

# Algorithmes de trading Les connaître, les trader.

Présenté par Eric Lefort de [Mogalef-Trading.com](http://Mogalef-Trading.com)  
En collaboration avec [WHSelfinvest](http://WHSelfinvest)

**Mogalef Trading**  
"There's no certitude, only opportunities." V

All charts are from WHSelfinvest NanoTrader

# Mogalef Trading

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

Panier - Shopping Cart €0.00

HOME SYSTEMS NEWS INDICATORS TOOLS PRIVATES CLUBS PRACTICE WITH MOGALEF FORMATIONS PANIER

Conférences WHSelfinvest 2016

Conférence Salon AT 2016

Conférences WHSelfinvest 2015

Conférences SALON AT 2015

Conférences SALON AT 2014

Conférences SALON DU TRADING 2014 **marché**

## CONFÉRENCES WHS 2016 Paris - France

PDF de la conférence donnée le 26 janvier 2016 chez WHSelfinvest PARIS



Entrer\_sur\_le\_marché.pdf

### Contextes favorables à des entrées efficaces

PDF de la conférence donnée le 16 février 2016 chez WHSelfinvest PARIS



Contextes favorables.pdf

Lien vers les fichiers textes à placer dans le répertoire ".../Documents/Nanotrader/Express" :  
Les indicateurs automatiques de tendance sont utilisables sur historique jusqu'au 30/06/2016.  
Au-delà de cette date ils resteront disponibles dans le [pack Mogalef MTI](#)  
Le Weisrock-Trend-Filter est en utilisation libre.

Téléchargement des Filtres de tendance.

### Détecter et utiliser la Force Relative

PDF de la conférence donnée le 22 mars 2016 chez WHSelfinvest PARIS



La Force Relative.pdf

Téléchargement des indicateurs de force relative décrits lors de la conférence.  
(Indicateurs pour la NanoTrader de WHS)  
Vous trouverez où placer ces fichiers dans le PDF.

Téléchargement de l'indicateur

Téléchargement de l'indicateur pour Screener

### Travail des impulsions de marché

PDF de la conférence donnée le 26 avril 2016 chez WHSelfinvest PARIS



Travail et setups d'impulsion.pdf

### Algorithmes de marché : les connaître et les trader

PDF de la conférence donnée le 21 juin 2016 chez WHSelfinvest PARIS



Trader avec les algorithmes.pdf

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

Le PDF de la conférence est disponible ici.

# Sommaire

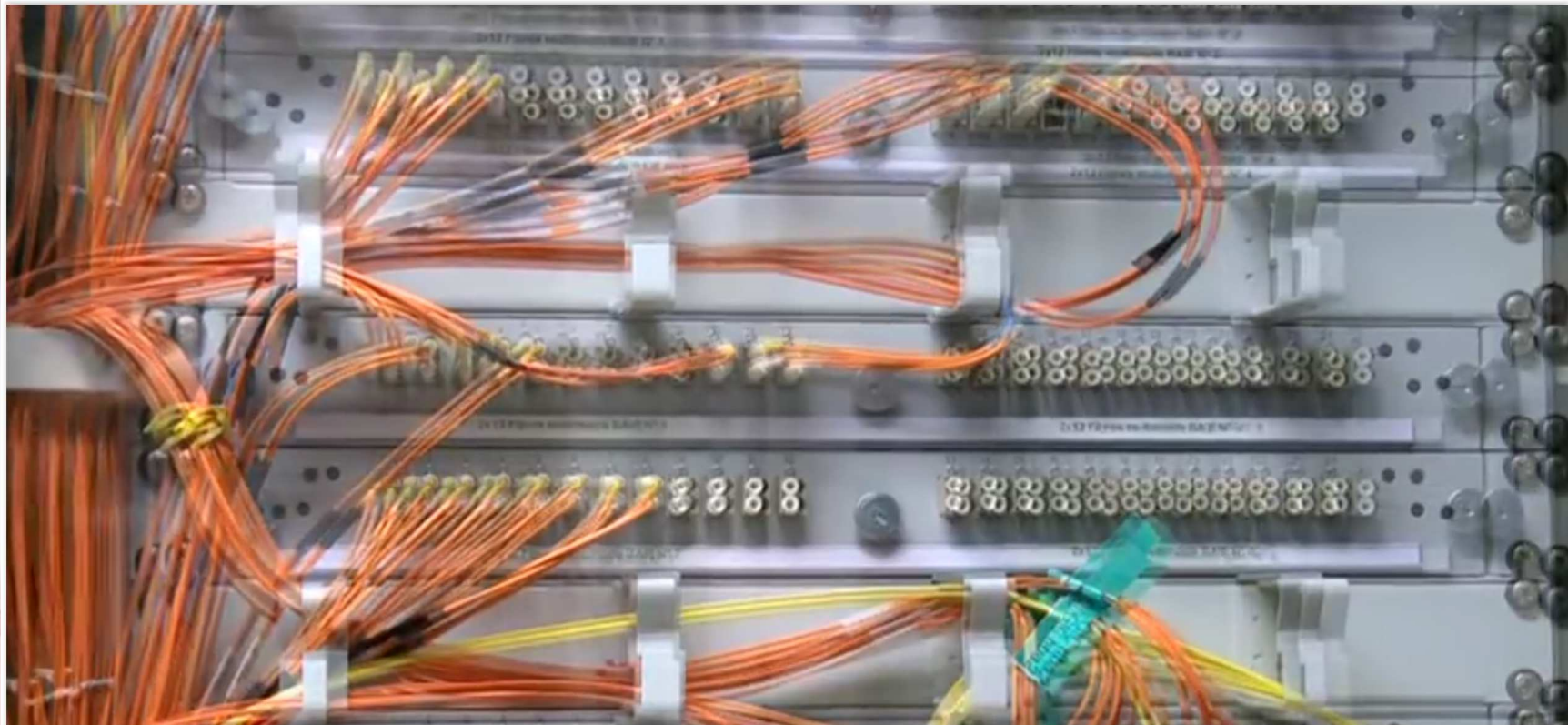
- Les algorithmes font le volume
- Algorithmes directionnels et prises de grosses positions
- Algorithmes de correction de couverture
- Algorithmes de détection d'écart Indice-Future
- Le trading haute fréquence: 30% du volume
- Exemple de leur influence sur l'évolution des prix
- Les algorithmes de trading directionnel
- Monter nos propres algorithmes avec la Nano

# L'ancien monde des traders



**Mogalef Trading**  
"There's no certitude, only opportunities." V

# 2/3 des ordres passés par les robots aux US



# Les algos de THF font 30% du volume du marché français



# Algorithmes de trading directionnel

- Sont programmés et reprogrammés en permanence :
  - Pour s'adapter aux conditions de marché
  - Pour échapper à la concurrence
  - Car leur rentabilité va toujours en s'affaiblissant avec le temps.
- Doivent pouvoir être pratiqués avec des volumes conséquents,

# Grosses prises de position

Bid	Prix	Ask	Moi
	4404.5		
	4404.0		
	4403.5		
	4403.0		
	4402.5		
	4402.0		
	4401.5		
	4401.0		
	4400.5	10	
	4400.0	24	
	4399.5	17	
	4399.0	27	
	4398.5	30	
	4398.0	37	
	4397.5	45	
	4397.0	62	
	4396.5	31	
	4396.0	19	
	<b>1 @ 4395.5</b>		
25	4395.0		
52	4394.5		
45	4394.0		
51	4393.5		
41	4393.0		
43	4392.5		
38	4392.0		
21	4391.5		
28	4391.0		
13	4390.5		
	4390.0		
	4389.5		
	4389.0		
	4388.5		
	4388.0		
	4387.5		

	10102.5		
	10102.0		
	10101.5		
	10101.0		
	10100.5		
	10100.0		
	10099.5		
	10099.0		
	10098.5		
	10098.0		
	10097.5	9	
	10097.0	12	
	10096.5	14	
	10096.0	15	
	10095.5	12	
	10095.0	16	
	10094.5	15	
	10094.0	10	
	10093.5	7	
	<b>3 @ 10093.0</b>	14	
	10092.5		
3	10092.0		
6	10091.5		
13	10091.0		
10	10090.5		
10	10090.0		
14	10089.5		
14	10089.0		
14	10088.5		
17	10088.0		
15	10087.5		
	10087.0		
	10086.5		
	10086.0		
	10085.5		
	10085.0		
	10084.5		
	10084.0		
	10083.5		

Bid	Prix	Ask	Moi
	3006		
	3005		
	3004		
	3003		
	3002		
	3001		
	3000		
	2999		
	2998	1569	
	2997	1484	
	2996	1755	
	2995	1534	
	2994	1710	
	2993	1662	
	2992	1969	
	2991	1309	
	2990	1758	
	2989	1209	
258	<b>26 @ 2988</b>		
1400	2987		
1364	2986		
1363	2985		
1414	2984		
1362	2983		
1534	2982		
1645	2981		
1540	2980		
1336	2979		
	2978		
	2977		
	2976		
	2975		
	2974		
	2973		



# Les grosses prises de position

- Doivent être morcelées
- Les prises partielles de position sont programmées pour avoir lieu :
  - Sous des fréquences aléatoires
  - Avec un volume aléatoire
- Elles doivent passer le plus inaperçu possible pour échapper à la concurrence du trading haute fréquence

# Correction de couverture

- Certains gestionnaires doivent toujours équilibrer leurs portefeuilles et en couvrir les variations éventuelles à l'aide des futures.
- Les variations entraînent donc des achats et des ventes de couverture expliquant en grande partie la liaison intime cash-future.
- Ces interventions sont en général automatiques.

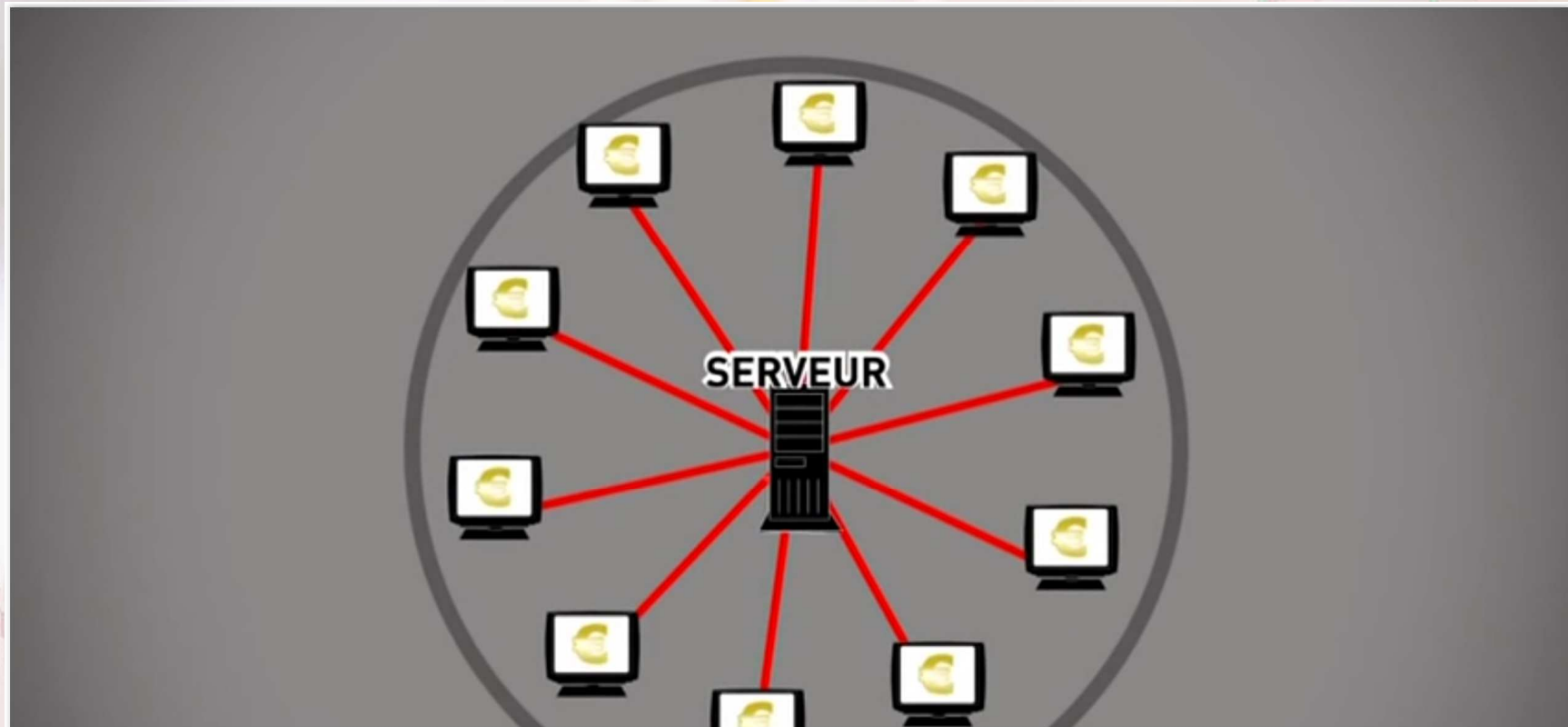
# Trading haute fréquence

**0,000 000 1sec**

# THF

- Le trading haute fréquence c'est une capacité à utiliser une supériorité technologique pour passer devant les autres.

# Le temps de transport implique une géolocalisation optimisée



Et quelque fois, c'est même la Bourse qui se déplace pour se rapprocher de ses gros clients



# Qui donc pratique le THF sur le dos du contribuable ?

de sommes qui, selon moi, seraient plus utiles à d'autres activités.

**M. Patrick Suet.** Annoncez alors publiquement, monsieur le député, que vous allez supprimer le crédit d'impôt recherche à toute activité de fabrication de logiciels. Vous rappelez que la réforme l'a étendu, il y a maintenant vingt-cinq ans, au secteur des logiciels.

**M. Jean-Pierre Gorges, Rapporteur.** Lorsque vous utilisez des ordinateurs et des logiciels, vous achetez un élément qui a fait l'objet d'une recherche. Les banques ne sont pas intéressées par le matériel – le *hardware* – ou des logiciels – le *software*. J'ai l'impression que nous payons deux fois : en amont, à l'entreprise qui a fait l'objet de l'innovation, et en aval, à la banque. J'ai moi-même eu l'occasion de travailler dans la banque pour effectuer des transferts de données : il s'agit de la compression verticale, qui n'a fait l'objet d'aucun brevet car cela n'est pas dans le cadre de mon travail. Les solutions techniques viennent de l'extérieur et non de la banque, aucun banquier ne se risquerait à créer au sein de son établissement un système d'innovation car il cherche avant tout à se protéger de ses propres informaticiens. Je ne

# Gains du THF en un an à WS



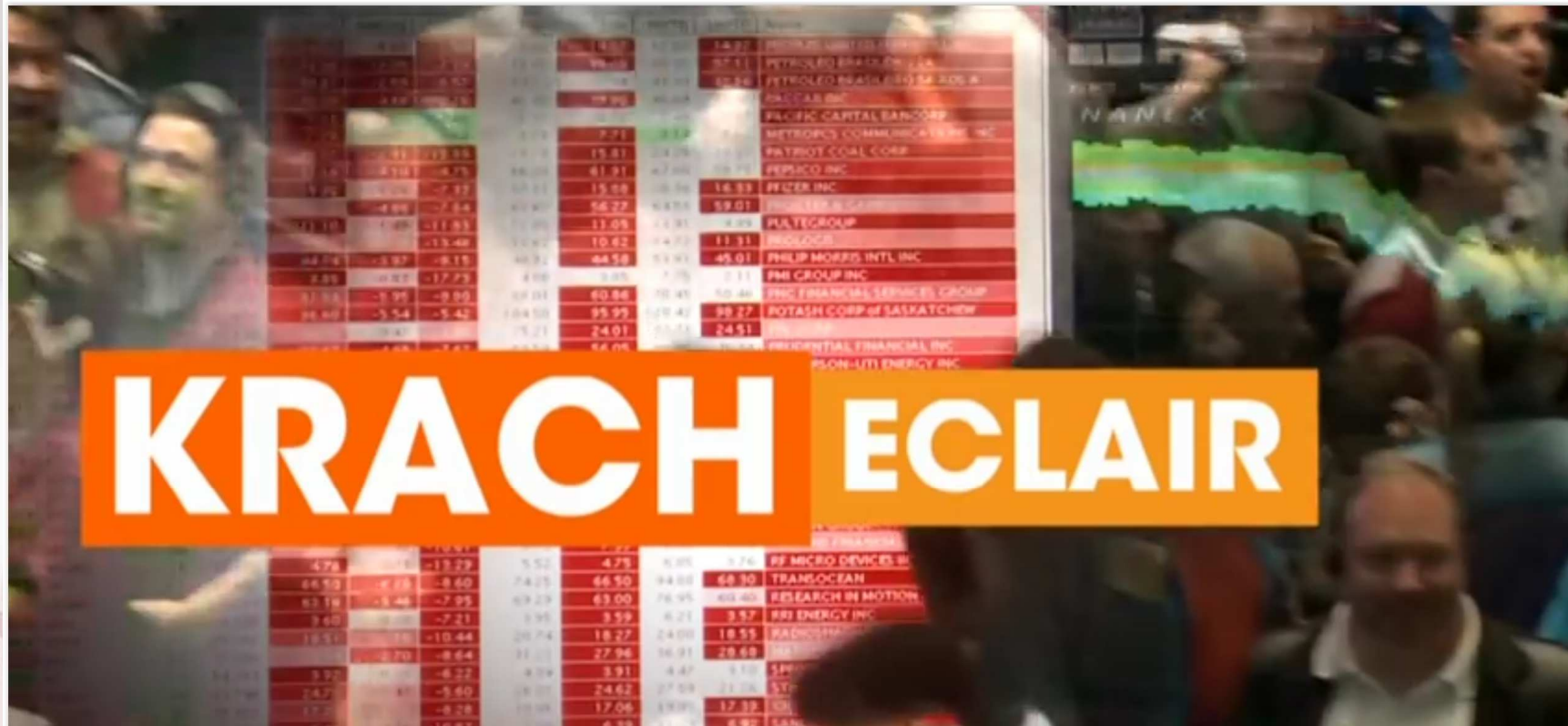


# THF

Des méthodes illégales :

- On sature le marché d'ordres instantanément enlevés pour ralentir la concurrence, ralentir les flux pour l'ensemble des opérateurs.
- On brouille le marché en faisant apparaître des ordres ultra rapides très rarement exécutés pour donner de fausses informations aux autres opérateurs,

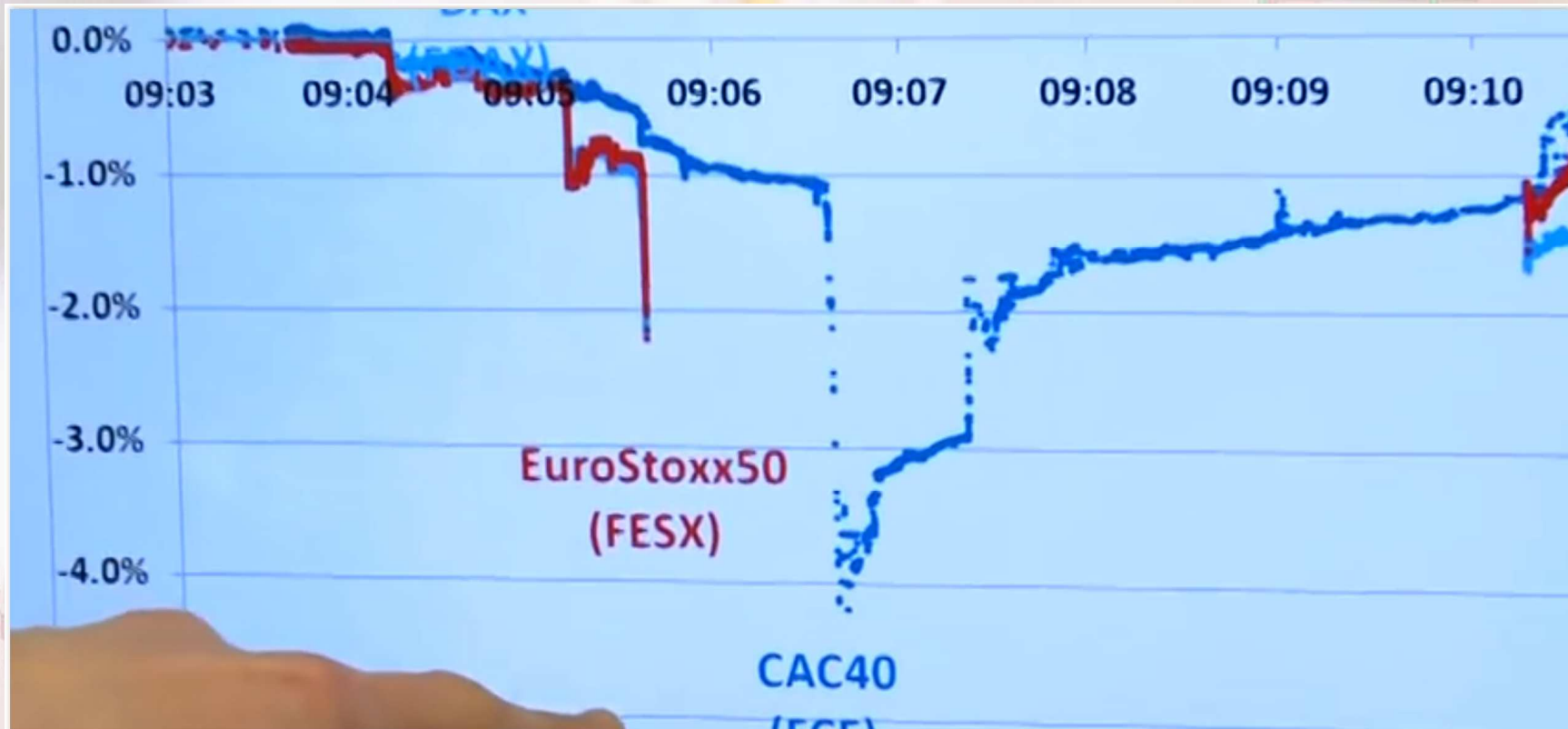
# Le risque : la perte de contrôle comme le 6 mai 2010



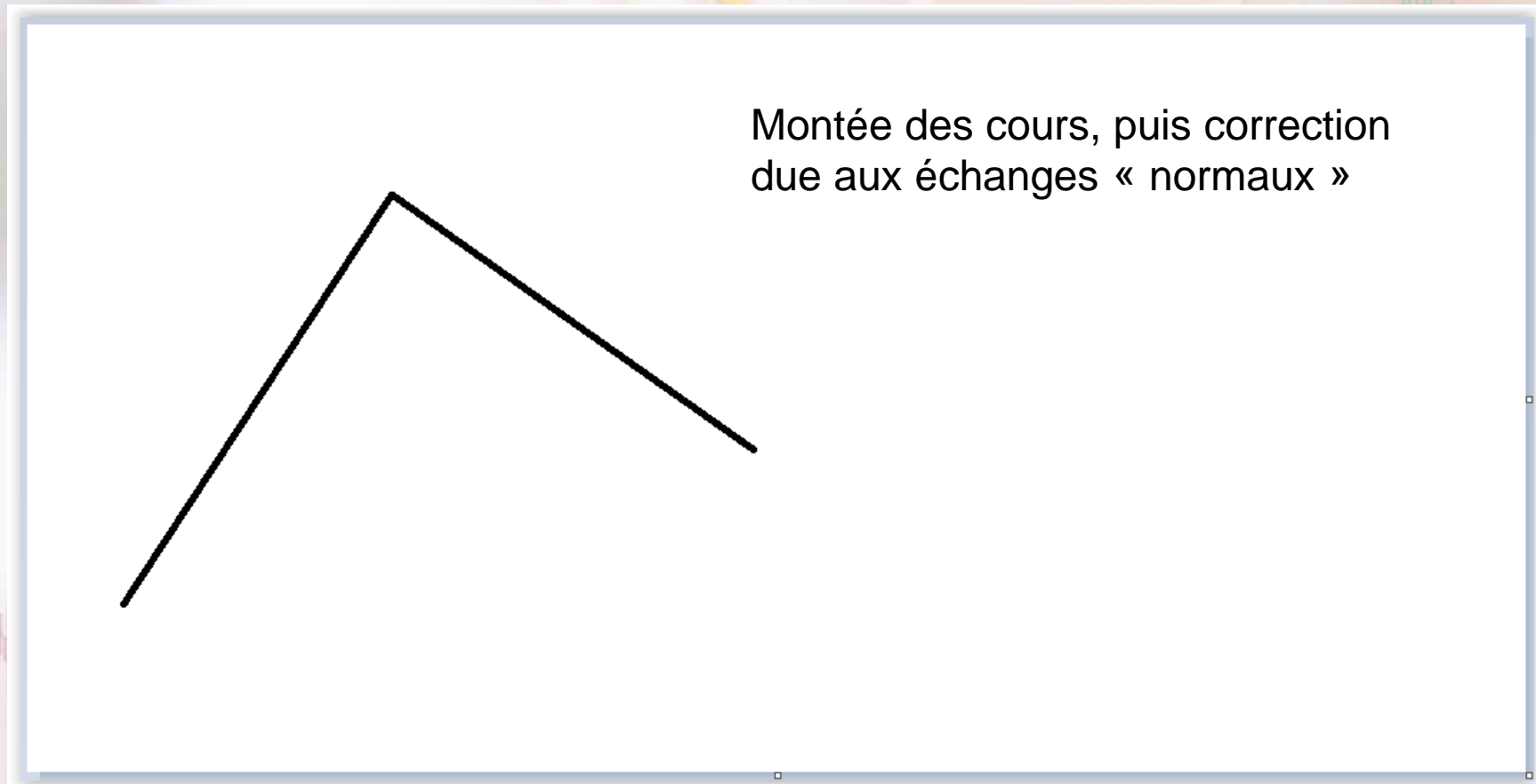
Aux Us ce jour là,  
et ce risque existe-t-il toujours?



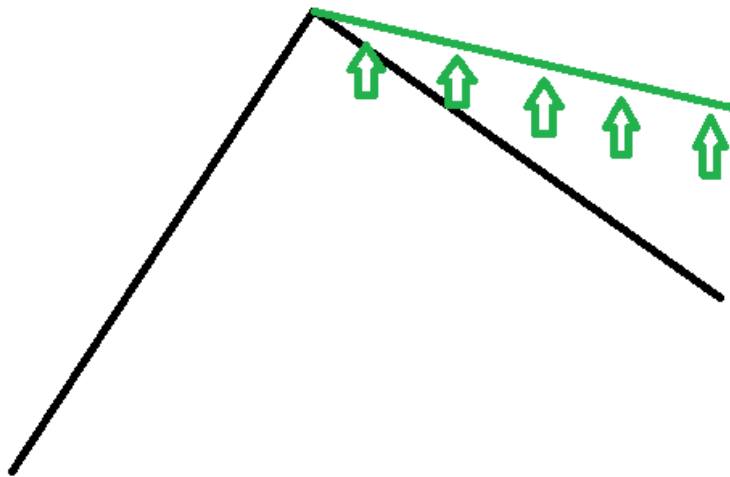
Oui: à Paris le CAC chute de 3% en quelques secondes



# Exemple de l'influence des divers algos sur l'évolution du future.

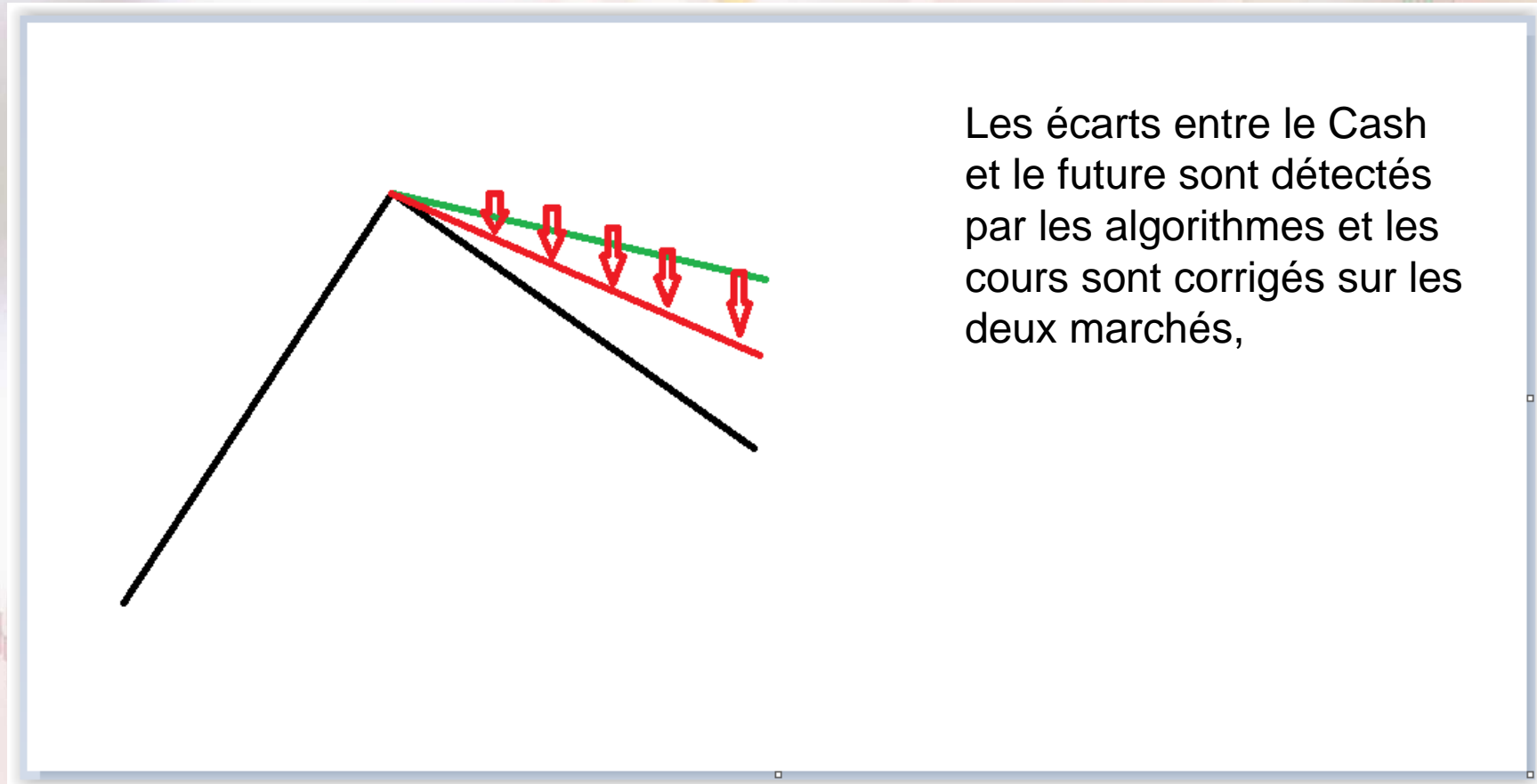


# Algorithme de trading à forte position



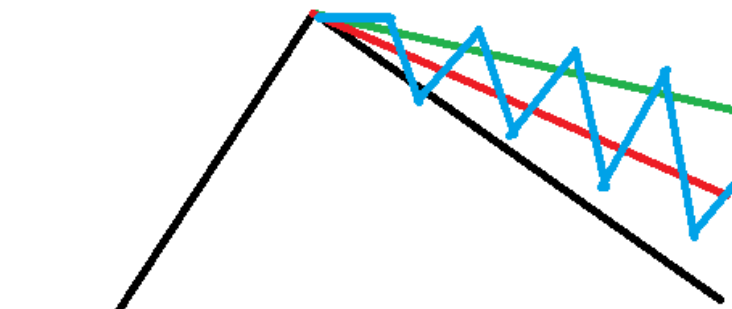
Un algorithme de constitution de position profite de la correction pour placer ses ordres d'achat. Il crée un écart par rapport au cours théorique. Cet écart va être détecté par les programmes.

# Algorithmes d'équilibrage



Les écarts entre le Cash et le future sont détectés par les algorithmes et les cours sont corrigés sur les deux marchés,

# Trading haute fréquence



Puis le THF va amplifier les variations en prenant de vitesse les autres donneurs d'ordres.

Le THF profite de la lenteurs relative des autres algos pour « manger » une partie ou la totalité de leurs bénéfices.



# Au niveau du petit porteur

- Il n'est pas possible de concourir avec les configurations de trading directionnel tradées par les gros porteurs,
- Les frais sont trop élevés et les interventions trop lentes pour trader l'arbitrage,
- Il est totalement illusoire de vouloir concurrencer le trading haute fréquence.

# Restent :

- Le trading discrétionnaire et/ou
- Trouver des algorithmes concernant de petites niches de marché, domaine qui n'intéressent pas (ou plus) les gros intervenants.

Dans cette dernière partie nous allons voir comment, avec quels éléments rechercher ces « niches de marché ».

# Première étape, le couple signal-environnement

- On ne trade que très rarement un signal seul.
- Un signal ne vaut que grâce à l'environnement qui lui est associé.
- Un environnement ne donne son potentiel que grâce aux signaux qui lui sont associés.

# Signaux

Les signaux peuvent être des indicateurs standard.



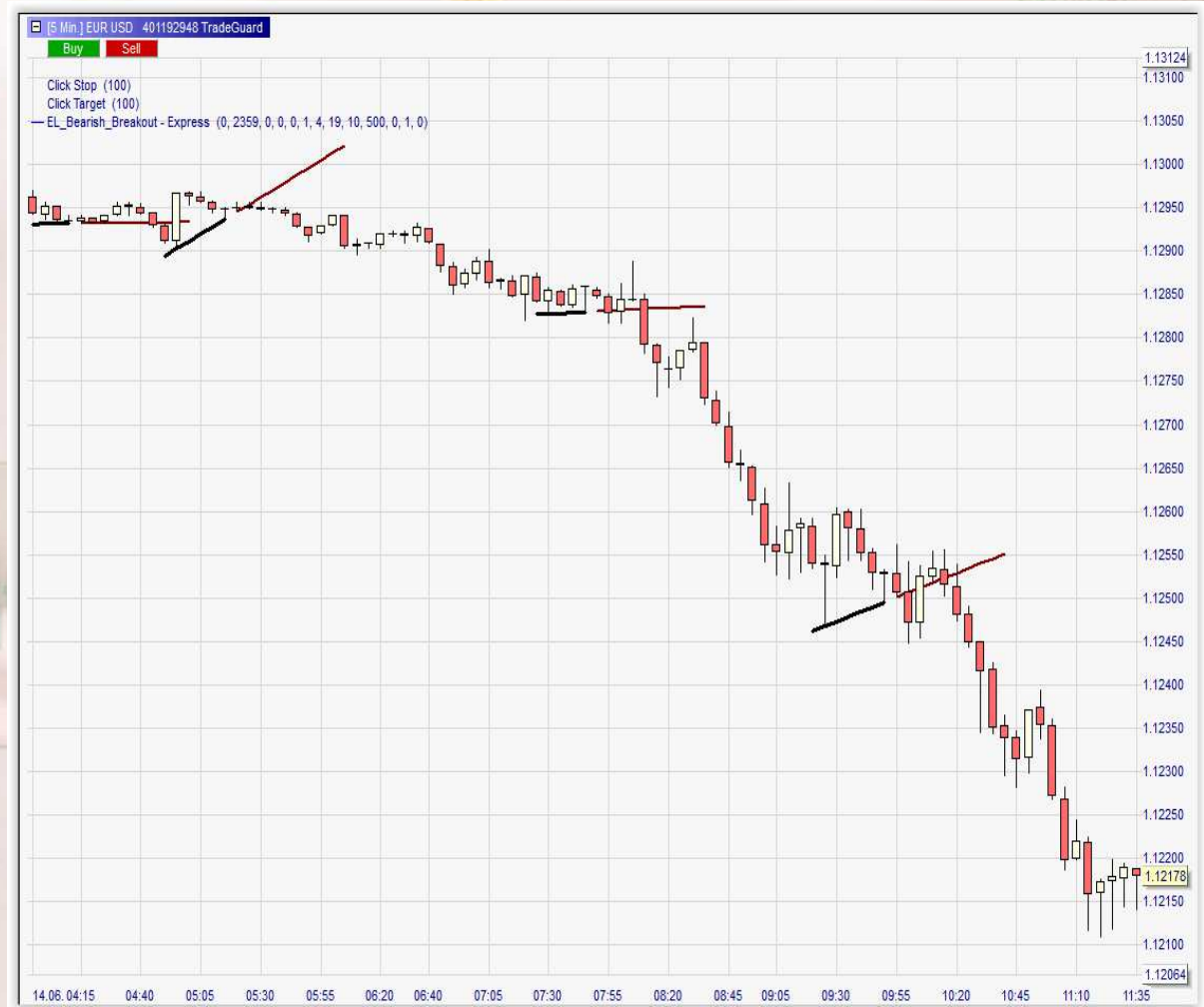
# Signaux

Les signaux peuvent être des indicateurs spécialisés.



# Signaux

Les signaux peuvent être des indicateurs graphique, tels des lignes tracées en manuel ou en automatique.



**Propriétés de ligne**

Nom: 15.06. 15:13

Valeur-Départ: 1.12215 15.06. 15:13

Valeur-Fin: 1.12182 15.06. 15:31

Extension de Droit:  Effacer la Ligne

Couleur: █ Largeur: 2

Premier plan

Utilisation: Sentimentor

- Dessin seul
- Stop-Long
- Visualiser les zones
- Stop-Short
- Stop-Sentimentor
- Sentimentor
- Filtre

Message au prochain croisement haussier

Message au prochain croisement baissier

Son:  Sélectionner

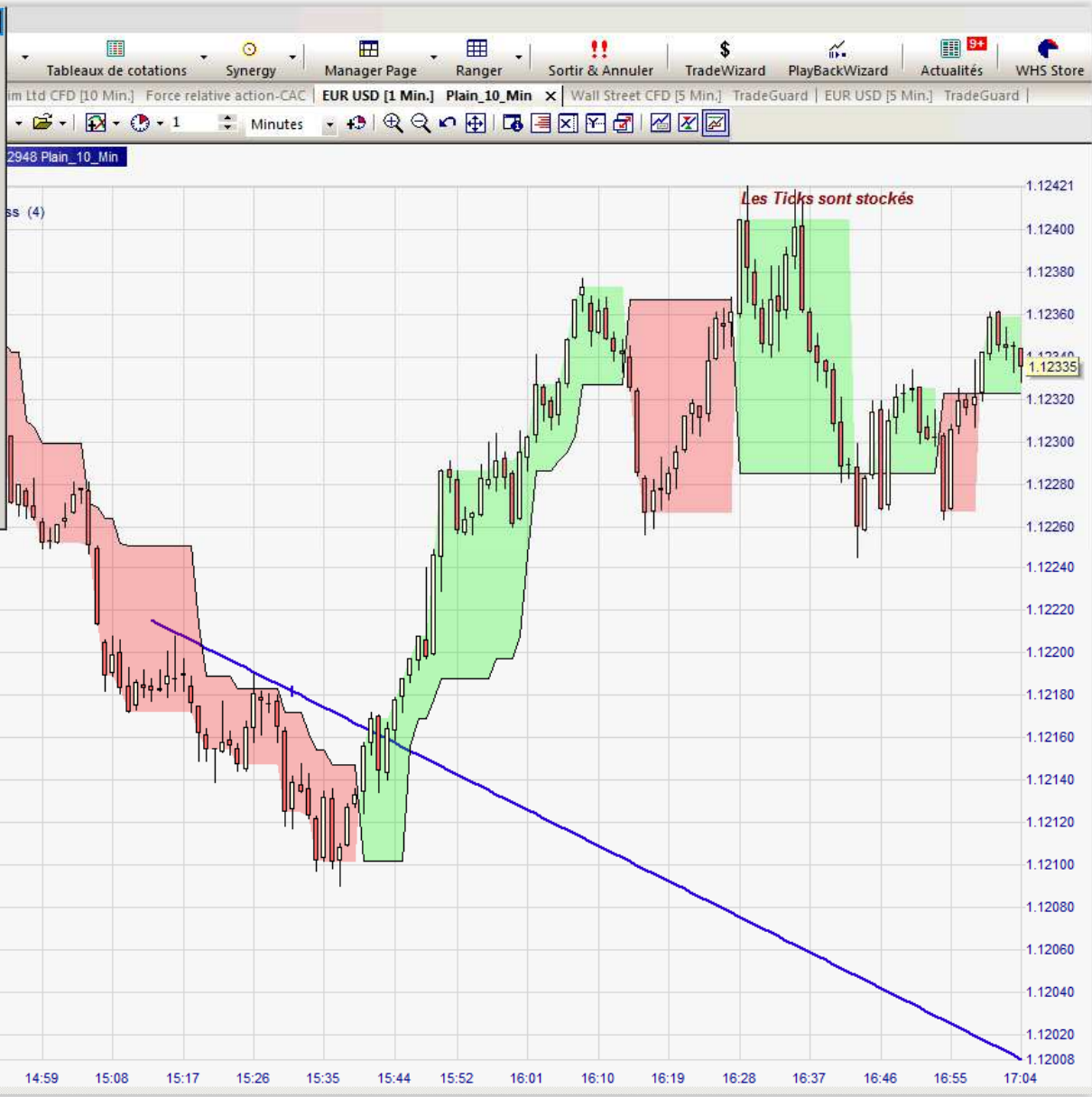
eMail Jouer

Définir les Paramètres par Défaut

OK Annuler Appliquer

**Indicateurs**

- E\_XLB\_indic
- Paramètres T...



# Environnements

Parmi les filtres d'environnement les plus simples, on peut citer les moyennes mobiles.



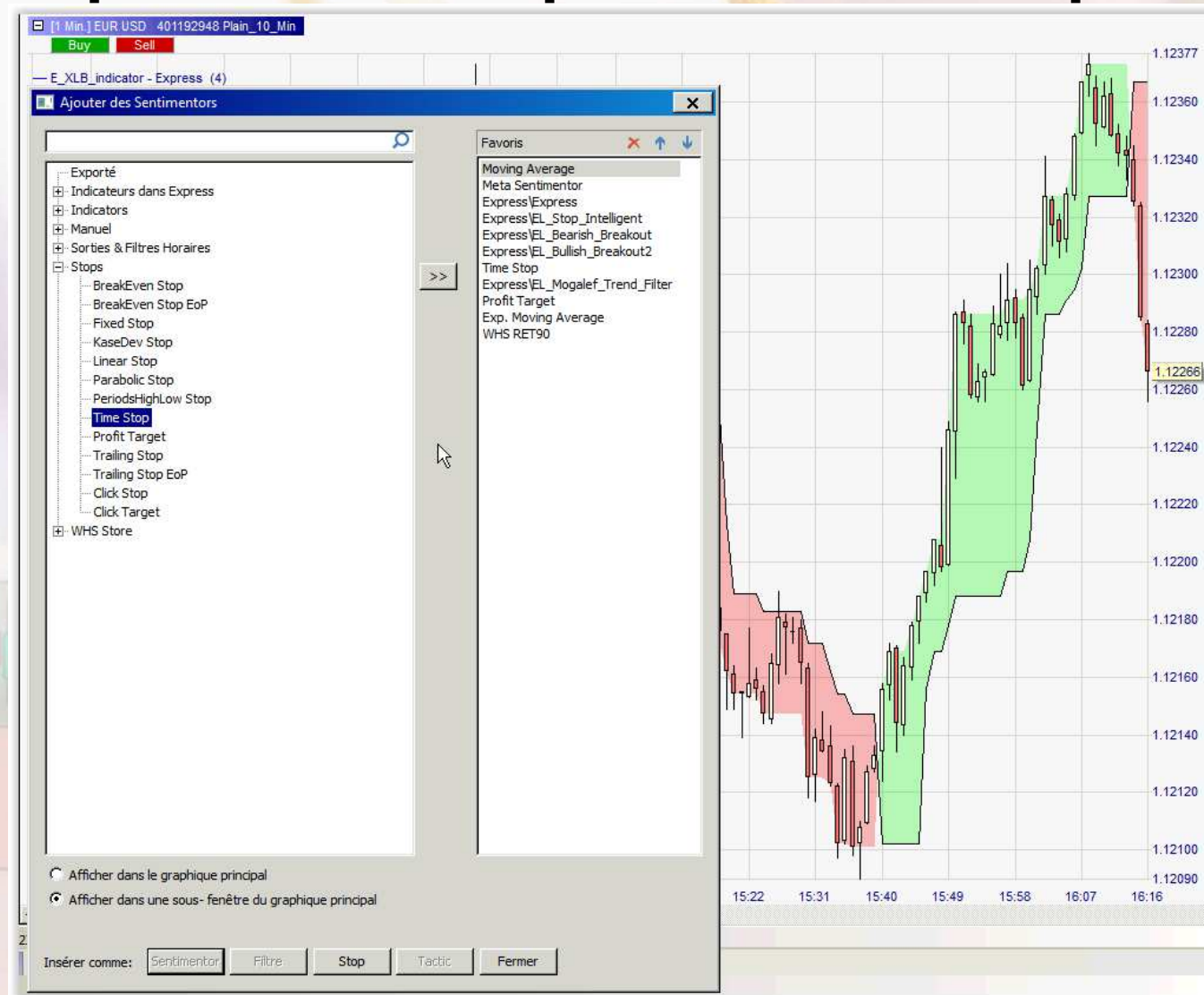


# Filtres d'environnement

On peut aussi compter sur des filtres spécialisés dans la mesure de poussée sous-jacente,



# Les prises de profit et de perte



- Utilité du Time Stop

# Les stops suiveurs



Ici, l'occasion d'aborder le Meta Sentimentor de la Nanotrader Full

# Importance des filtres horaires

☰ Filtres

☒ Exp. Moving Average	150
☒ EL_Mogalef_Trend_F...	0, 0, 1, 1, 1, 1, ...
<input checked="" type="checkbox"/> Block	00:00 - 08:59
<input checked="" type="checkbox"/> Block	11:30 - 23:59 ...



Ou même de filtres journaliers !

# En résumé, pour élaborer un algorithme il vous faut au moins

- Un plan, une idée.
- Un signal (au minimum).
- Au moins un facteur d'environnement (filtre de situation, de poussée, temporels...)
- Une ou plusieurs conditions de sortie (stops fixes, time stop, stop suiveur, objectifs, indicateurs...)



**Mogalef Trading**  
 "There's no certitude, only opportunities." V

Un système de trading simple expliqué

# Retrouvez ce système et sa vidéo explicative sur Mogalef - Trading

All charts are from WHSelfinvest NanoTrader

## Mogalef Trading

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

Panier - Shopping Cart €0.00

HOME SYSTEMS NEWS INDICATORS TOOLS PRIVATES CLUBS PRACTICE WITH MOGALEF FORMATIONS PANIER

Mogalef Clubs NEWS

-  **Scalping Dax 30 Futures & CFD sur DAX 10mn**
- Complete System Mogalef Tools
- DAX X Line break trading system
- Bearish Breakout for bearish market
- Aus dollar-US dollar bullish breakout
- Euro-Dollar Repulse Divergence
- CFD CAC Breakout
- Bearish Breakout test results
- Bearish Breakout Continuation
- Bullish Breakout Tests results
- CCI Divergences
- Triangle Trading Systems
- Bullish Breakout on DAX CFD
- Wedge - Biseau 1
- Trading System Alert03

 **"Scalping" trading system on 10' DAX for MTI Club**

This trading system is able to work with CFD or Futures. It operates on 10 minutes, daytrading only, and with a relatively reduced risk. It is a buy only system.

All the parameters are visible on the images which follow. Do not forget to modify the interpretation of BOTH moving averages in 100,100, 0, 0 (picture 1)

Parameters to modify are :

- Profit target = 30 - 30
- Fixed Stop = 140 - 30 (70 points = 140 ticks futures)
- Time Stop = 8
- EL Mogalef Trend Filter = 1-1-1-1-1-1-0-01-90-150-0-1
- Trading : 90 - 10 - 10 - 60
- Exp.Moving Average = 180
- Moving Average = 30
- EL Bullish Breakout = 900-2000-0-0-0-1-8-12-10-500-0-1-0

Indication of improvement :

Try to vary hours in the EL\_Bullish\_Breakout. Per exemple try 17h or 18h instead of 20h (1700 or 1800 instead of 2000)

 Vidéo  Video

# Ne croyez pas que ce soit facile !

- Il faut consacrer un peu de temps et d'énergie à l'apprentissage du logiciel. « Il n'y a pas de bons ouvriers sans bons outils » ... et sans apprendre à s'en servir.
- Il faut beaucoup de réflexion et de travail de recherche pour affiner et valider les idées que l'on a. Sans persévérance on passe à côté, même si l'on a la bonne inspiration.