

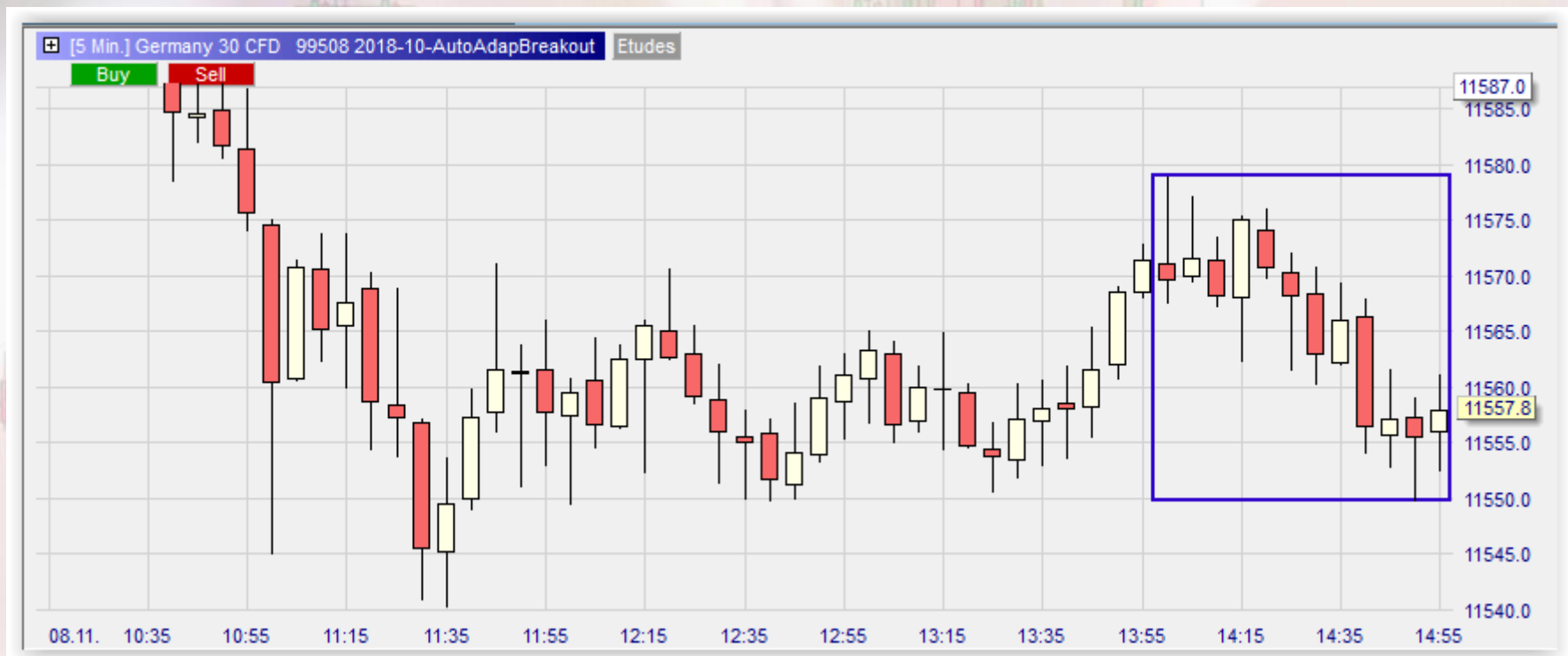
Stratégie de breakout auto-adaptative avec la NanoTrader

Présenté par Eric Lefort du groupe Mogalef

En collaboration avec WHSelfinvest

Principe des stratégies de breakout

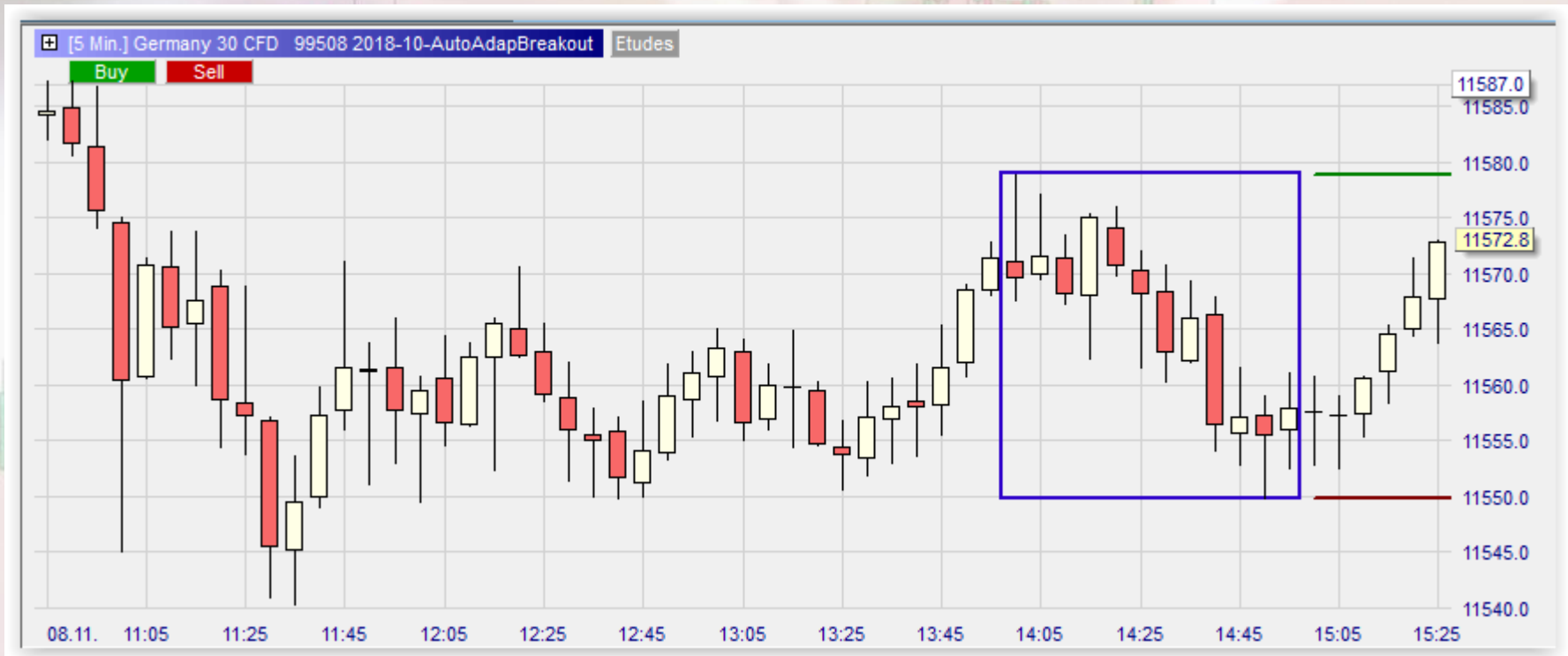
- On laisse le marché tracer un range de prix entre deux horaires déterminés. Ici de 14h à 15h.



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

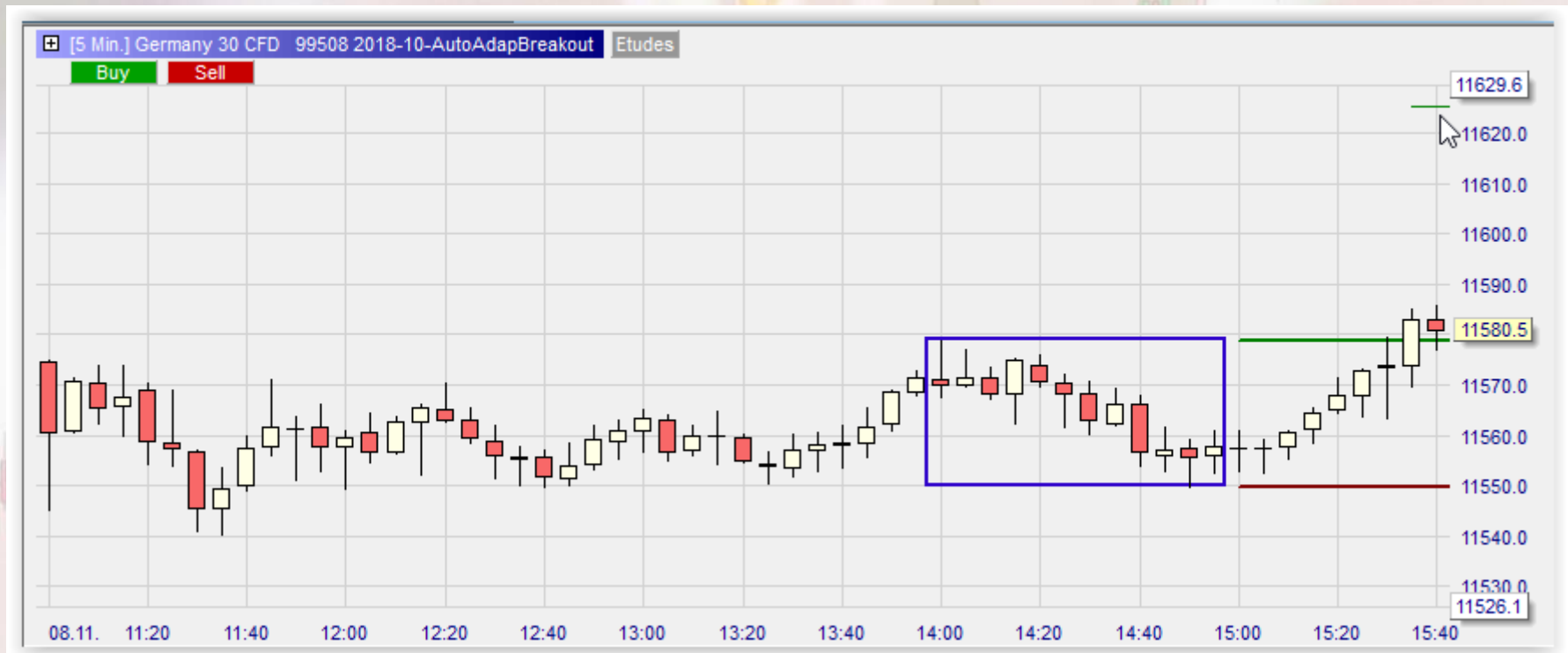
- On achètera si le range est cassé par le haut.
- On vendra si le range est cassé par le bas.



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

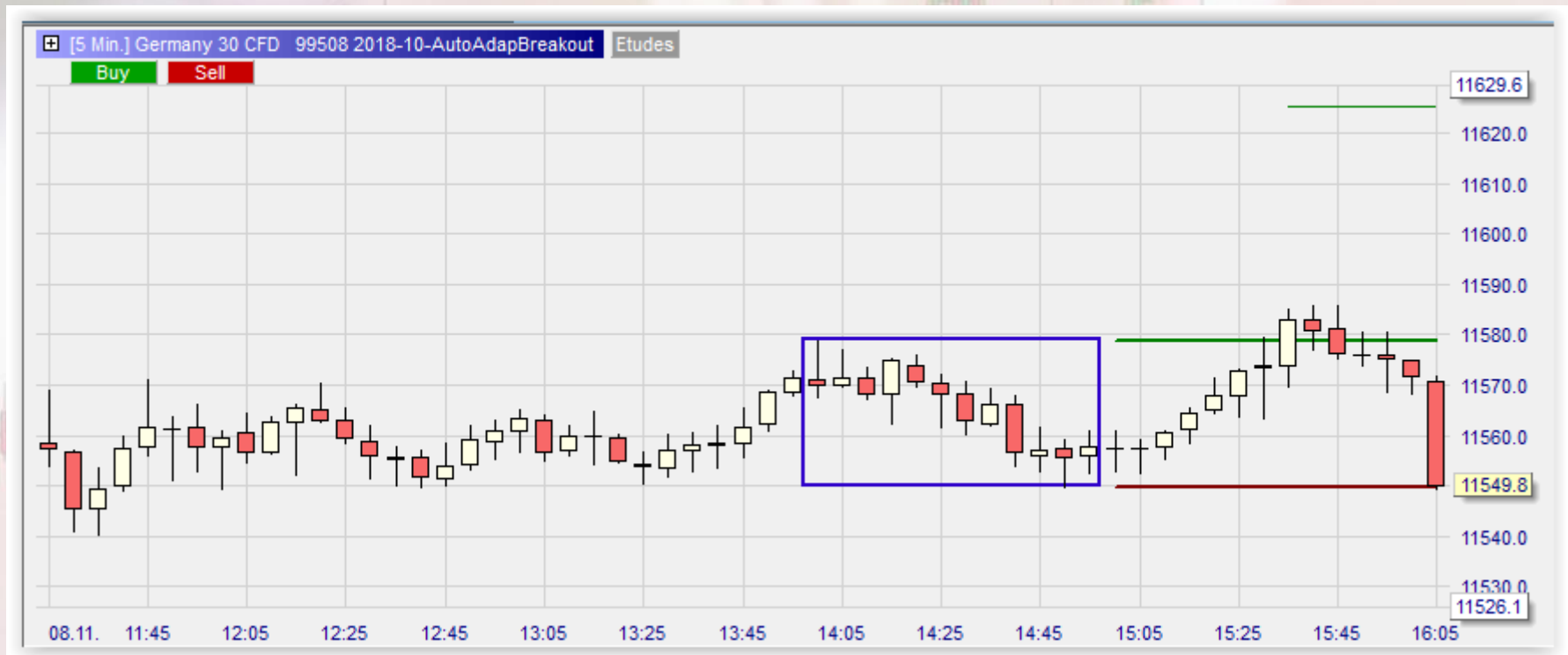
- On définit un objectif de gain.



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- On définit un stop, communément le bord opposé du range.



Les difficultés

- Déterminer quel range est le mieux adapté pour le support considéré.
- Déterminer quel objectif adopter, combien le marché est couramment disposé à donner.
- Trouver un niveau de stop acceptable et ne limitant pas ou peu les gains.
- Adapter le range et l'objectif aux variations de comportement du marché.

Déterminer quel range est le mieux adapté pour le support considéré.

- L'expérience prouve qu'un range donné peut passer de très favorable pendant une période à défavorable dans une autre période,
- L'idéal serait de changer de range en fonction de la pertinence du moment.

Déterminer quel objectif adopter, combien le marché est couramment disposé à donner.

- Les marchés évoluant constamment, il serait intéressant d'adapter l'objectif en fonction non seulement de la volatilité, mais aussi du penchant directionnel (ou pas) du moment,
- Une telle adaptation se doit d'être rapide et de coller aux variations du marché.

Trouver un niveau de stop acceptable et ne limitant pas ou peu les gains.

- Le niveau de stop doit être acceptable pour une maîtrise du risque pour le portefeuille, donc le plus près possible.
- Il doit être acceptable pour la stratégie, donc assez lointain pour ne pas transformer trop de trades gagnants en trades perdants.

Examiner les gains suivant les heures et les objectifs.



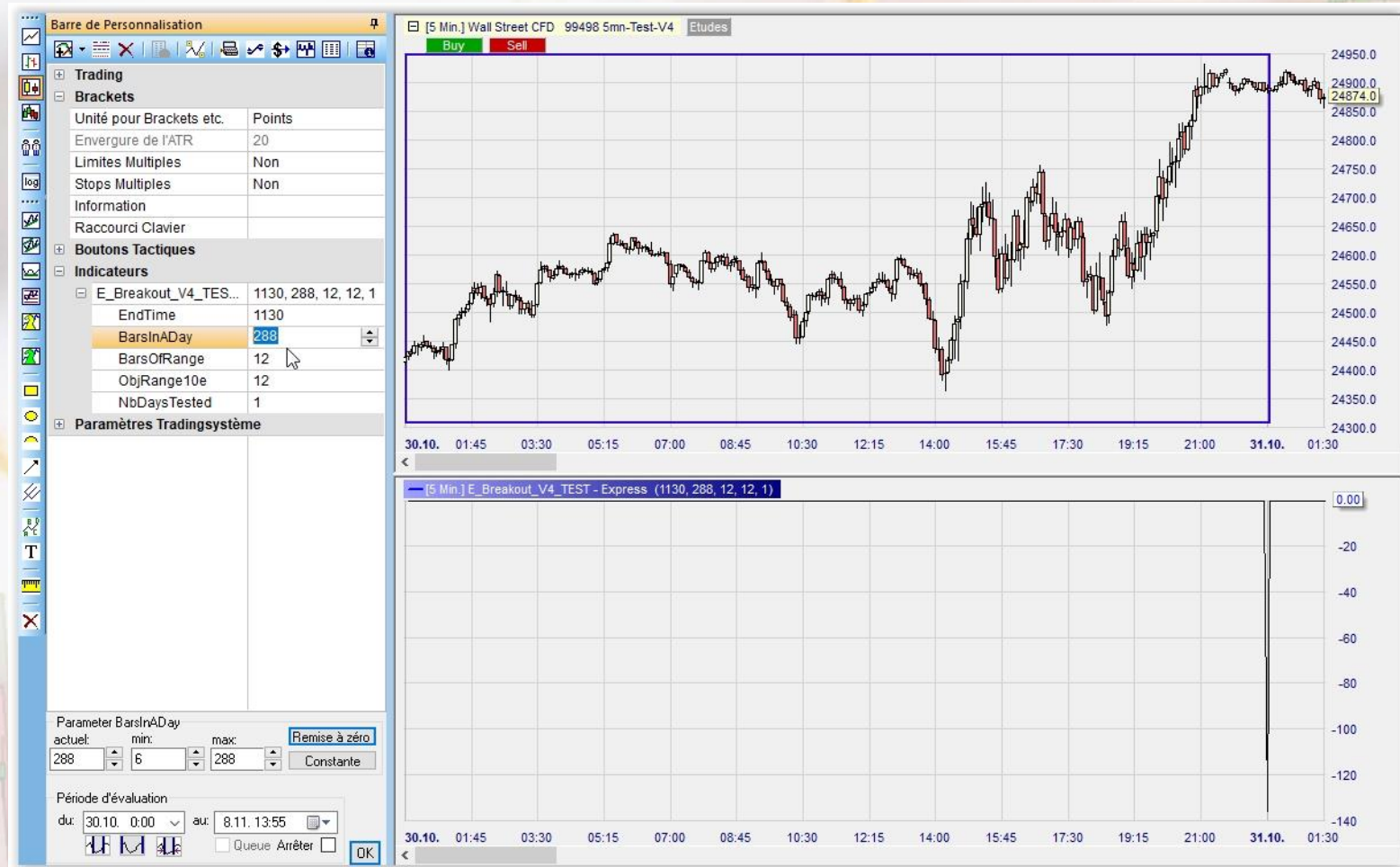
- L'indicateur E_Breakout_V4 permet de visualiser les gains et pertes obtenus pour une combinaison heure de range – distance objectif.

Les paramètres : Heure de fin de range



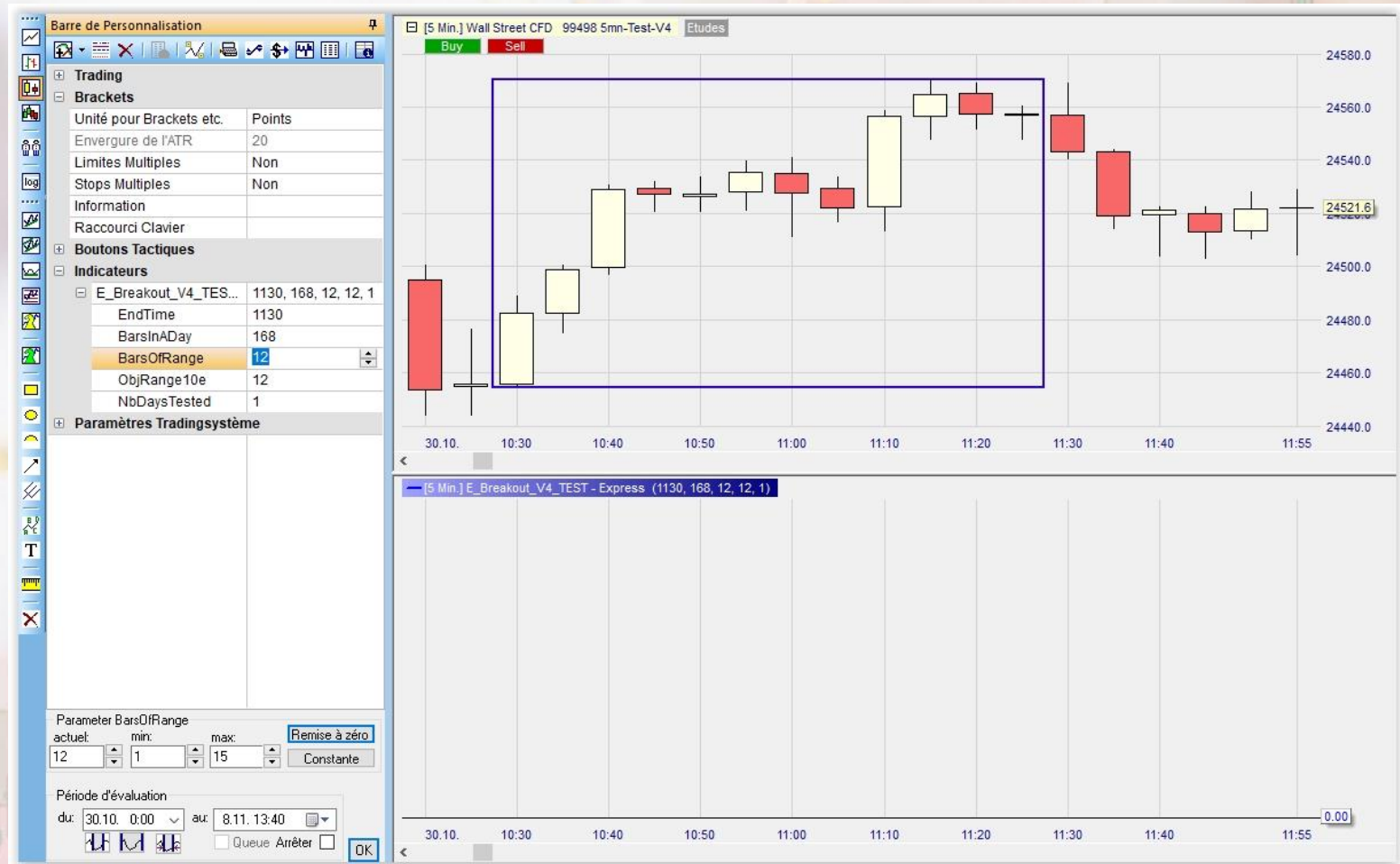
Ici l'heure de fin de range est 11h30 ce qui correspond à la fin de la bougie de 11h25.

Paramètre BarsInADay



- Ici on règle le nombre de bougies présentes dans un jour pour le support étudié.

Paramètre BarsOfRange



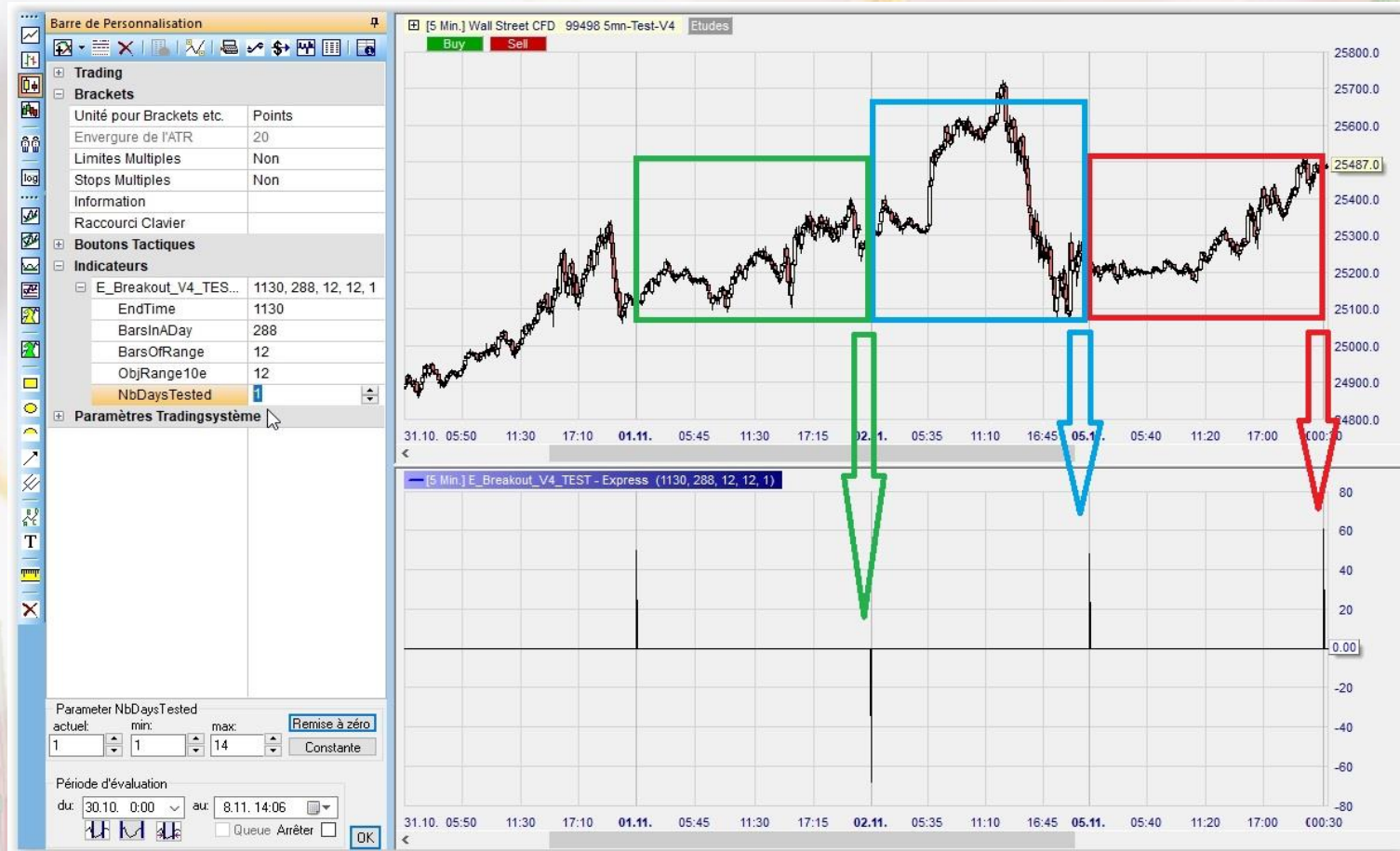
- Ici on règle la longueur du range examiné.

Paramètre ObjRange10e



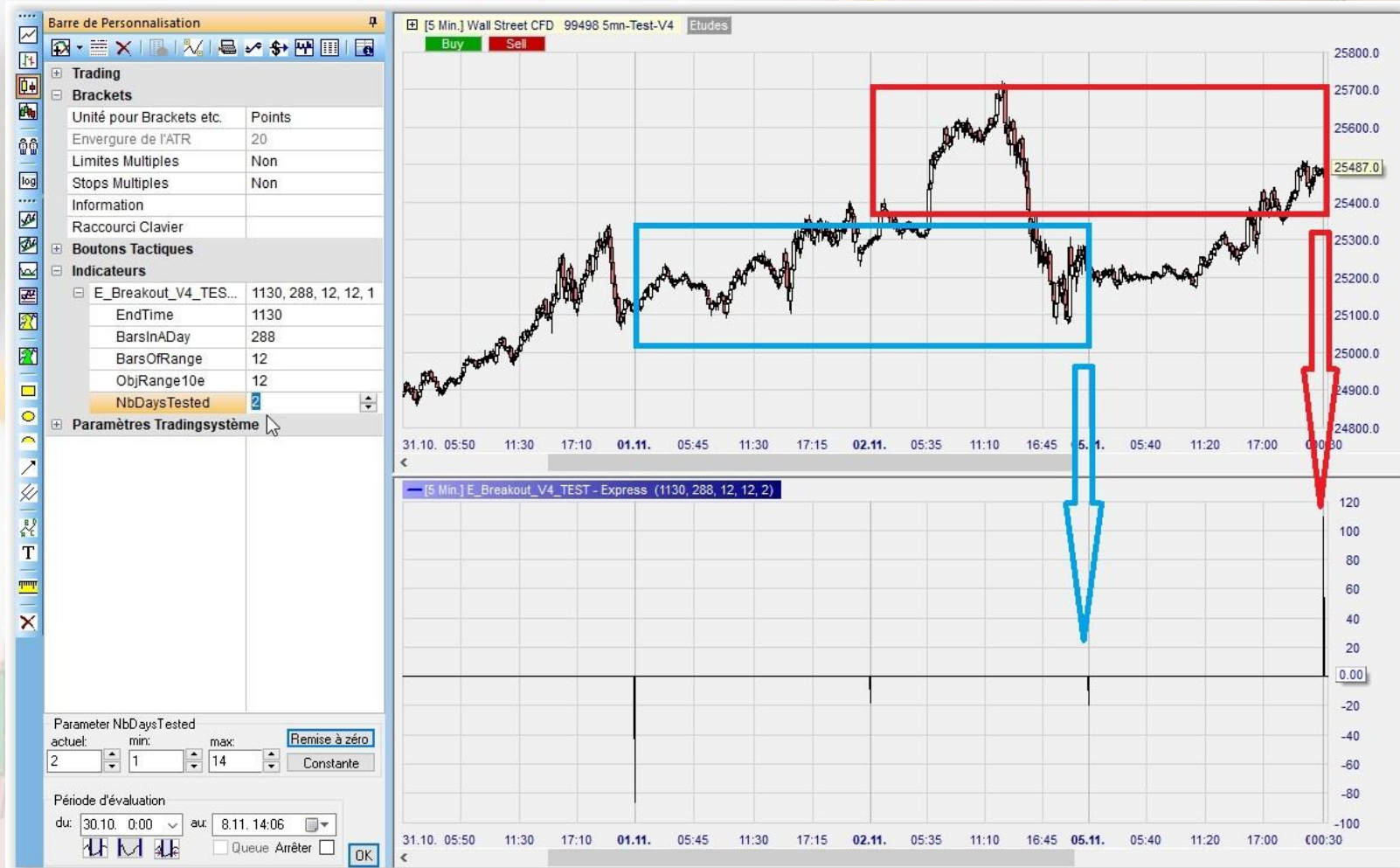
- On règle la distance de l'objectif en fonction de la hauteur du range. Ceci permet de tenir compte de la volatilité et de la direction. La mesure se fait en 10^{ème} de range: pour une valeur de **16** l'objectif sera à **1,6** range.

Paramètre NbDays



- Il s'agit du nombre de jours sur lesquels la PV est examinée: 1 pour la PV sur 1 jour ...

Paramètre NbDays



- Avec NbDayTested=2, on a la somme de la PV mesurée sur 2 jours.

Restriction quant à la prise de position

- Si la clôture est trop proche de l'objectif (50%) il est admis que l'on n'entre pas en position.
- L'entrée n'est comptabilisée que s'il reste suffisamment d'espace pour un trade conséquent.



Indicateur supplémentaire de visualisation

- Cet indicateur (à placer sur le graphe) vous permettra de visualiser le range et l'objectif que vous avez adopté et de placer alors vos ordres manuellement.



Mode d'emploi

- On peut ainsi visualiser chaque jour quelle combinaison **Heure - Distance Objectif** récente est la plus efficace.
- Vous disposez des dernières évaluations en tout début de journée ce qui permet de se mettre à jour pour les réglages à adopter.
- Il suffit ensuite d'utiliser cette combinaison pour la journée à venir.
- Ceci nécessite un peu de travail pour examiner les différentes possibilités mais cela ne pose pas de problème ... si vous vous levez tôt.

Comment interpréter les résultats



- Après avoir visualisé les différentes heures et objectifs vous avez sélectionné le range 10h30-11h30 car il présente de bons gains sur les derniers jours.
- Il ne vous reste plus qu'à préparer vos ordres quand le range se visualisera, c'est-à-dire à 11h30. Un stop loss à 50 points (par exemple) vous permettra de limiter la perte éventuelle.

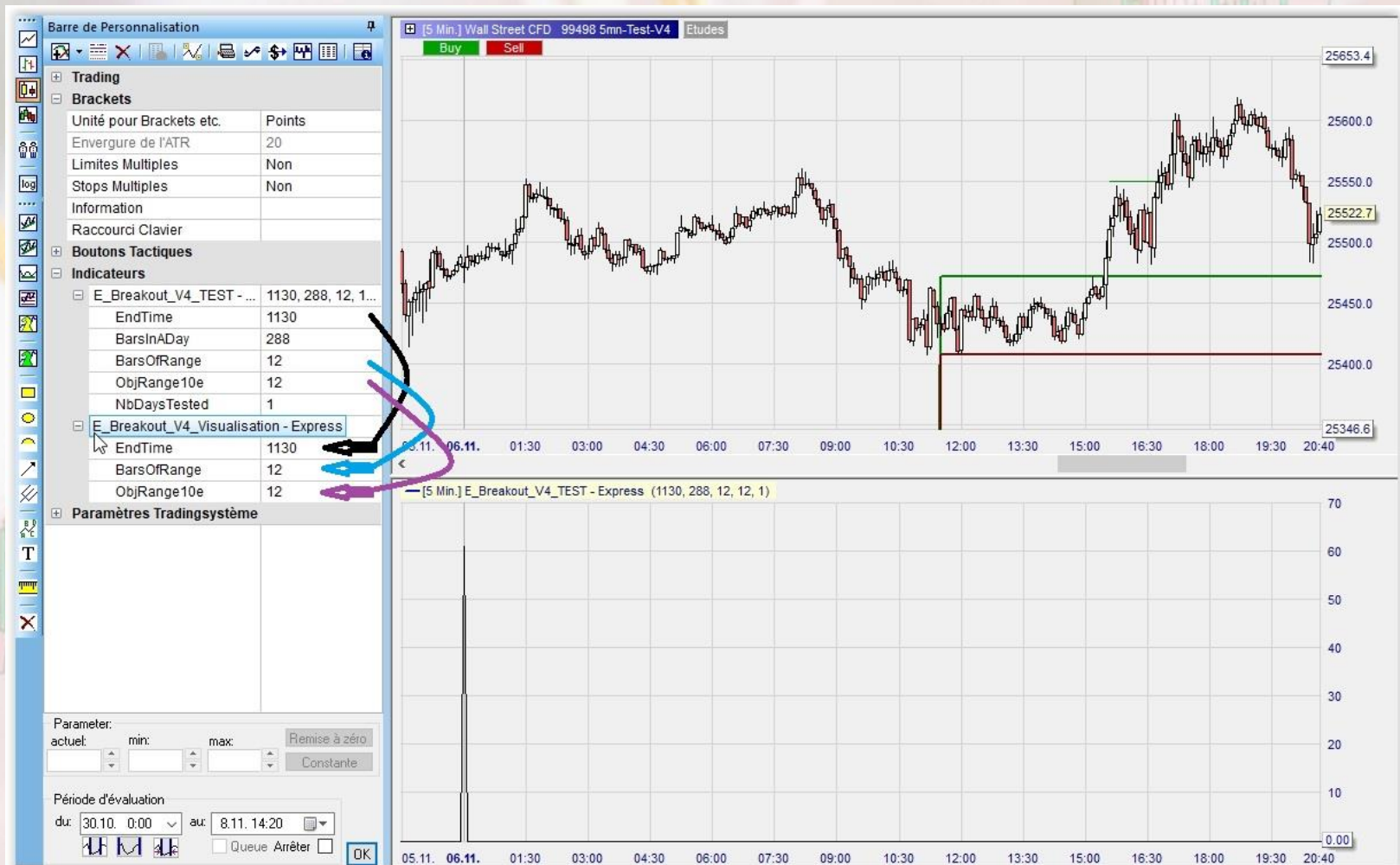
Comment effectuer le trade



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- **N'oubliez pas** de bien reporter vos choix de paramètres depuis l'indicateur de TEST vers l'indicateur de VISUALISATION.



Mise en AUTO avec la NanoTrader FULL

Si vous avez la NanoTrader Full il vous est possible de passer vos ordres en automatique :

- Utiliser l'indicateur
E_Breakout_V4_AUTO_Visualisation à la place de
E_Breakout_V4_Visualisation
- Ajoutez le Metasentimentor.
- Mettez le poids de V4_TEST à ZERO.
- Passez en OrdreAuto.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- Les ordres d'entrée, d'objectif et de stop seront exécutés automatiquement.



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- Vous pourrez également visualiser l'historique de gain de votre choix de range et objectif :



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- N'oubliez pas pour vos tests de prévoir éventuellement un filtre FLAT pour sortir de position à une heure donnée au plus tard.



L'indicateur de trading automatique

Quelques chiffres ...

Ecrire un programme qui sélectionne automatiquement le meilleur range et le meilleur objectif.

- **13**

C'est le nombre de mots de cette phrase décrivant le programme à faire.

- **3705**

C'est le nombre de lignes écrites pour que le programme effectue cette tâche en automatique.

Conséquences

- L'exécution du programme demande beaucoup de temps de calcul.
- Quand on utilise ce programme en trading réel il faut charger un petit nombre de jours.
Par exemple, si vous demandez au programme d'examiner les gains sur 3 jours et de les comparer pour sélectionner le meilleur range et le meilleur objectif, il faudra demander à la Nano de ne charger que 6 jours d'historique.
- Si vous faites des tests sur un historique important il vous faudra être patient avant que les résultats s'affichent.
Par exemple, environ **1 minute d'attente** pour 8 mois d'historique en barres de 5mn, chaque **changement de paramètre** demandant également 1 minute d'attente.

L'indicateur EL AutoAdaptBreakout



Les paramètres à régler en fonction du support



- **Bars In A Day** : nombre de barres dans une journée. Par exemple, avec un support cotant de 8h à 22h il y a 168 barres en unité de temps 5mn.

Les paramètres à régler en fonction du support



- **Bars Of Range:** c'est la longueur (en nombre de barres) du (ou des) range que l'on veut examiner. Par exemple, sur un graphe en 5mn, si l'on veut que le range dure une heure il faut régler ce paramètre sur 12 : 12 barres de 5mn font une heure.

Les paramètres de réglage



- **Nb Days Tested** : C'est le nombre de jours que le programme va examiner pour déterminer la performance d'un range avec un objectif.
Par exemple, pour une valeur de 3 le programme va calculer le gain sur 3 jours de chaque range avec des objectifs variant de 0,8 range à 1,8 range. Les meilleurs résultats sont en général obtenus avec 2 ou 3.

Les ranges examinés



- Vous pouvez demander au programme de choisir automatiquement le meilleur parmi **1 à 4 ranges**. C'est l'heure de fin de range qui est notifiée. Ici par exemple le programme comparera chaque jour 3 ranges avec tous les objectifs possibles et sélectionnera chaque jour le meilleur.

Heure limite et sortie



- Hour To Exit : Heure limite du trade. Dès que cette heure est atteinte l'indicateur envoie un signal de sortie à la Nano.

Comment mettre au point le trading automatique

- Examiner une par une ce que donnent les différents horaires de range (l'indicateur sélectionne seul la distance de l'objectif avec variation possible chaque jour).
- Noter les meilleurs (rentabilité ET régularité des phases de gain et de perte).
- Les combiner pour vérifier leur compatibilité.
- Ajouter éventuellement un filtre de tendance. (?)
- Eventuellement ajouter et ajuster des stop loss.

Il ne reste plus alors qu'à mettre en production en automatique.

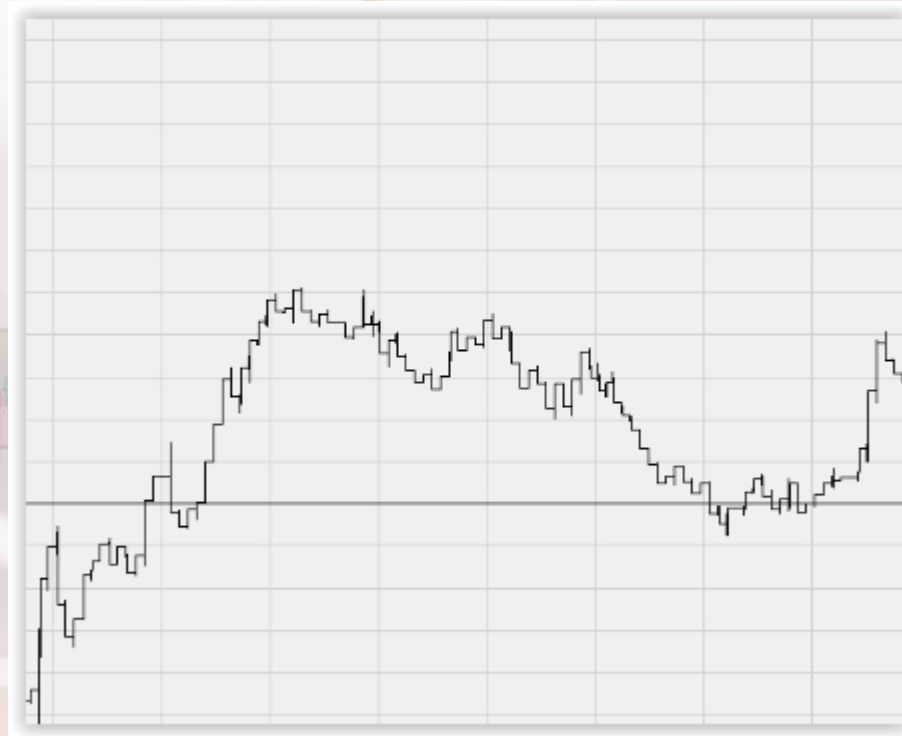
Un exemple vaut mieux qu'un long discours

Première phase : examen des horaires

Tous les horaires sont à 0, sauf celui qui est étudié. On les étudiera 1 par 1. Ici, le gain pour le range 8h-9h n'est pas intéressant.



Que cherchons-nous?



Nous cherchons des tranches horaires dans lesquels nous avons sur la **courbes de gain** :

- Des zones de gain régulières. Le range horaire sera alors sélectionné par l'indicateur avec de bonnes chances de continuation de gain.
- Des zones de pertes régulières. Le range horaire ne sera alors pas sélectionné par l'indicateur qui choisira une autre tranche horaire.
- Peu de zones irrégulières, ce qui évitera que l'indicateur soit trompé et sélectionne cette tranche horaire alors que les chances de gain pour les jours suivants sont trop faibles.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



Le range 8h30-9h30 ne présente pas de zones de gain intéressantes.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



Le range 9h-10h ne présente pas de zones de gain intéressantes.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



Le range 9h30-10h30 présente une zone de gain intéressante mais est très irrégulier ailleurs.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



Le range 10h-11h est assez régulier dans le gain. Les zones de perte sont peu nombreuses et assez régulières également. A retenir.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



Le range 10h30-11h30 est plutôt régulier dans la perte comme dans la hausse (zones bien délimitées). La zone de gain peut être très rapide et efficace. A retenir éventuellement.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



Le range 11h-12h présente des zones de gain et de pertes bien délimitée. Les zones de gain sont plus nombreuses. A retenir.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



Le range 11h30-12h30 est assez régulier mais seulement sur la période ancienne. Il ne présente que peu de zones de hausse.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



Le range 12h-13h est assez régulier avec quelques bonnes périodes de hausse. A retenir éventuellement.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



Le range 12h30-13h30 est très régulier et présente d'excellentes périodes de hausse. A retenir presque impérativement.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



Le range 13h-14h est très irrégulier.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



Le range 13h30-14h30 ne présente presque pas de zones de gain.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



Le range 14h-15h ne présente presque pas de zones de gain.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



Le range 14h30-15h30 ne présente presque pas de zones de gain.

Mogalef Trading

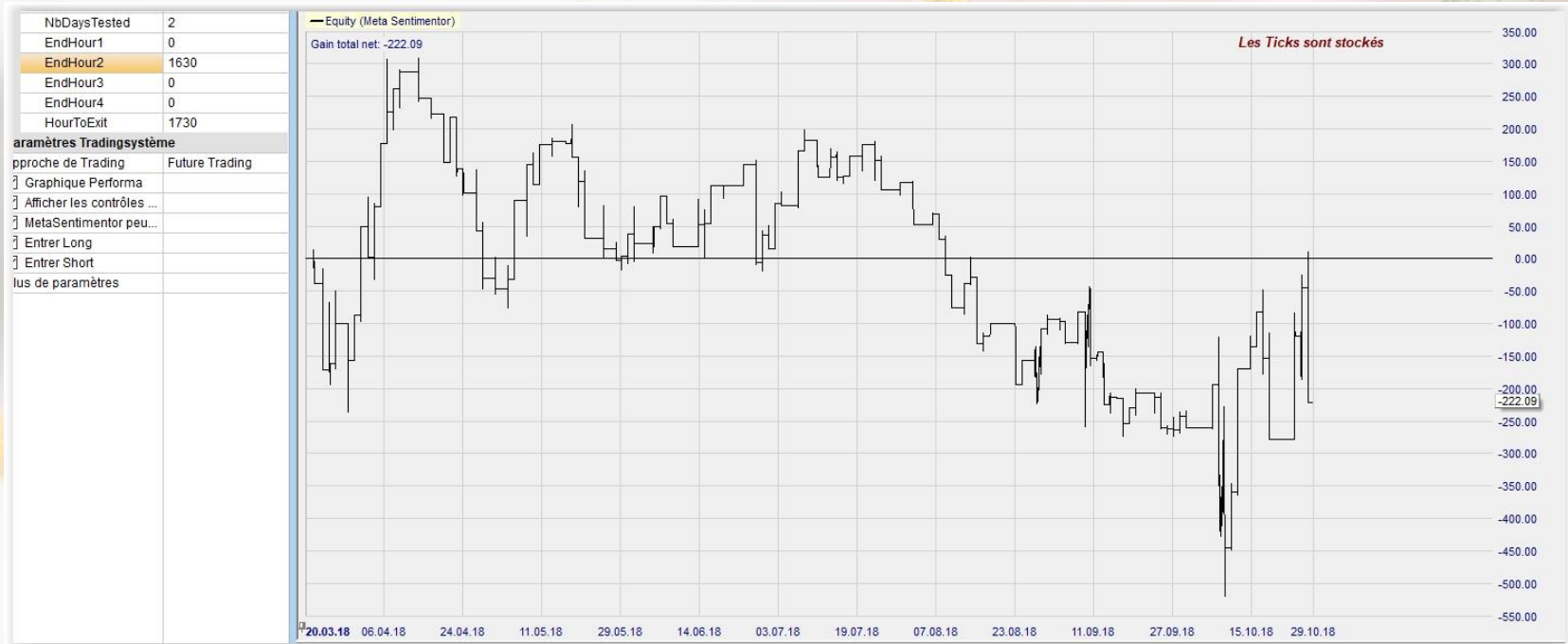
"There's no certitude, only opportunities" V



Le range 15h-16h présente de bonnes séries de gain assez bien délimitées. A retenir.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



Le range 15h30-16h30 ne présente presque pas de zones de gain.
Comme nous sortons à 17h30 il est inutile d'aller plus loin.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

On commence maintenant l'étape suivante : l'assemblage des ranges intéressants.

Dans le but d'écouter cette présentation, toutes les possibilités ne seront pas examinées. Seule la démarche est expliquée.



On assemble ici deux zones de range : 10h-11h et 10h30-11h30.
L'indicateur choisit entre les deux. Le résultat sur la courbe de gain n'est pas extraordinaire.

On ajoute la tranche horaire 12h30-13h30.



La courbe de gain devient beaucoup plus régulière et très bien orientée.
L'indicateur sélectionne bien les tranches horaires, passant de l'une à l'autre avec un résultat rémunérateur.

On ajoute la tranche horaire 15h-16h.



La courbe de gain se dégrade : il vaut mieux rester avec seulement 3 tranches horaire de range et ne pas inclure le range 15h-16h.
La tranche 15h-16h n'est pas compatible avec les 3 tranches horaires du matin.

Améliorations possibles :

- Ajouter un filtre de tendance, une moyenne mobile par exemple.



Barre de Personnalisation

Ajouter des Sentimentors

Tapez pour rechercher

Indicateurs

- ADX
- Aroon
- ATR
- Bollinger Bands
- Candle Stick
- CCI
- Channel Breakout
- Crossing MA
- Directional Ind. (+/-DI)
- DSS
- Exp. Moving Average
- Dyn.Momentum Idx
- Heikin Ashi
- High-Low Channel
- Kaufmann's AMA
- Key Price Levels
- Linear Regression
- Local Highs & Lows
- MACD
- MACD-Histogram
- Meta Sentimentor
- Momentum
- Moving Average**
- OrderBook
- On-Balance-Volume
- Parabolic SAR
- PFE
- Pivot Points
- Point & Figure
- Reentry Filter
- Renko
- RSI
- RSI-smoothed
- Slow Stochastic
- Stochastic
- SuperTrend
- Support/Resistance
- Study
- Time Price Opportunities
- TwinChart
- Volume

Indicateurs

Trading	76, 24, 40, 60
Meta Sentimentor	1, 1
E_Breakout_A_A - Ex...	276, 12, 2, 1100, 1...
BarsInADay	276
BarsOfRange	12
NbDaysTested	2
EndHour1	1100
EndHour2	1130
EndHour3	1330
EndHour4	0
HourToExit	1730

Paramètres Tradingsystème

Approche de Trading	Future Trading
<input checked="" type="checkbox"/> Graphique Performa	
<input checked="" type="checkbox"/> Afficher les contrôles ...	
<input checked="" type="checkbox"/> MetaSentimentor peu...	
<input checked="" type="checkbox"/> Entrer Long	
<input checked="" type="checkbox"/> Entrer Short	
Plus de paramètres	

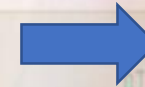
Insérer comme: Sentimentor **Filtre** Stop Tactic Fermer

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

L'amélioration est légère : le filtre élimine seulement deux trades perdants.

Avant



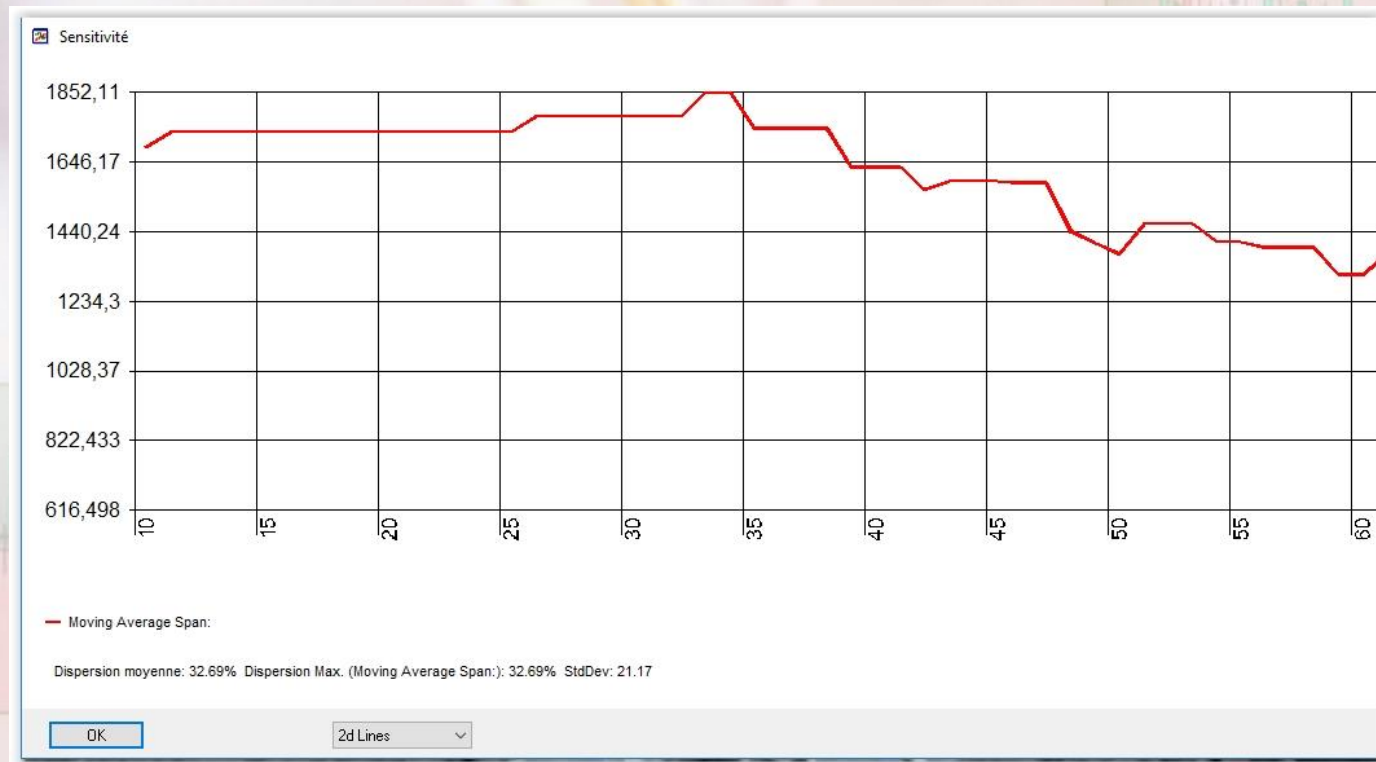
Après



Élément	Période d'Opti...
Profit total net:	1691.11
Nb total de trades:	157
Nb de trades gagnants:	96
Nb de trades perdants:	61
Trades gagnants (en %):	61.15%
Facteur bénéfique:	1.56
Gain moyen / perte mo...	0.99
Trade moyen (gain & p...	10.77
Temps passé dans le m...	8.95%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0076
Gain brut:	4686.00
Perte brute:	2994.90
Plus grand trade gagna	226.50
Trade gagnant moyen:	48.81
Nb barres moyen par g...	24.52
Plus grand trade perda	139.60
Trade perdant moyen:	49.10
Nb barres moyen par p...	24.56
Nb de gagnants consé...	8
Nb de perdants consé...	4
Ecart type de tous les tr...	59.01
Ecart type de trades ga...	39.10
Ecart type de trades per...	25.96
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	324.00
Commissions payées:	0.00
Espérance:	0.2194
Score de l'espérance:	0.0008
Facteur chance:	3.83
Performance / Perte cu...	5.22
Expectative:	10.77
Début de l'évaluation:	20.03.18 Tue 00
Fin de l'évaluation:	29.10.18 Mon 1...



Voyons, grâce à la fonction « sensibilité du paramètre » de la Nano, si une valeur de la moyenne mobile autre que 30 peut améliorer le résultat :

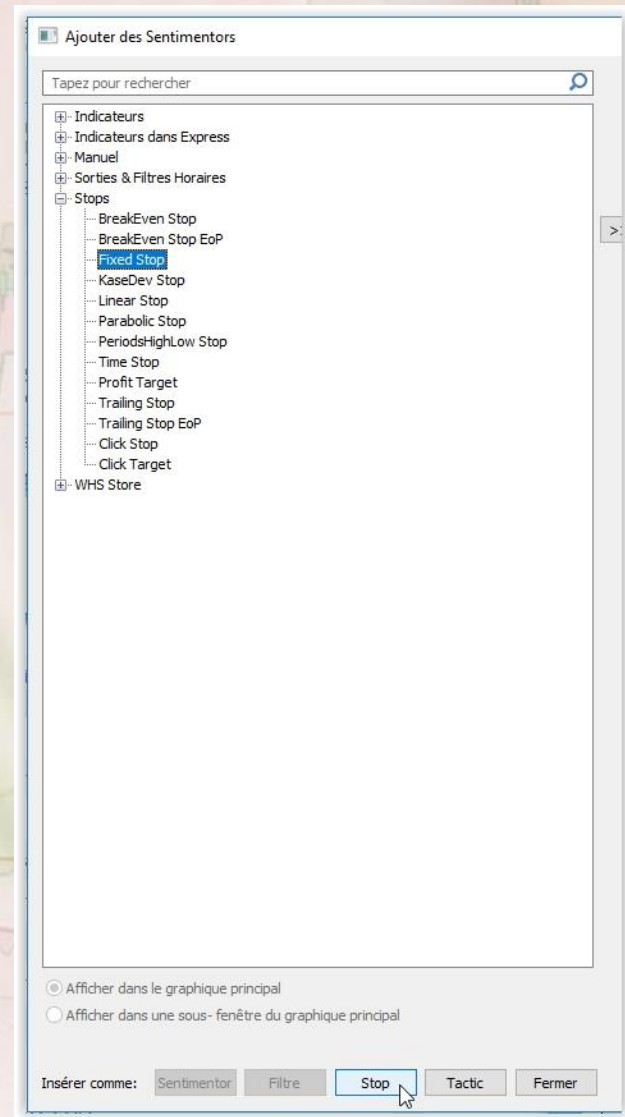


Non : la MM30 est presque la meilleure et aucune amélioration sensible ne se détache.

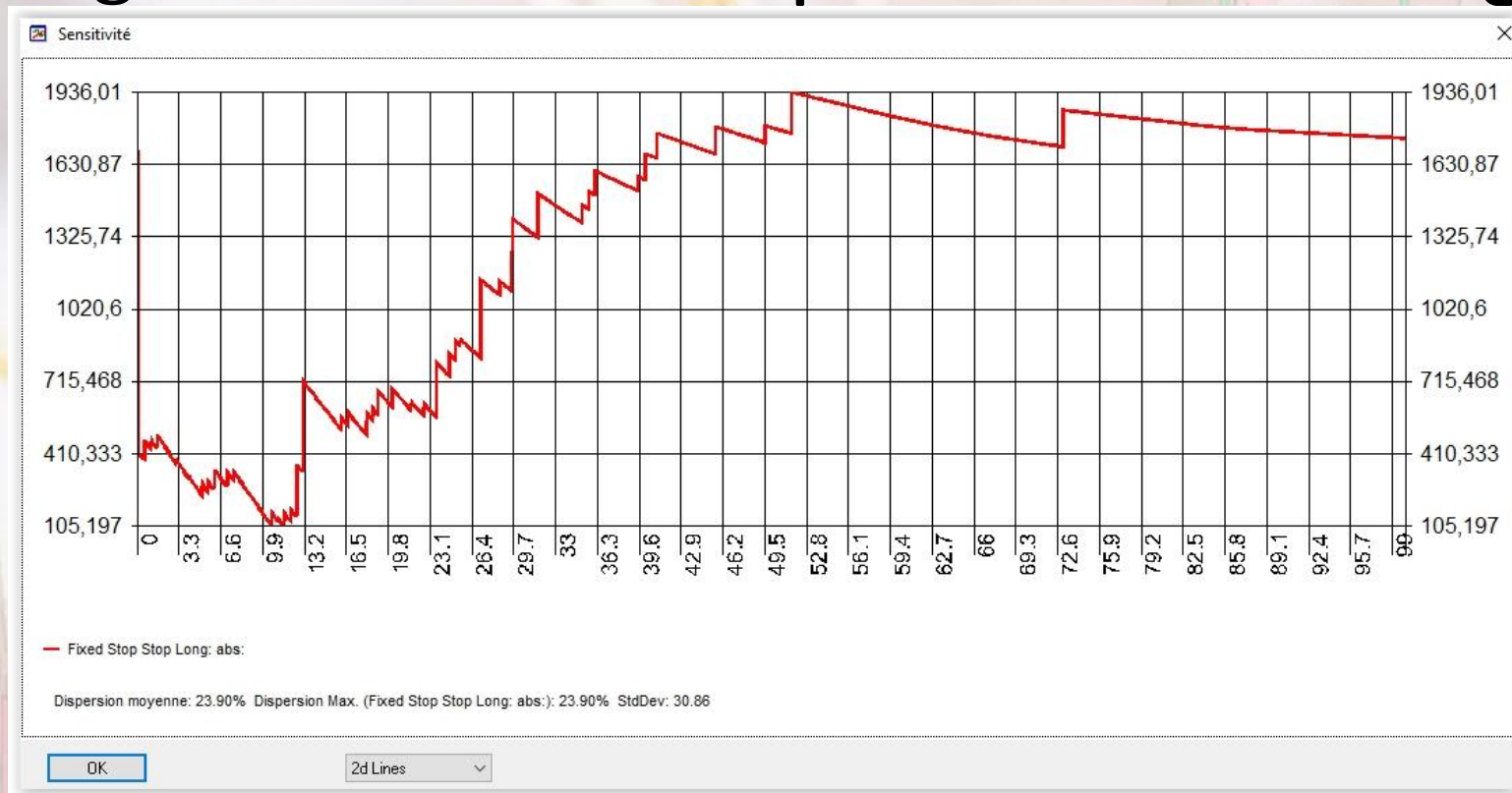
Améliorations possibles :

- Ajouter des stops fixes.

Ceci présentera aussi l'avantage de limiter nos trades perdants à un niveau connu.

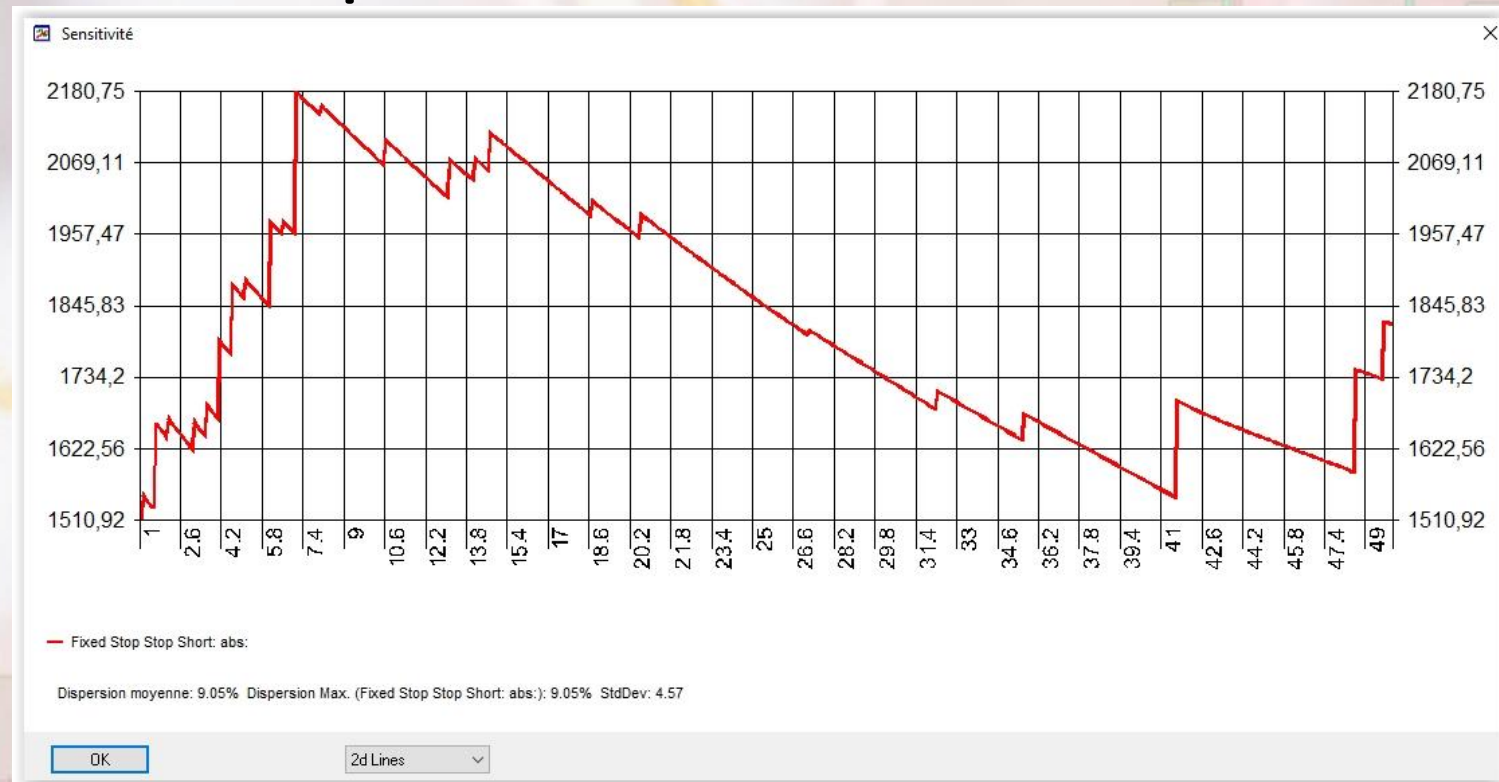


Examinons l'effet de la distance du stop-loss sur notre gain. Tout d'abord pour les trades longs



- On voit qu'augmenter la distance du stop améliore le gain, mais qu'au dessus de 50 points l'amélioration est négligeable. On essaiera donc de mettre le stop long à 50.

Effets de la distance au stop-loss pour les trades courts.



- On voit qu'augmenter la distance du stop jusqu'à 8 points favorise le gain, mais qu'au-delà de 17 points cela diminue le gain. On adoptera par exemple 15 points.

Résultat avec stop-loss



L'indicateur gère bien l'alternance entre les 3 plages horaires.

La courbe des gains est particulièrement propre et efficace, sachant que l'indicateur choisit chaque jour entre 18 combinaisons possibles.

On peut essayer de mettre en production en réel et en automatique, **en ne chargeant que 6 jours d'historique** pour diminuer le nombre de calculs.

Savoir quel va-t-être le trade du jour

- Tous les matins, au premier tick de la journée, l'indicateur vous affiche un message vous informant de l'heure et de la distance de l'objectif sélectionnées.



En résumé, les étapes de la mise au point

- Examen des heures de range et sélection des meilleures.
- Assemblage des ranges les plus intéressants
- Mise au point des stops

Puis mise en automatique :
reste juste à surveiller.

**Ces opérations sont à refaire
tous les 2 à 3 mois.**



Les indicateurs à votre disposition

Si avez la NanoTrader light

- E_Breakout_V4_TEST (limité au 31/12/2020)
pour tester les gains de chaque couple Range – Objectif.
- E_Breakout_V4_Visualisation (limité au 31/12/2020)
pour visualiser les niveaux et placer vos ordres.

Si vous avez la NanoTrader Full

- E_Breakout_V4_TEST
pour tester les gains de chaque couple Range – Objectif.
- E_Breakout_V4_AUTO_Visualisation (limité au 31/3/2019)
pour visualiser les niveaux, placer vos ordres, visualiser les courbes de gain et éventuellement passer en automatique.
- EL_AutoAdaptBreakout (+ stop et target) (limité au 31/12/2018)
+ EL_AABreakoutStop + EL_AABreakoutTarget
pour passer en automatique complet, sélection du range du jour et de son objectif compris.

Où télécharger les indicateurs ?

Le mot de passe est :
Procyon

N'oubliez pas la majuscule !

All charts are from WHSelfinvest NanoTrader

Mogalef Trading

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

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

Conferences WHSelfinvest 2018
Conferences WHSelfinvest 2017
Conférence Salon du Trading 2017
Conferences WHSelfinvest 2016
Conférence Salon AT 2016
Conferences WHSelfinvest 2015
Conferences SALON AT 2015
Conferences SALON DU TRADING 2014
Stage formation 2017

CONFERENCES WHS 2018 Paris - France

de trading automatique sur le DOW JONES

... a été annulée. Les adhérents Mogalef peuvent cependant profiter du ...
... sur les adhérents au club Mogalef :
Téléchargement du fichier modèle à placer dans le répertoire DefaultDys.
Appliquer le modèle EL-Dow-03-Actuel2018 au CFD Wall Street.
Usage illimité.

Download - Télécharger le Modèle de Trading DOW

 Cassure_haussière.pdf

Comprendre et maîtriser la CASSURE HAUSSIÈRE (Bullish Breakout)

PDF de la conférence du 07 mars 2018

Accès au PPT de la conférence

Le signal de Divergence MACD (MACD DIV)

PPT de la conférence du 11 avril 2018 **réservé aux présents** pendant 3 mois.
En raison des personnes bloquant l'accès à la conférence en s'inscrivant mais en ne venant pas assister, le PDF est désormais réservé aux seuls présents réels.

Accès au PPT de la conférence

Les Bandes MOGALEF

Utilisation en trading discrétionnaire et automatique

PPT de la conférence du 5 mai 2018 **réservé aux présents** pendant 3 mois.
En raison des personnes bloquant l'accès à la conférence en s'inscrivant mais en ne venant pas assister, le PDF est désormais réservé aux seuls présents réels.

Accès au PPT de la conférence

Créez et testez vos systèmes de trading

PPT de la conférence du 6 juin 2018 **réservé aux présents** pendant 3 mois.
En raison des personnes bloquant l'accès à la conférence en s'inscrivant mais en ne venant pas assister, le PDF est désormais réservé aux seuls présents réels.

Accès au PPT de la conférence

Corriger son trading

PPT de la conférence du 5 septembre 2018 **réservé aux présents** pendant 3 mois.
En raison des personnes bloquant l'accès à la conférence en s'inscrivant mais en ne venant pas assister, le PDF est désormais réservé aux seuls présents réels.

Accès au PPT de la conférence et aux indicateurs

Système de scalping sur le DAX

PPT de la conférence du 10 octobre 2018 **réservé aux présents** pendant 3 mois.
En raison des personnes bloquant l'accès à la conférence en s'inscrivant mais en ne venant pas assister, le PDF est désormais réservé aux seuls présents réels.

Accès au PPT de la conférence

Stratégie de BREAKOUT auto-adaptative

PPT de la conférence du 10 octobre 2018 **réservé aux présents** pendant 3 mois.
En raison des personnes bloquant l'accès à la conférence en s'inscrivant mais en ne venant pas assister, le PDF est désormais réservé aux seuls présents réels et aux abonnés à la newsletter du site Mogalef-Trading pendant trois mois.

Accès au PPT de la conférence et aux indicateurs

Inscrivez-vous à notre liste de diffusion

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Quelques essais rapides sur divers supports

CAC



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

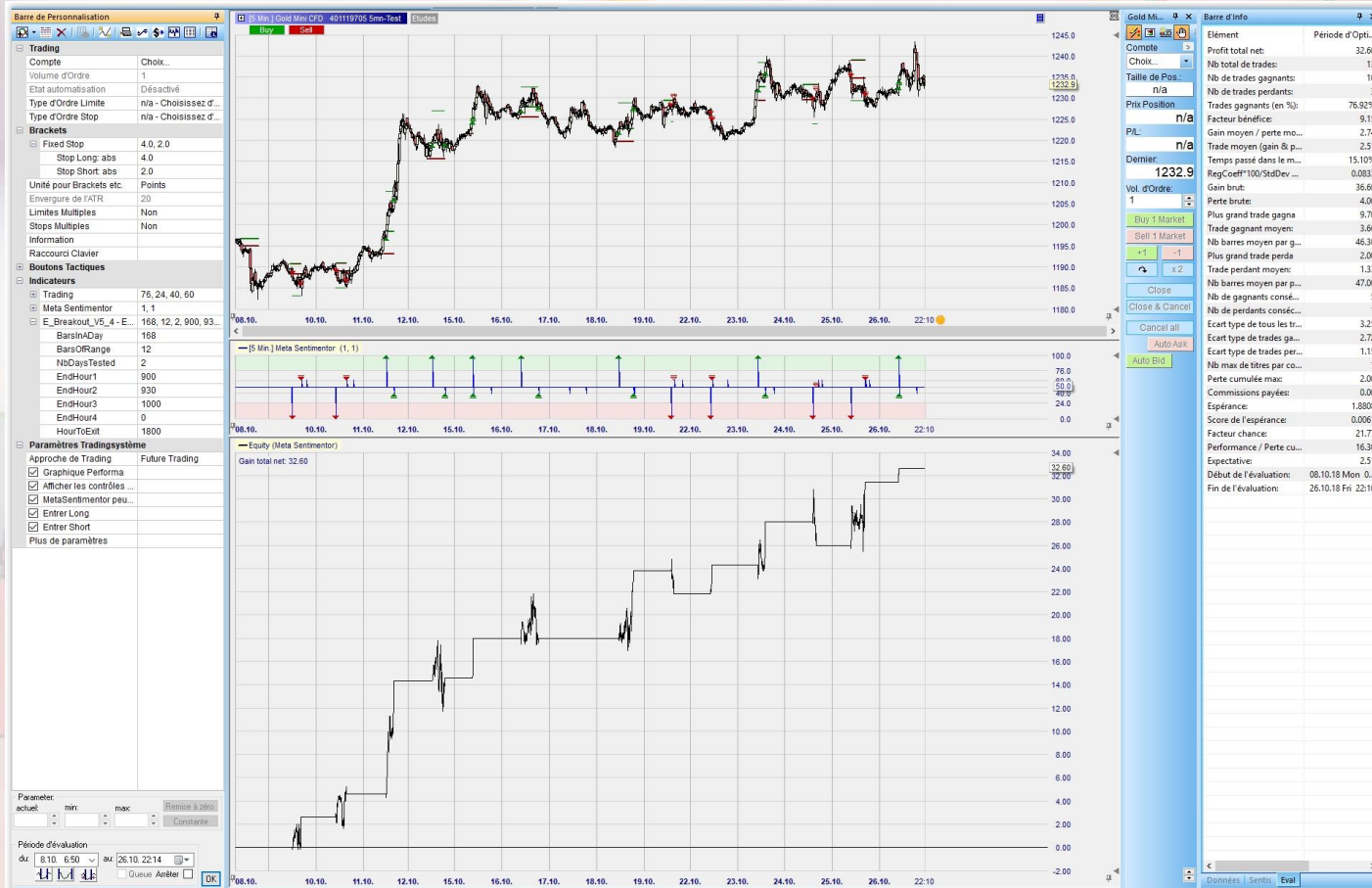
Dax



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Gold



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

UK



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Amazon



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Dow



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Apple



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Sp500

