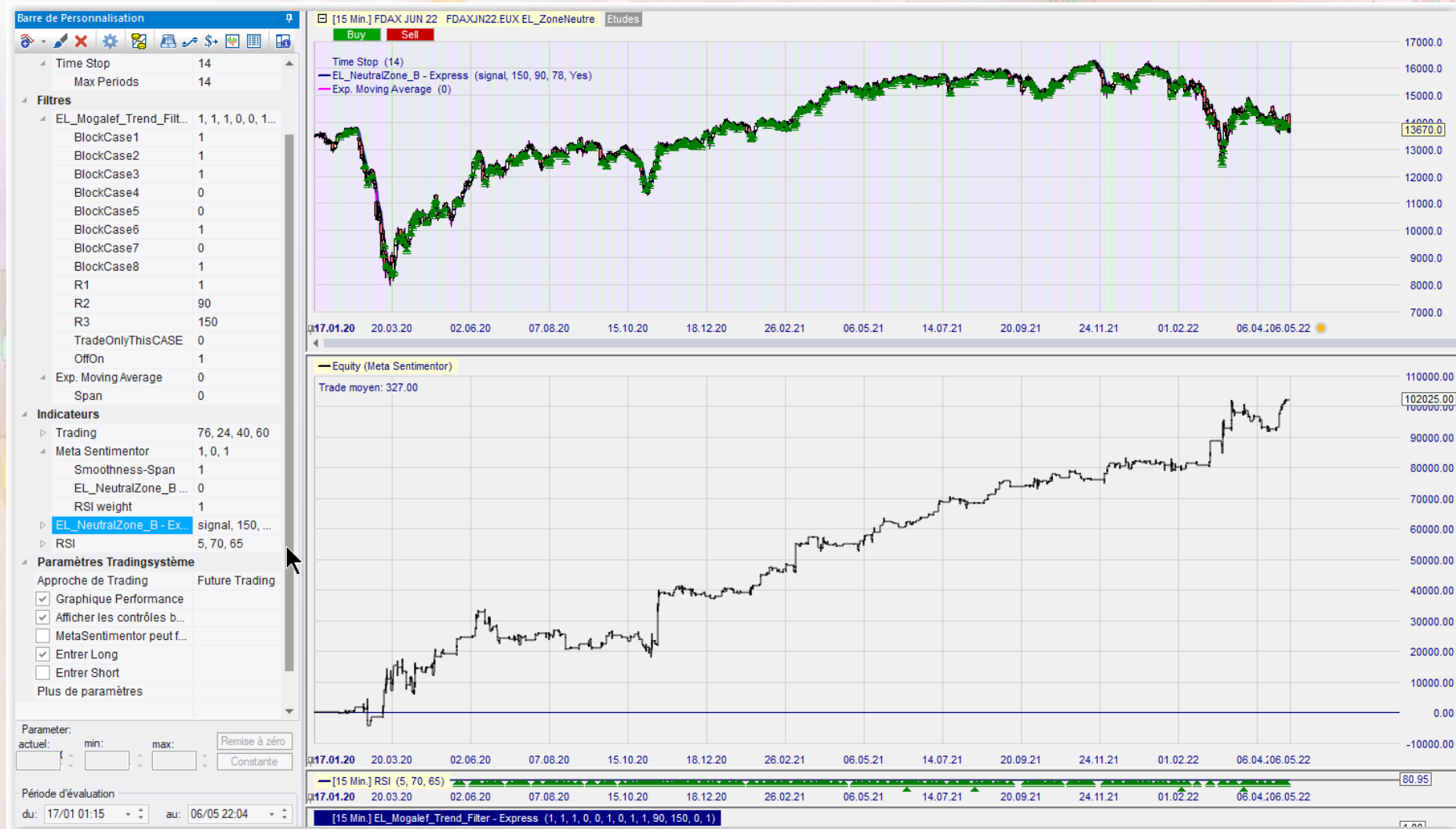
RSI 5 Comme on n'a rien de satisfaisant avec les paramètres usuels (aucun filtre efficace), je regarde ce que donne la courbe de gain avec une limite de passage différente de 30.

Je remarque que si l'on entre au passage du RSI d'inférieur à 65 à supérieur à 65 mais en dessous de 70 on obtient un meilleur résultat.



# Suivi de système RSI sur FDAX

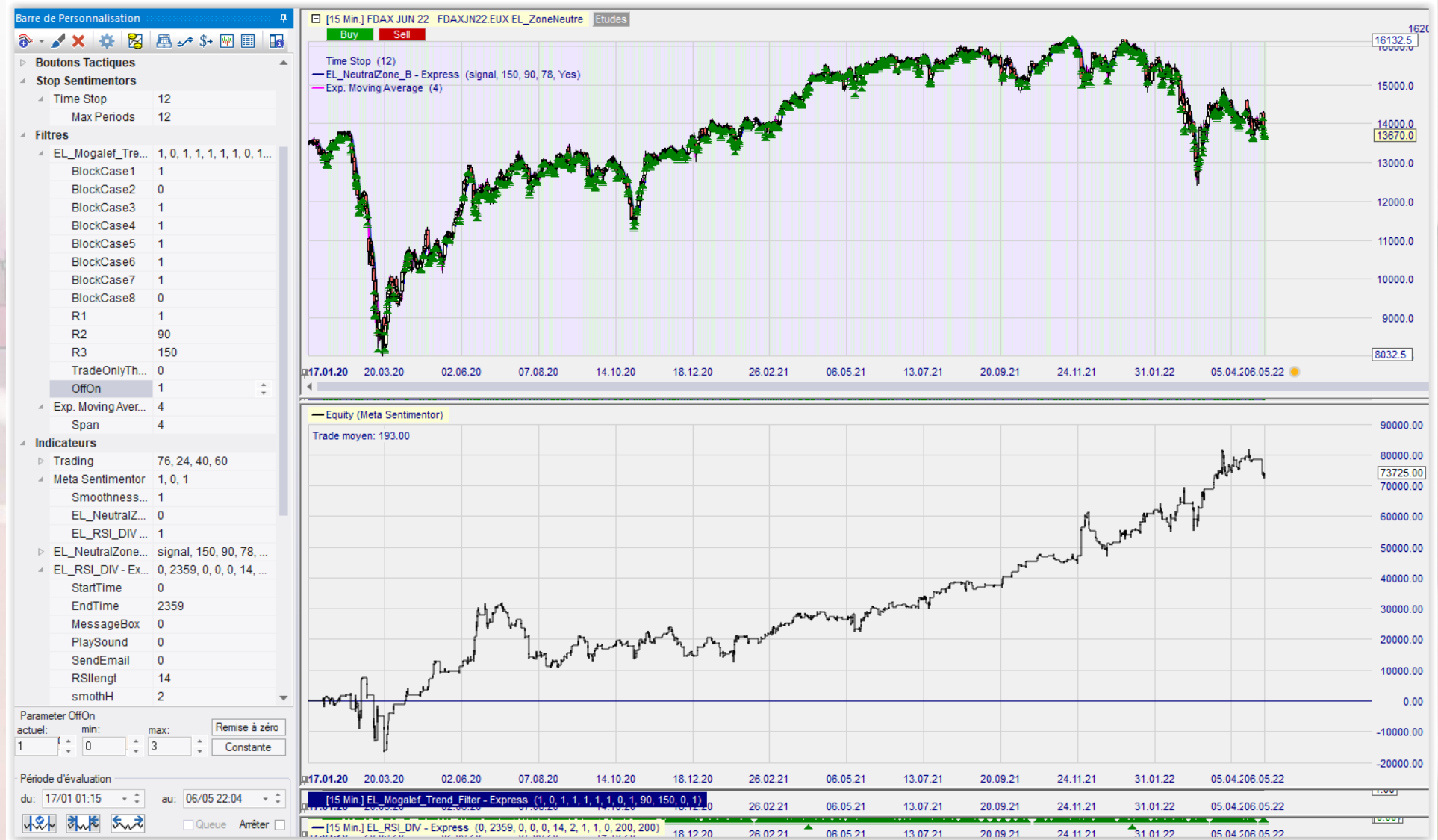
- Résultats de l'étude avec filtre MTF



# Résultat de la période suivante (non vue dans le test)



# Divergences RSI 14 Filtres MTF et MM4



# RSI 14 divergences

## Résultat de la période suivante (non vue dans le test)



# STOCHASTIQUE

## Slow Stochastics



L'indicateur **Slow Stochastic** est un oscillateur qui rapporte la position relative du cours actuel par rapport à l'intervalle de valeurs dans lequel les cours ont évolués au cours des X dernières périodes données.

# Suivi de système Stochastique sur FDAX

- Résultats de l'étude avec filtre Neutral-zone



# Résultat de la période suivante (non vue dans le test)



# Suivi de système Divergences Stochastique sur FDAX

## Ici on bloque le cas 8 et on ne laisse que le cas 1



**Note :** on enlève les cas 8 car il était idiot de le laisse lors de la conférence d'étude.

# STPMT Divergences

STochastique Pondérée Moyen Terme

Combinaison de 4 stochastiques pondérées.

- Sto 5
- Sto 14
- Sto 45
- Sto 75

Les deux rapides pour le timing

Les deux longues pour les grands cycles et la tendance.



# Suivi de système divergences STPMT sur FDAX

STPMT DAX  
Après Midi



# Suivi de système divergences STPMT sur FDAX

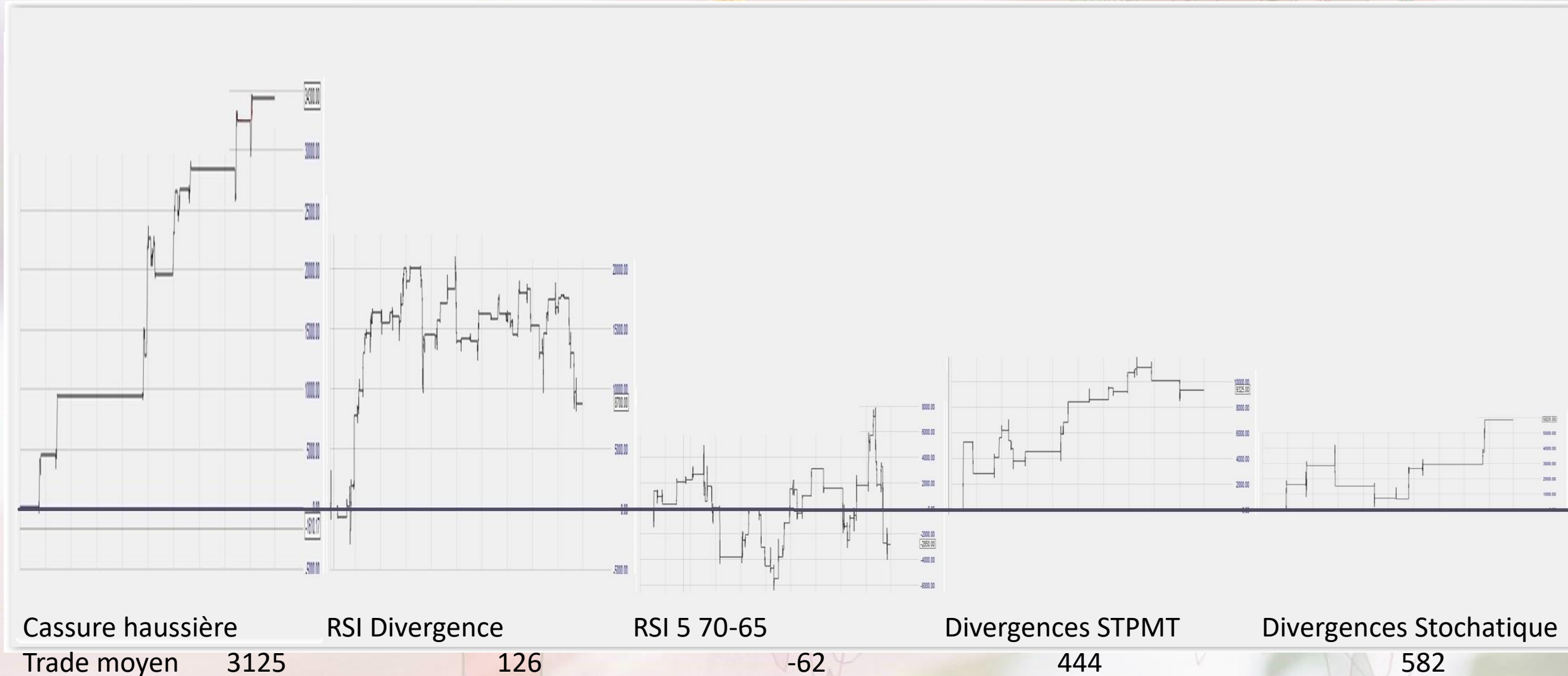


# Vision générale

- Les comportements des systèmes lors de l'étude initiale étaient tous assez satisfaisants.
- Les performances des systèmes sur la partie non-vue peuvent être différents de la partie étude:

Trade moyen	Etudes	Non-vues
- Cassure (pour 25 CFD = 1 Dax)	2300	3125
- RSI divergence	194	129
- RSI 70-65	326	-62
- STPMT divergence	435	444
- Sochastique divergence	507	582

Les gains sont ici mis à la même échelle pour la même taille de prise de position.  
Il sera nécessaire de moduler cette taille.



# Répartition du risque



Cassure haussière  
1 Mini Dax

RSI Divergence  
2 Mini Dax

RSI 5 70-65  
1 Dax ou 5 minis

Divergences STPMT  
1 Dax ou 5 minis

Divergences Stochatique  
1 Dax ou 5 minis



# Conclusions

- Le système RSI divergence était déjà trop juste en trade moyen. La pratique est pire, donc il est inutile d'insister sur cette unité de temps.
- Le système RSI 65-70 est perdant sur la période non-vue mais sur quelques mois il a déjà été perdant en période de test. On peut encore lui laisser sa chance, mais si on passe en réel il convient de diminuer sa taille de position.
- Les autres systèmes se comportent bien. La période non-vue est cependant trop courte pour avoir une réelle confirmation de leur solidité.



WHS Futures Station Home