

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

En collaboration avec



# Créez et testez vos systèmes de trading

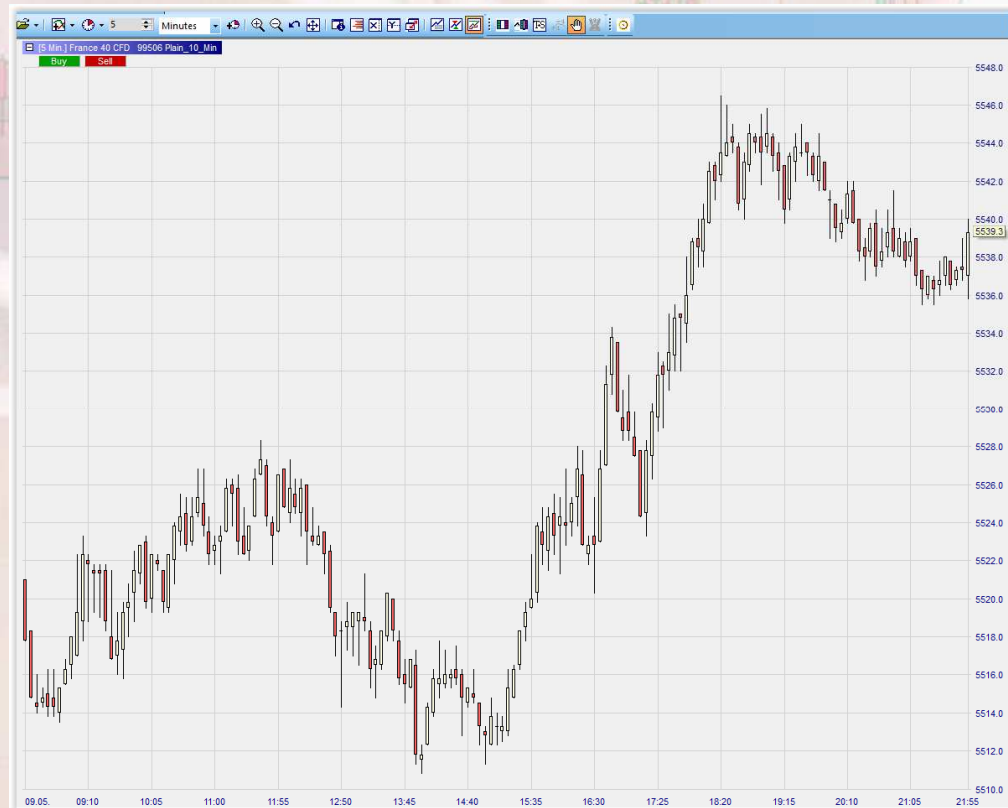
Présenté par Eric Lefort du  
groupe MOGALEF

## Partir d'une idée

- Toujours partir d'une idée de base. Aller au hasard ne conduirait qu'à la perte de temps ou à une sur optimisation désastreuse.
- Ne pas chercher à se battre avec le trading HF ou les algos de scalping. Vous n'auriez aucune chance.

## Proposition

- Travail des tendances « court terme » d'un indice (environ 2h30 – 3h) sur le 5 minutes.



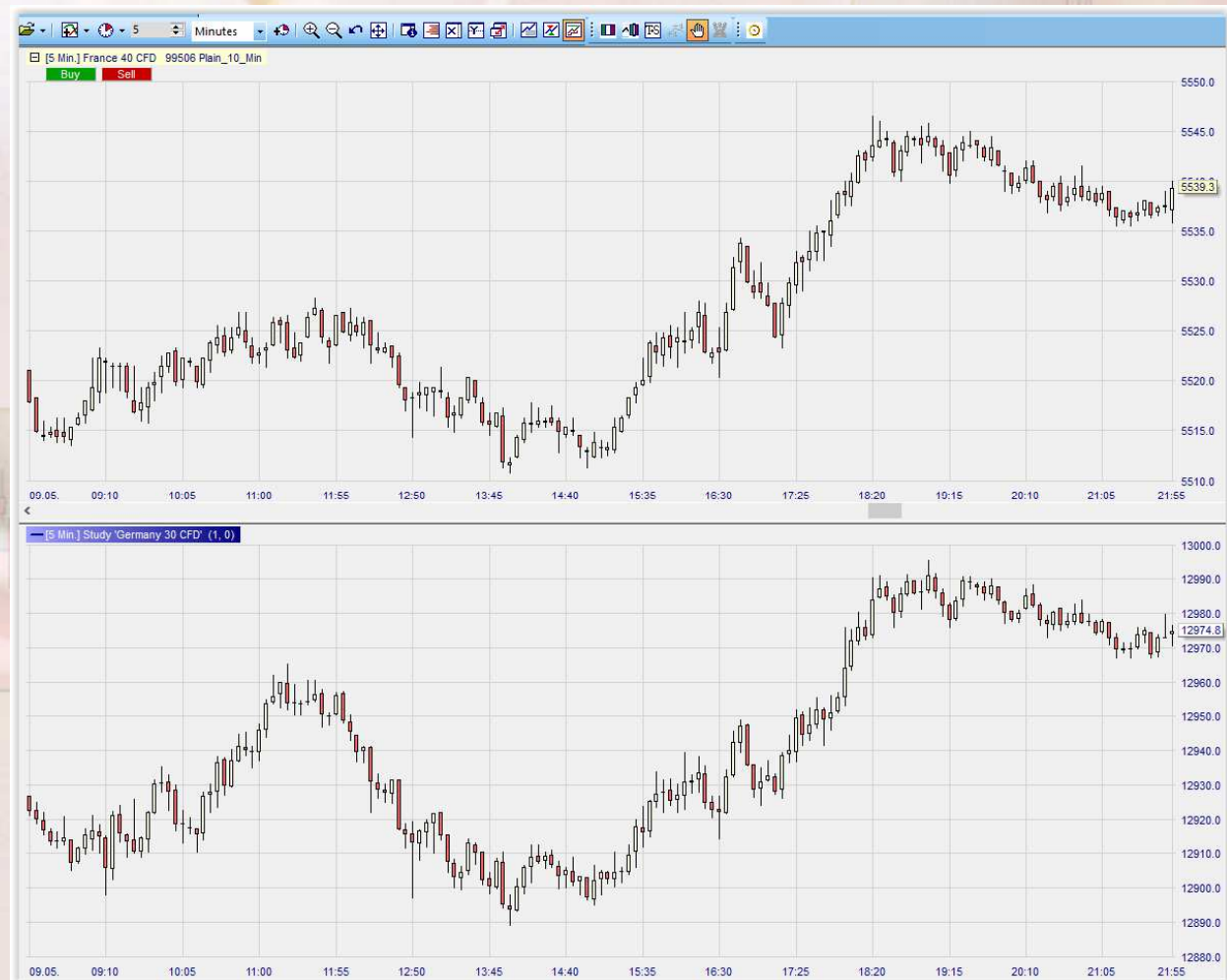
# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Sélectionner un support adapté

Spread (coût de la transaction) le moins élevé possible par rapport au mouvement envisagé.

Quantité de bruit la moins importante possible par rapport à la direction.



## Sélectionner un signal

Pour pouvoir entrer  
alors que la  
tendance se  
dessine il doit:

- Intervenir proche du début de tendance et/ou en cours de tendance.
- Donner le moins de signaux possible à l'approche des fins de tendance et en période de range.



## Ajouter un Time Stop

- Ajouter le Meta-Sentimentor
- Ajouter un Time stop va nous permettre ensuite d'estimer les potentiels du signal, sa fiabilité et la régularité de sa pertinence.



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



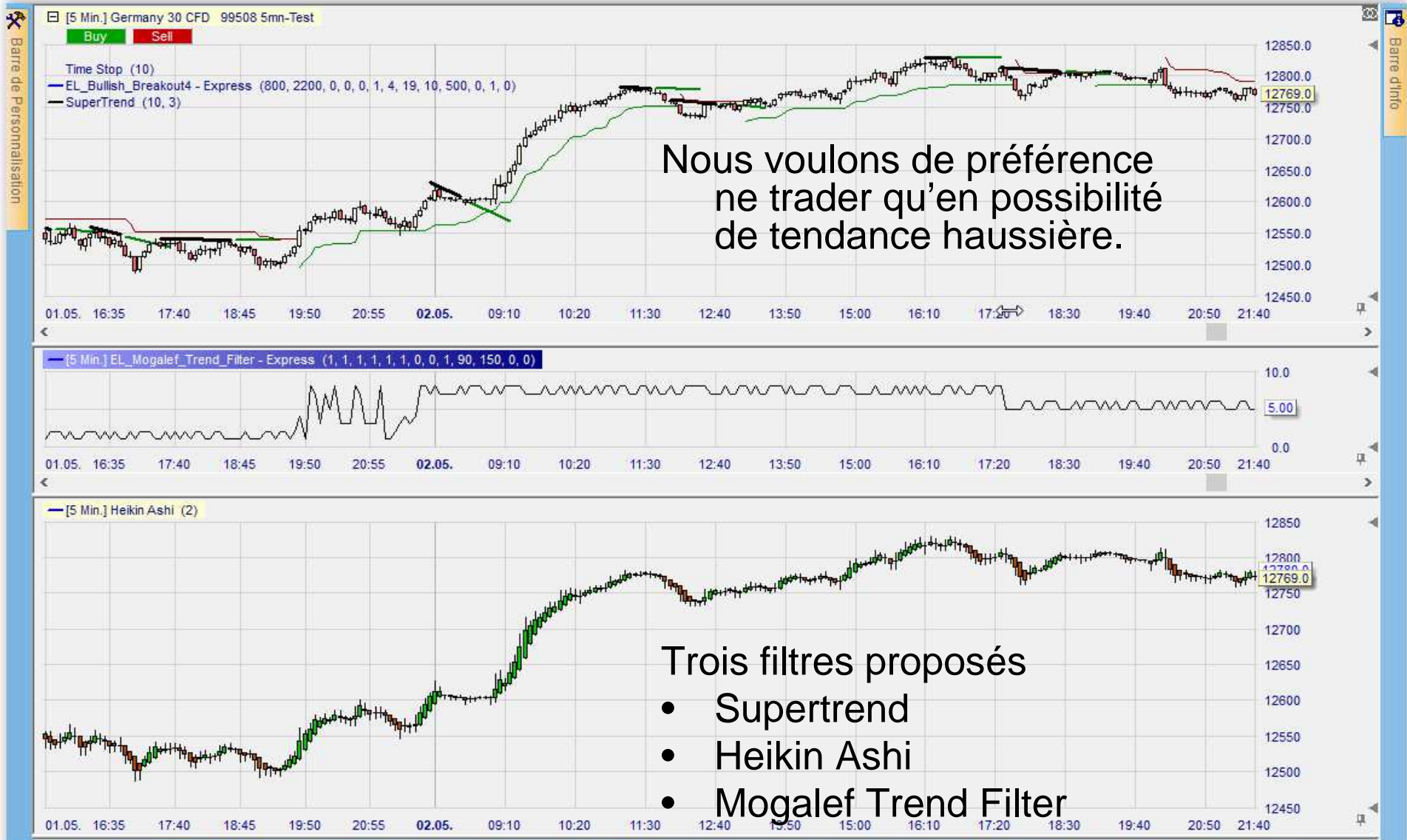
- Avec les paramètres standard le gain est très insuffisant.

## Réfléchir à la plage horaire

- Il n'est pas évident de déterminer visuellement quelle est la plage horaire la plus favorable.
- On peut en discuter.



# Rechercher les filtres adaptés



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

# Filtre Super Trend



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

# Filtre Heikin Ashi



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Filtres 1 + 2 ?



# Mogalef Trading Mogalef Trend Filter

"There's no certitude, only opportunities" V



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

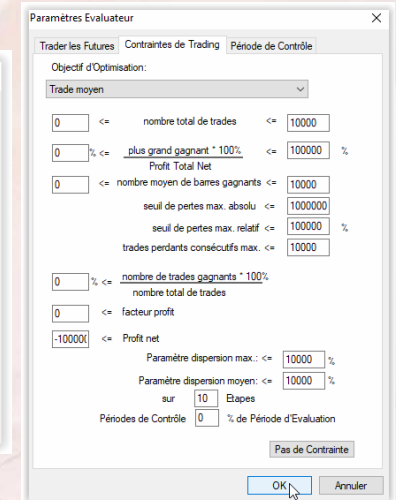
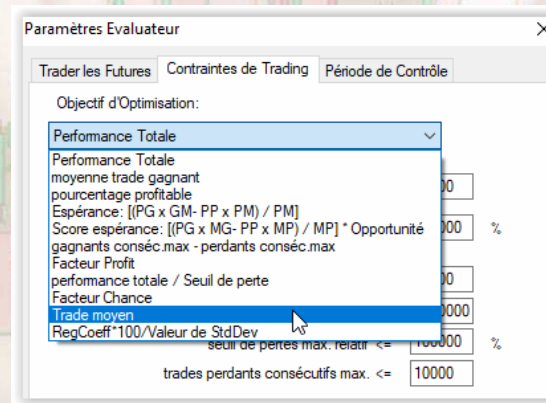
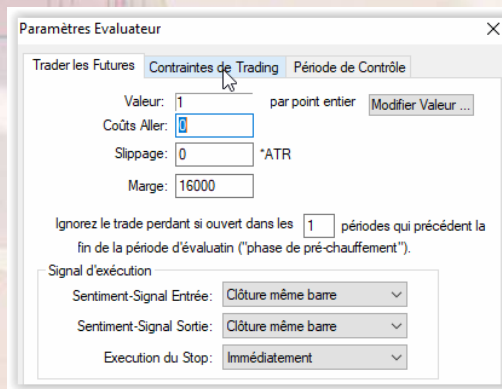
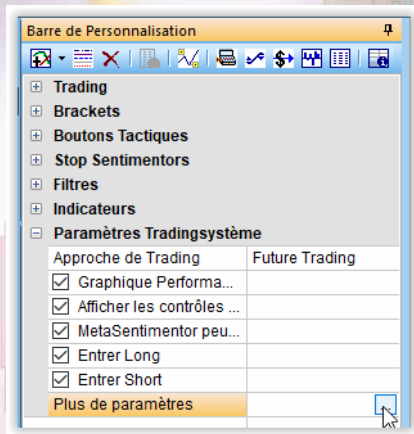
N'oubliez pas l'idée du système: travail court terme des tendances. Le filtrage des trades en fonction de la tendance est donc PRIMORDIAL ici.

A ce stade je simplifie un peu la description de la procédure.

- Il va falloir modifier le plus légèrement possible les paramètres des filtres pour les adapter au support,
- Mais aussi examiner s'ils ont des efficacités particulières sur certaines plages horaires.
- On se basera de préférence sur la valeur du trade moyen, c'est-à-dire le gain moyen obtenu par trade, gagnants et perdants confondus. La NanoTrader permet d'accéder facilement à cette donnée.

# Appliquer le critère de test Trade Moyen avec la NanoTrader

Barre de personnalisation,  
cliquez là où se trouve la flèche du curseur.

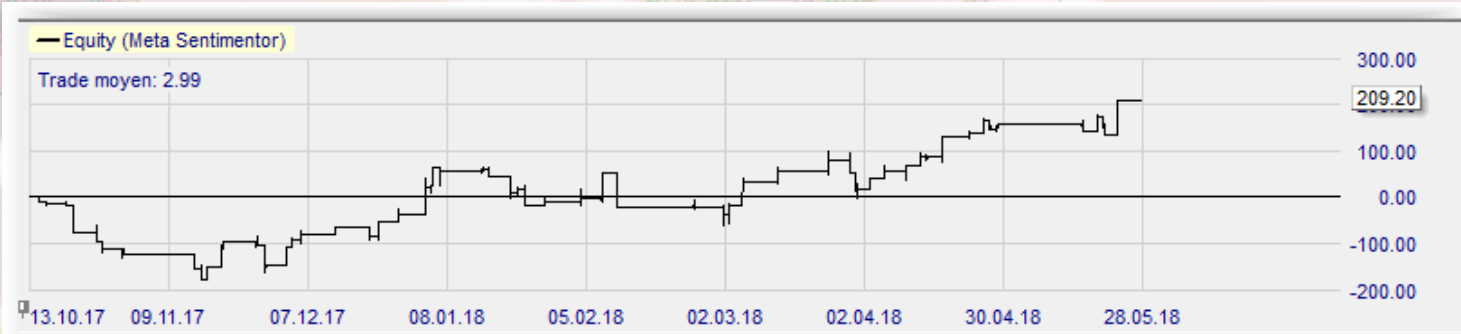


# SuperTrend + Heikin-Aschi : Trade moyen et courbe de gain suivant les plages horaires

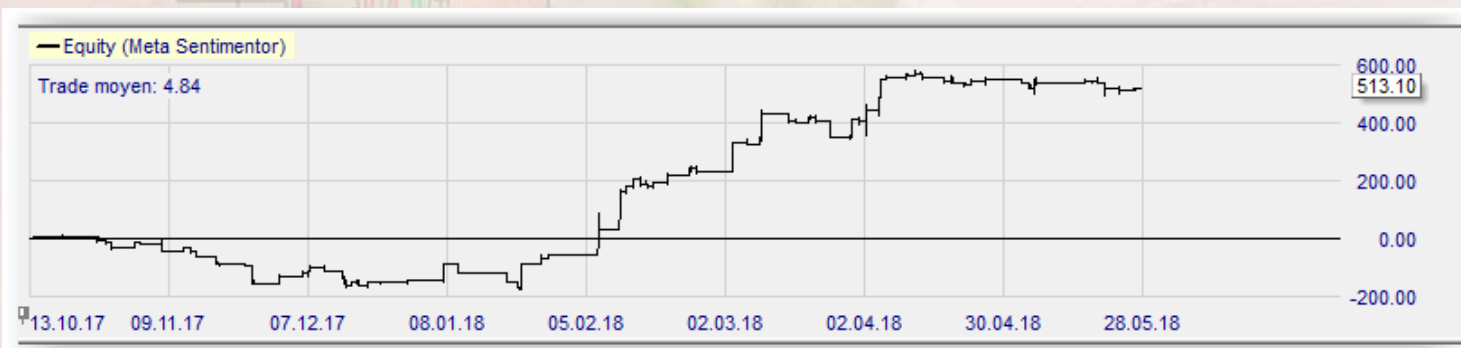
- 8h-12h



- 12h-16h



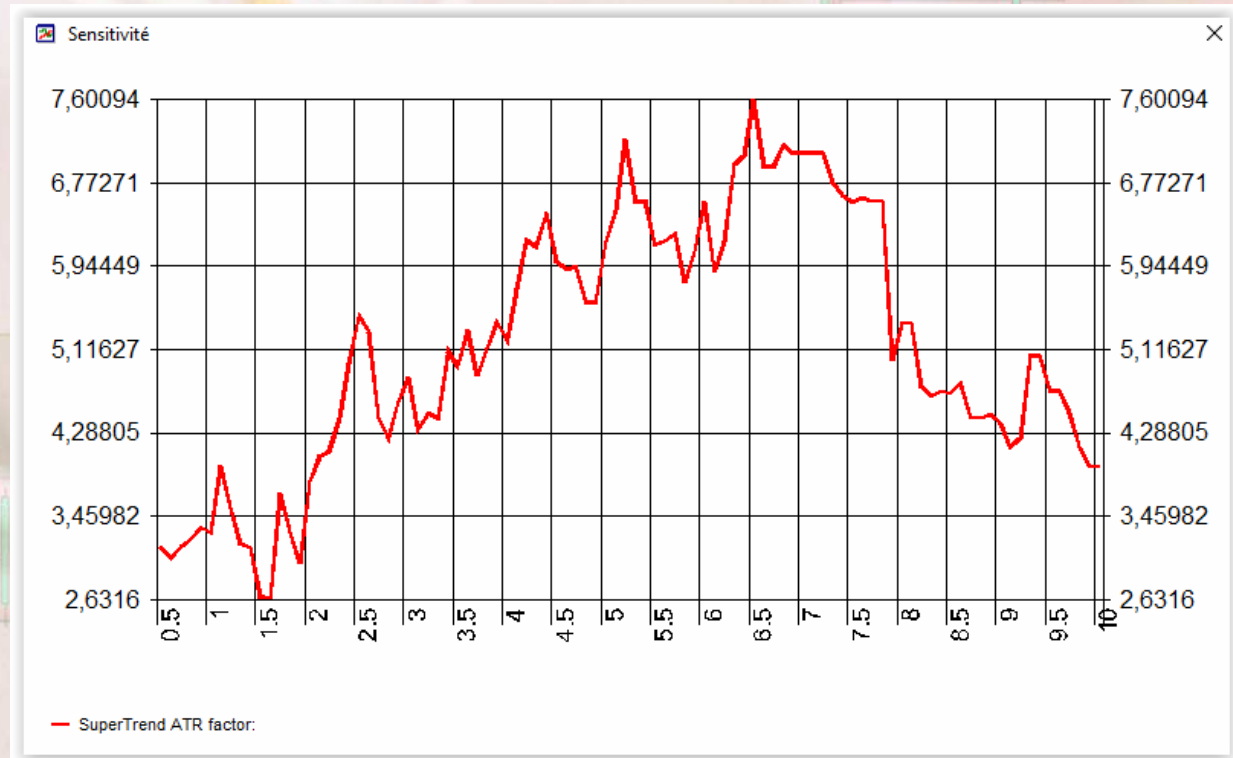
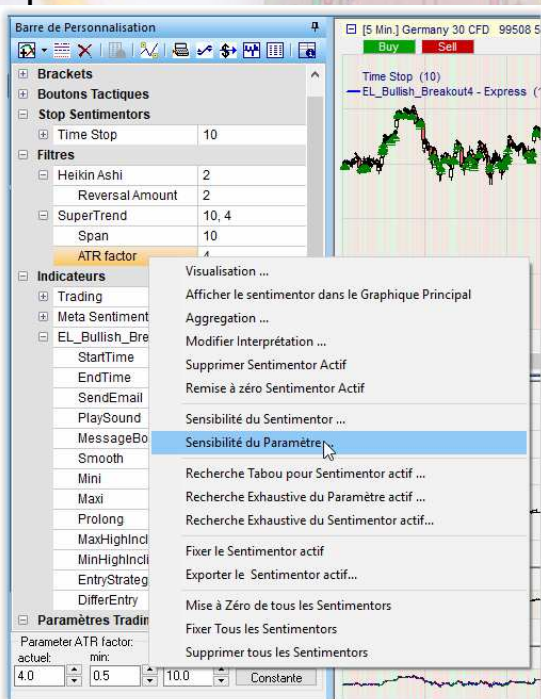
- 16h-22h



# 1<sup>er</sup> filtre: Supertrend+Heikin Ashi

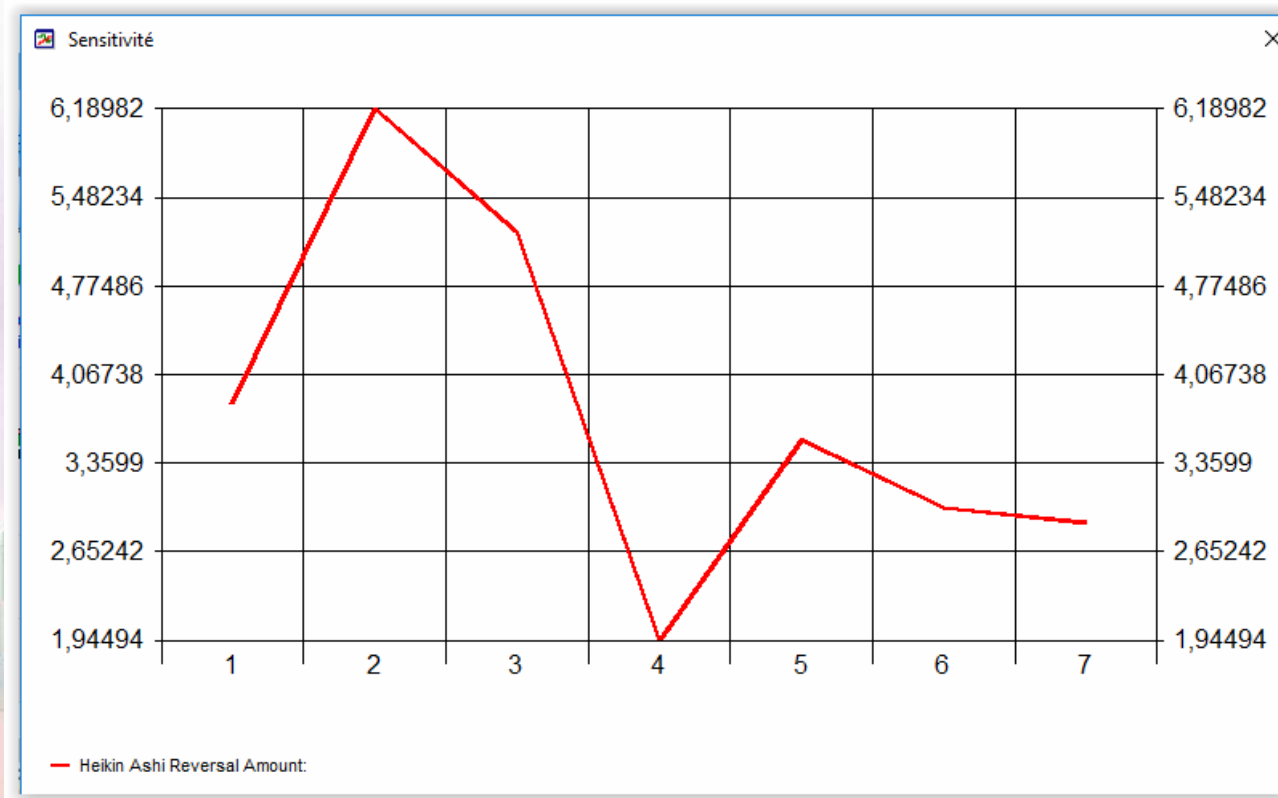
## Paramètre du Supertrend

- La Nanotrader permet d'accéder très facilement à l'examen de l'influence d'un paramètre sur les performances:
- Clic droit sur le paramètre
- Puis « Sensibilité du paramètre »



On voit ici une augmentation du trend moyen quand on augmente le paramètre ATR-factor du Supertrend, mais jusqu'à 7 seulement. On se contentera donc de mettre ce paramètre à 5 (ou 6).

## Paramètre du Heikin Aschi



- Avec une valeur de 2 nous sommes sur un pic d'optimisation du paramètre. Il s'agit cependant de la valeur par défaut et les valeurs 1 et 3 restent largement positives. Restons donc sur cette valeur tout en gardant à l'esprit la fragilité de ce filtre.

# SuperTrend (ATR factor à 5) + Heikin-Aschi : Trade moyen et courbe de gain sur la plage horaire 16h-21h55



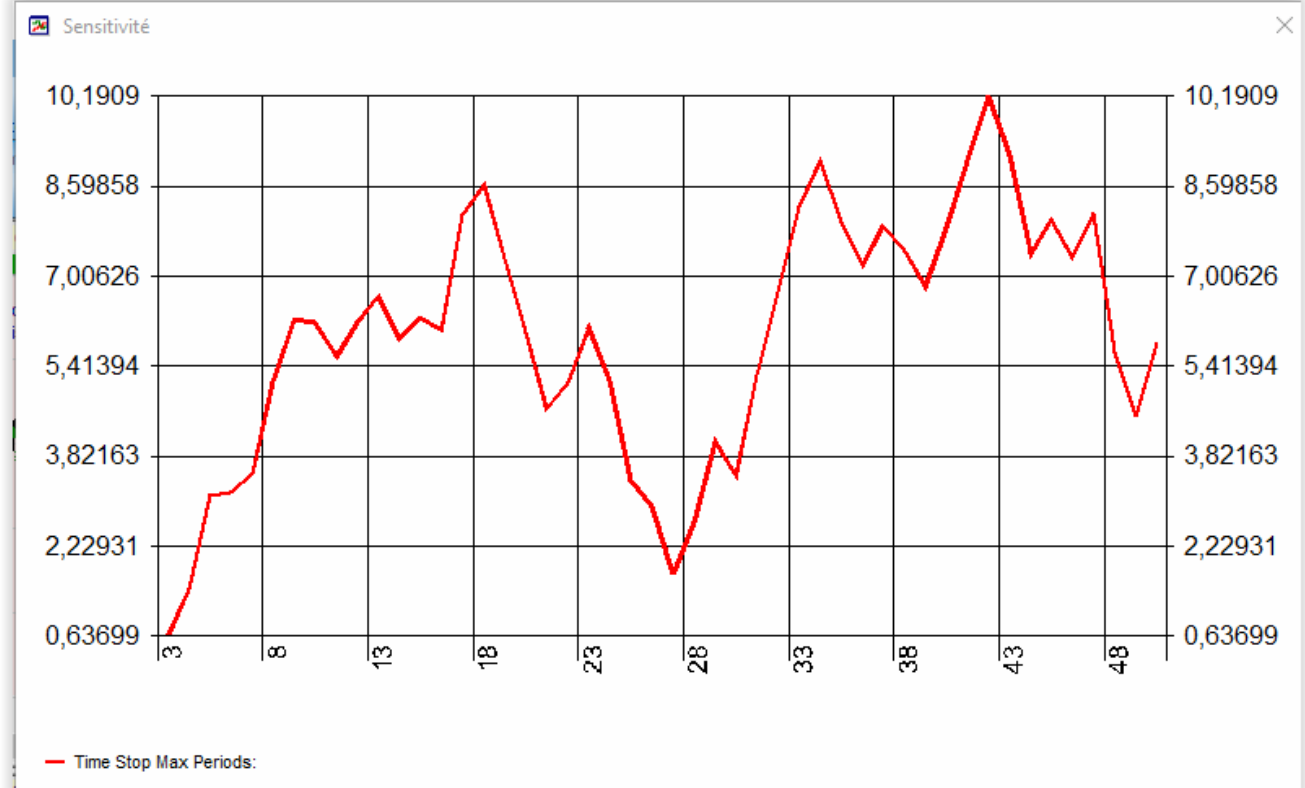
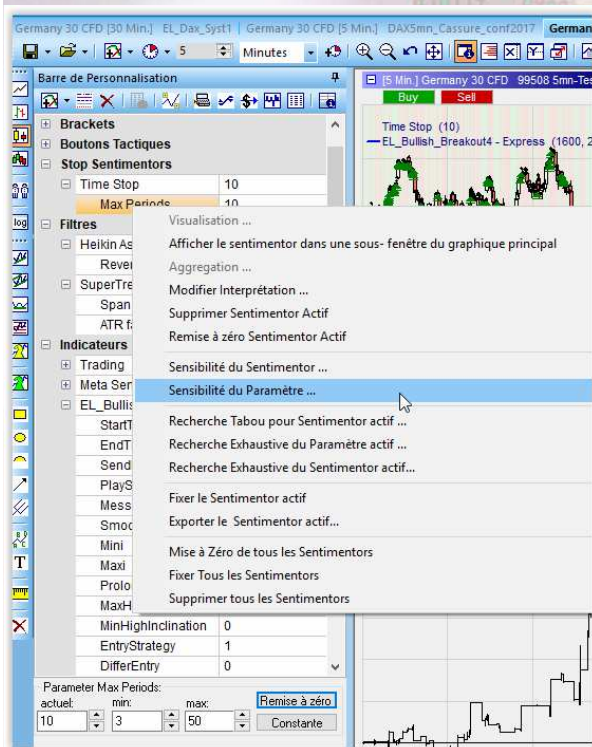
- Le trade moyen est meilleur mais le gain est limité à une plage réduite de l'historique.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Estimer le temps de trade

- Même procédure: un simple clic droit sur le paramètre du Time-Stop, puis clic sur « Sensibilité du paramètre ».



La courbe n'est pas régulière mais présente deux pics de maximum pour le trade moyen.

Le 2<sup>ème</sup> pic a de fortes chances de ne pas être stable (hasard). On devra donc se contenter de garder une valeur de 15 périodes (environ) pour la durée des trades.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

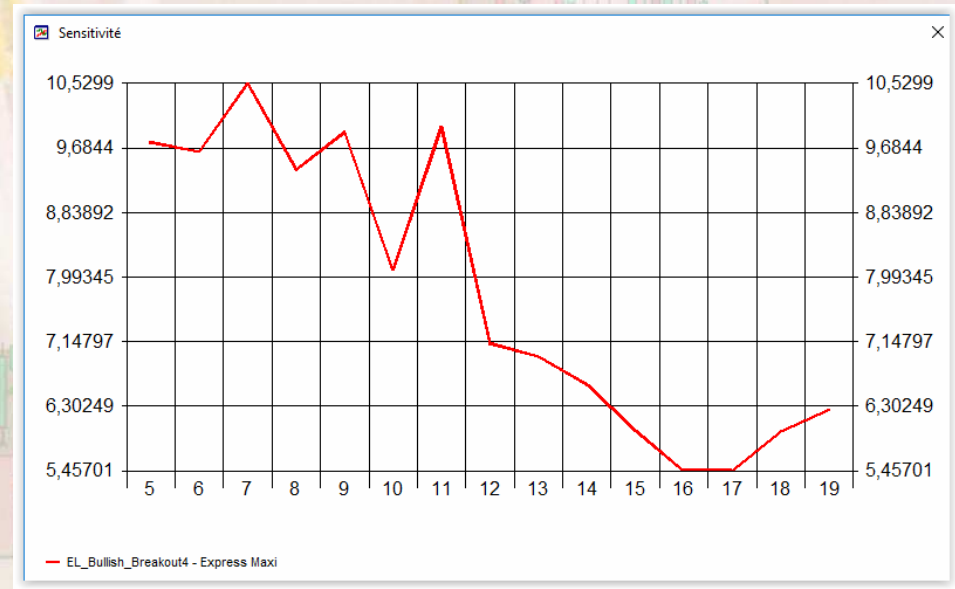
## Courbe des gains avec ce double filtre



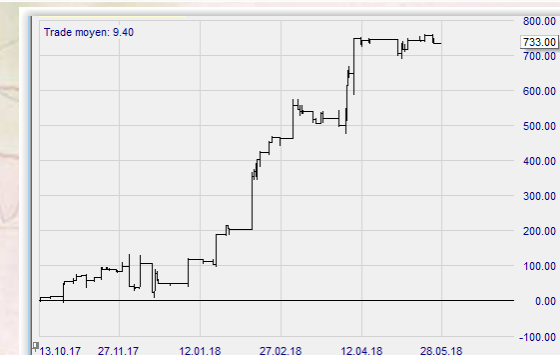
La courbe présente une seule zone de gain assez réduite ce qui n'est pas satisfaisant. Essayons maintenant d'améliorer la qualité du signal de cassure.



## Écartement minimum et maximum du tracé pour les cassures



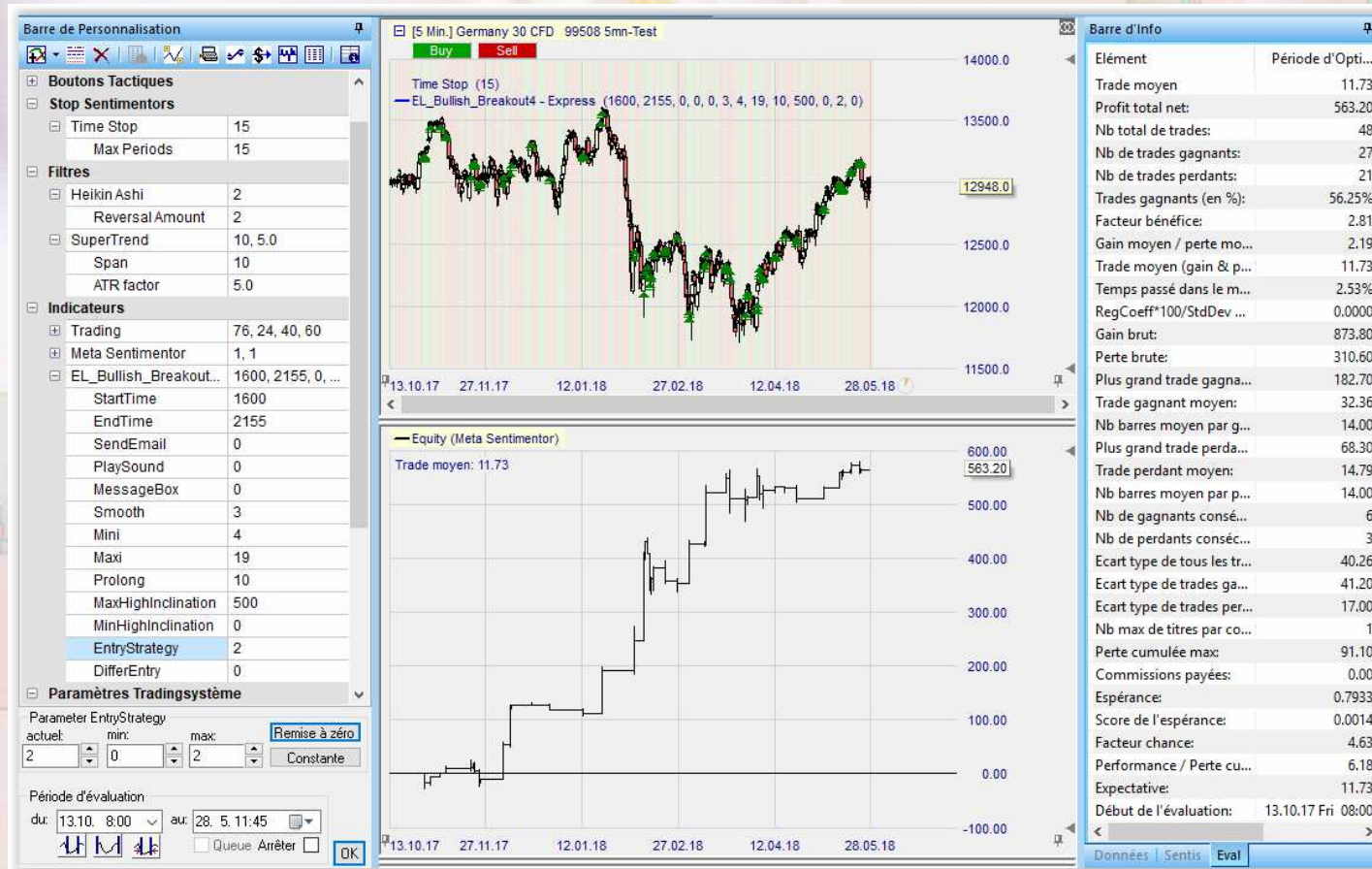
- Augmenter le minimum d'écart conduit à une diminution du trade moyen.
- Diminuer le maximum d'écart conduit à une augmentation du trade moyen mais n'améliore pas la linéarité de la courbe de gain :



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

On peut examiner aussi des paramètres secondaires comme la largeur des sommets utilisables pour le tracé (Smoth) ou la stratégie d'entrée (cassure simple ou cassure en clôture) ce qui nous amène au compromis apparemment le meilleur et le moins instable :



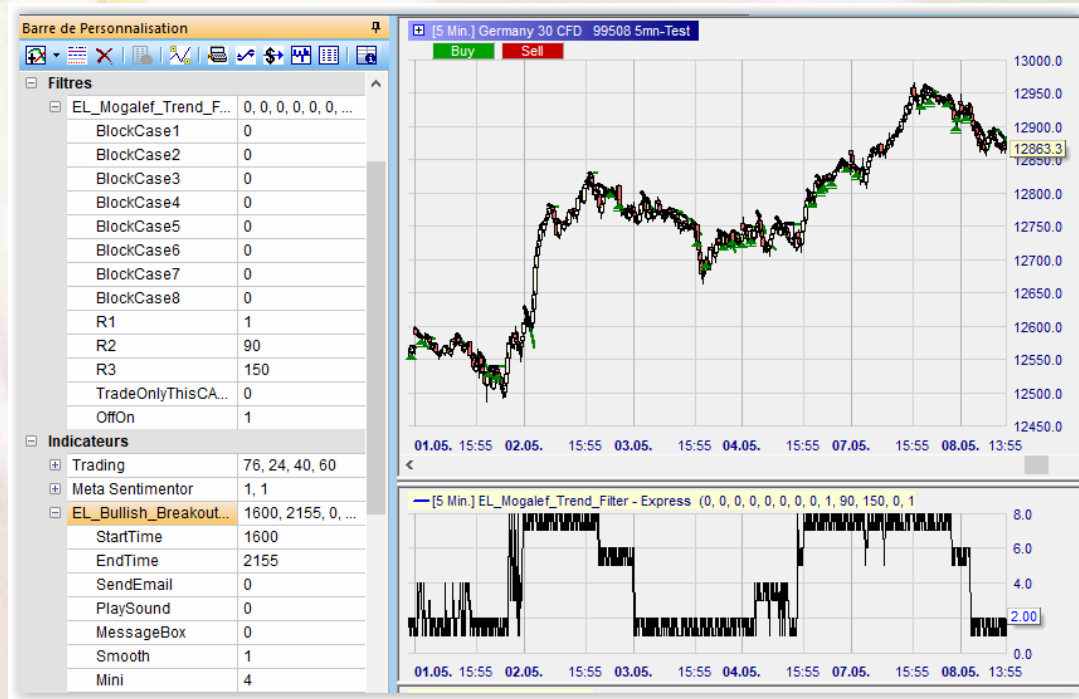
Peu satisfaisant. Effectuons maintenant les mêmes tests avec le filtre MTF.

# Le Mogalef Trade Filter

Le MTF varie de 1 à 8 en fonction de la force et du sens de la poussée. (baissière à haussière)

On peut filtrer (c'est-à-dire interdire les signaux d'entrée) les 8 cas du MTF de façon indépendante

Ici par exemple les cas 1 à 6 sont filtrés ce qui ne laisse actifs que les signaux d'entrée qui ont lieu dans les cas 7 et 8, c'est-à-dire quand la poussée est fortement haussière.

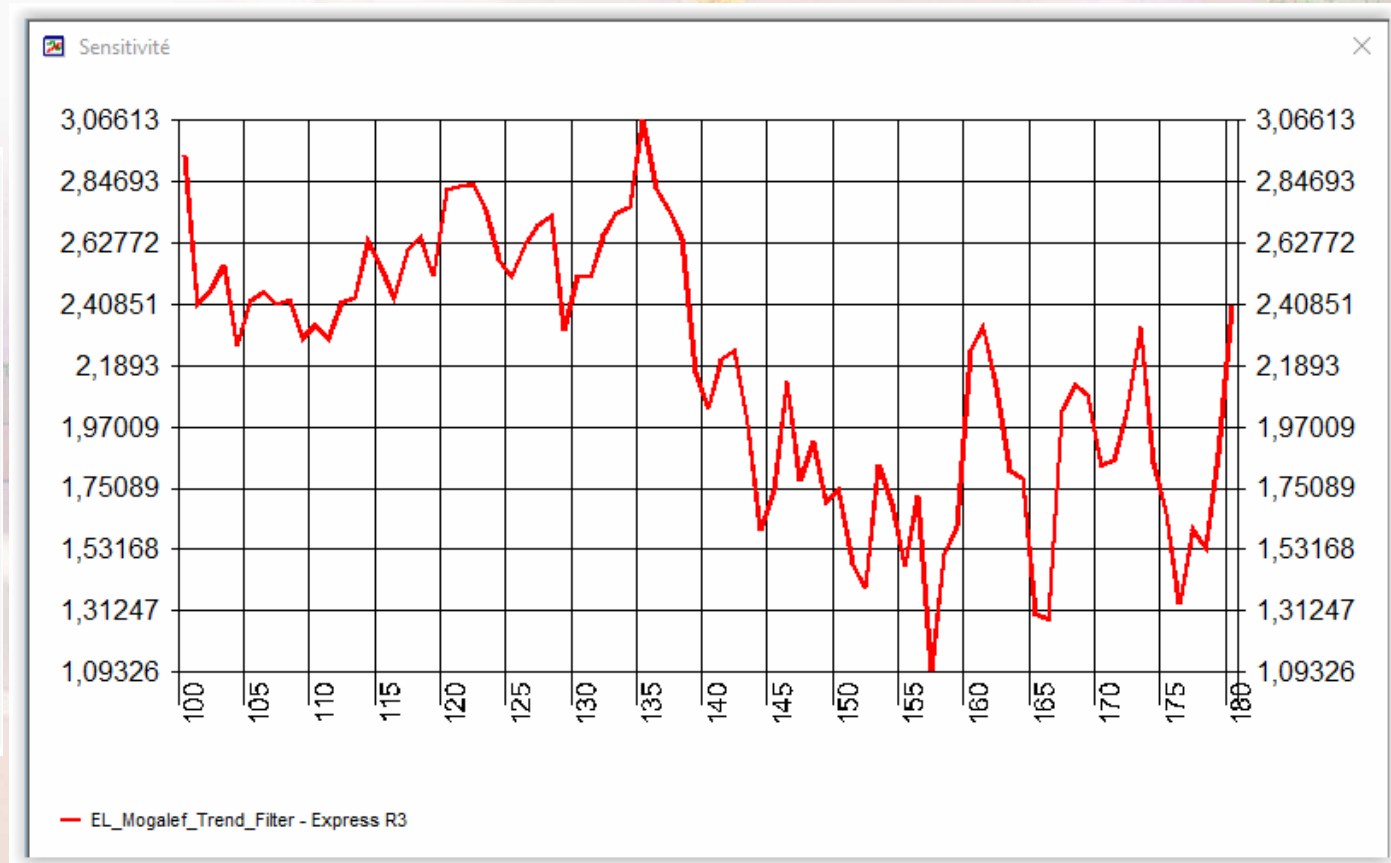


# Paramètres du MTF: gain moyen suivant la valeur de R3

Barre de Personnalisation

Trading  
Brackets  
Boutons Tactiques  
Stop Sentimentors  
Filtres

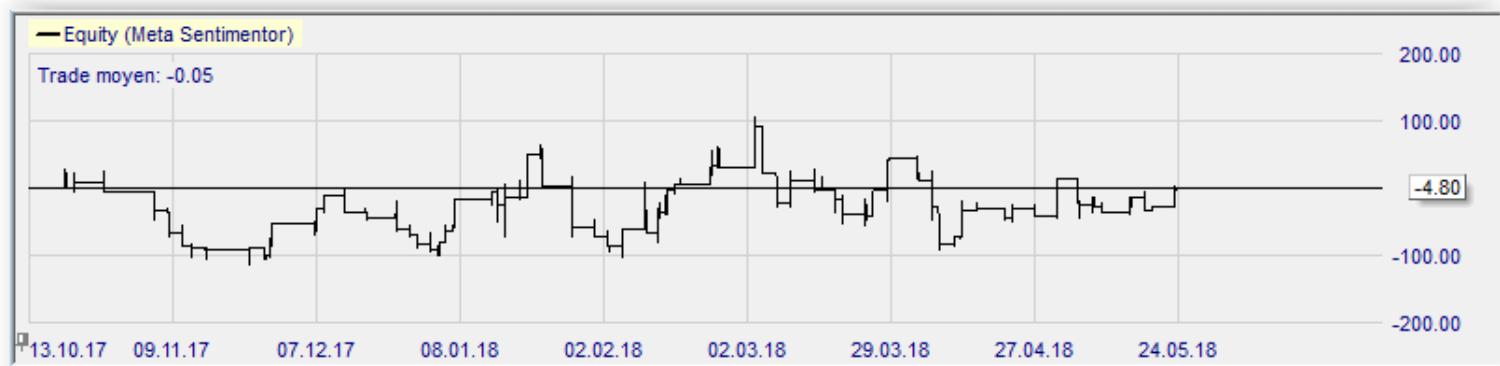
EL_Mogalef_Trend_F...	1, 1, 1, 1, 1, 1, ...
BlockCase1	1
BlockCase2	1
BlockCase3	1
BlockCase4	1
BlockCase5	1
BlockCase6	1
BlockCase7	0
BlockCase8	0
R1	1
R2	90
R3	150
TradeOnlyThisCA...	0
OffOn	1



On diminue dans un premier temps à 130 la valeur du paramètre R3 (rester dans la plage haute 100-135 sans chercher le mieux pour ne pas sur optimiser)

# Trade moyen et courbe de gain suivant les plages horaires

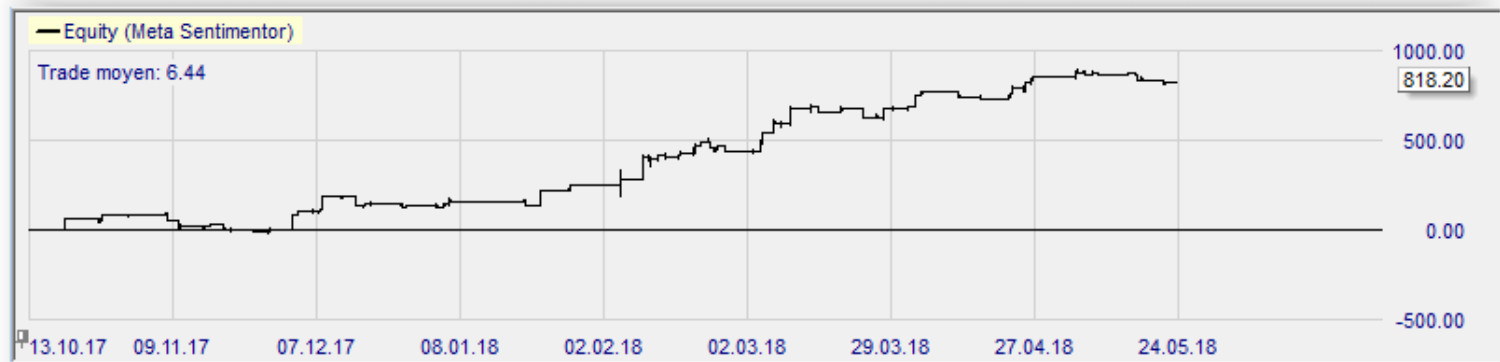
- 8h-12h



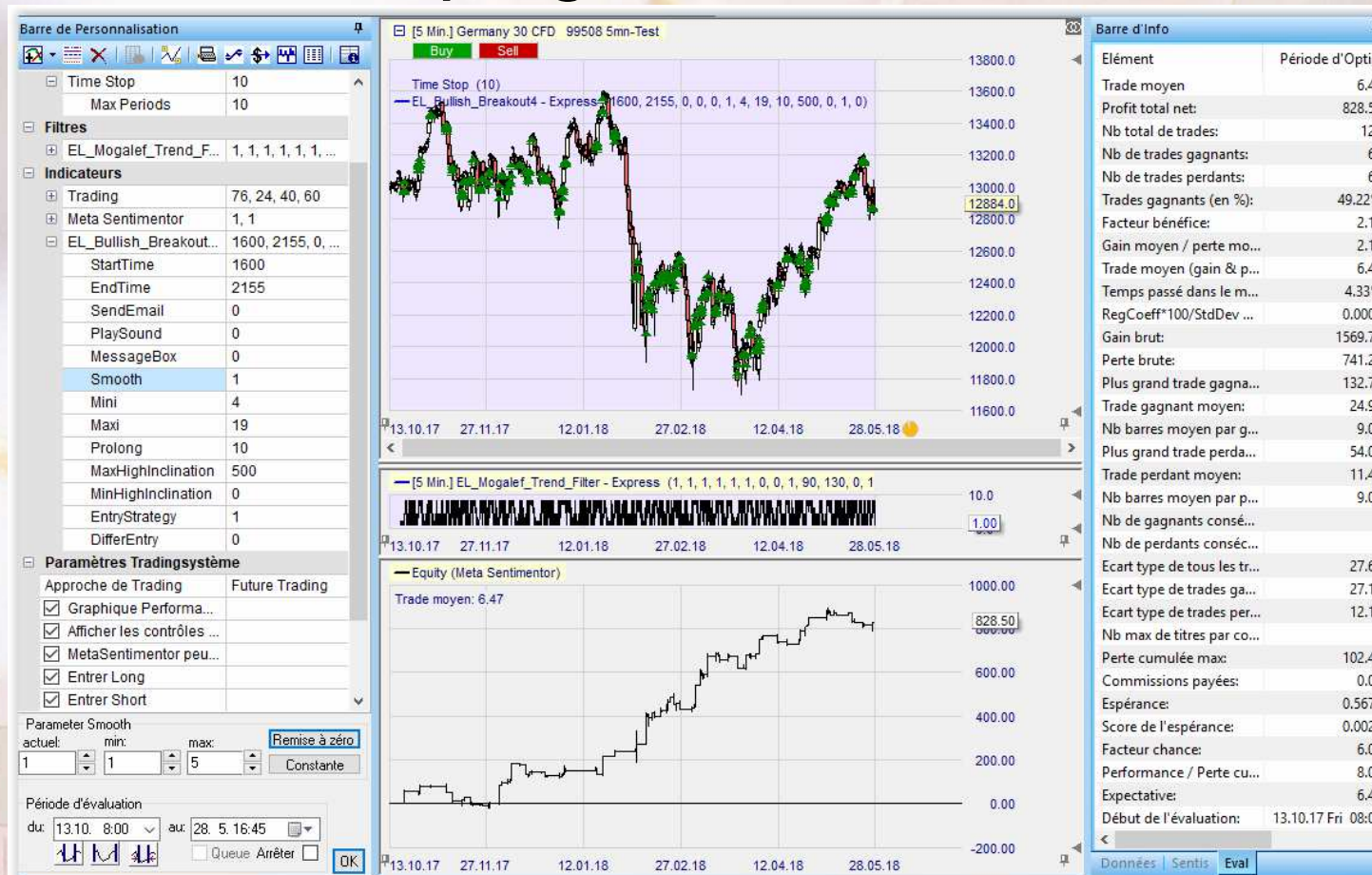
- 12h-16h



- 16h-22h



# Mogalef Trend Filter actif : Trade moyen et courbe de gain sur la plage horaire 16h-21h55



- Le trade moyen est meilleur et la plage de gain est assez large dans le temps.

## Estimer le temps de trade (sensitivité du Time Stop)

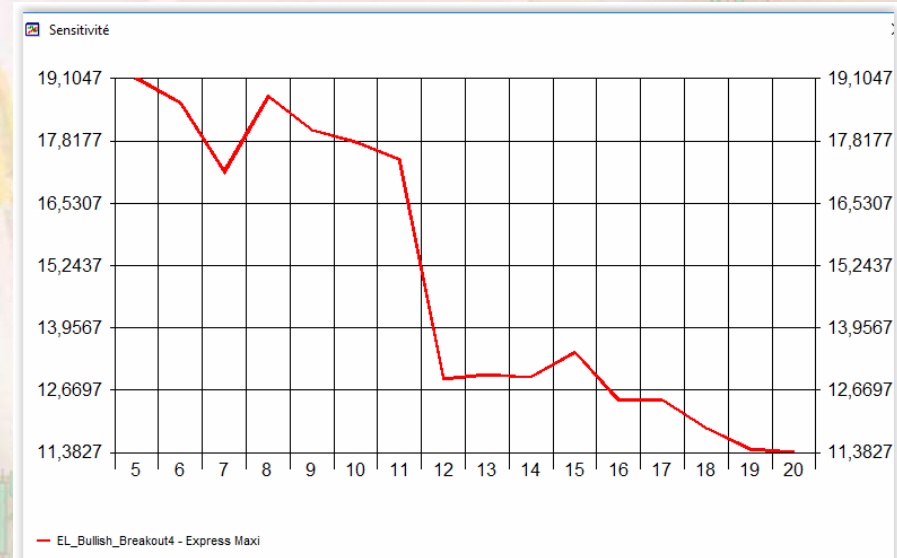
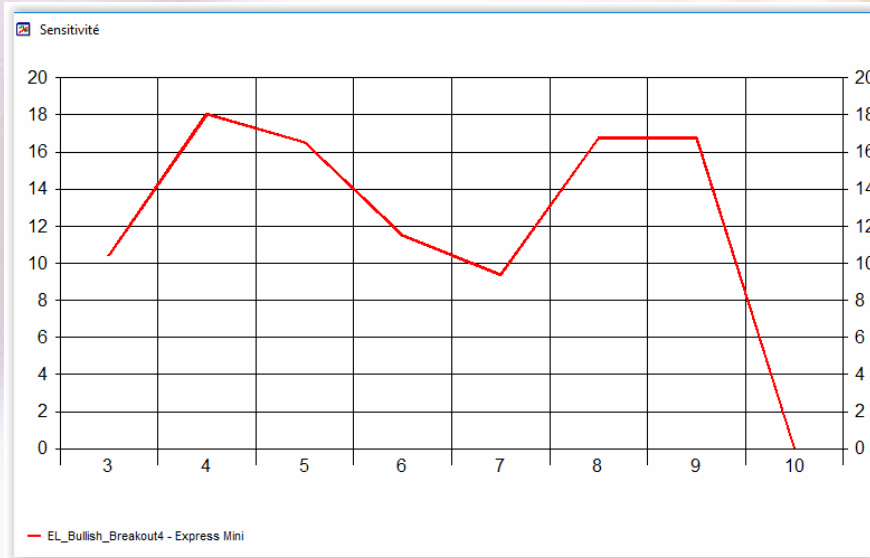
Le gain moyen progresse régulièrement avec la durée du trade, ce jusqu'à 45 périodes environ.

Pour limiter la durée des trades tout en gardant un trade moyen important on retiendra la valeur 30 périodes de 5 minutes (2h30).



# Améliorer la qualité du signal de cassure

Écartement minimum et maximum  
du tracé de droites pour les cassures



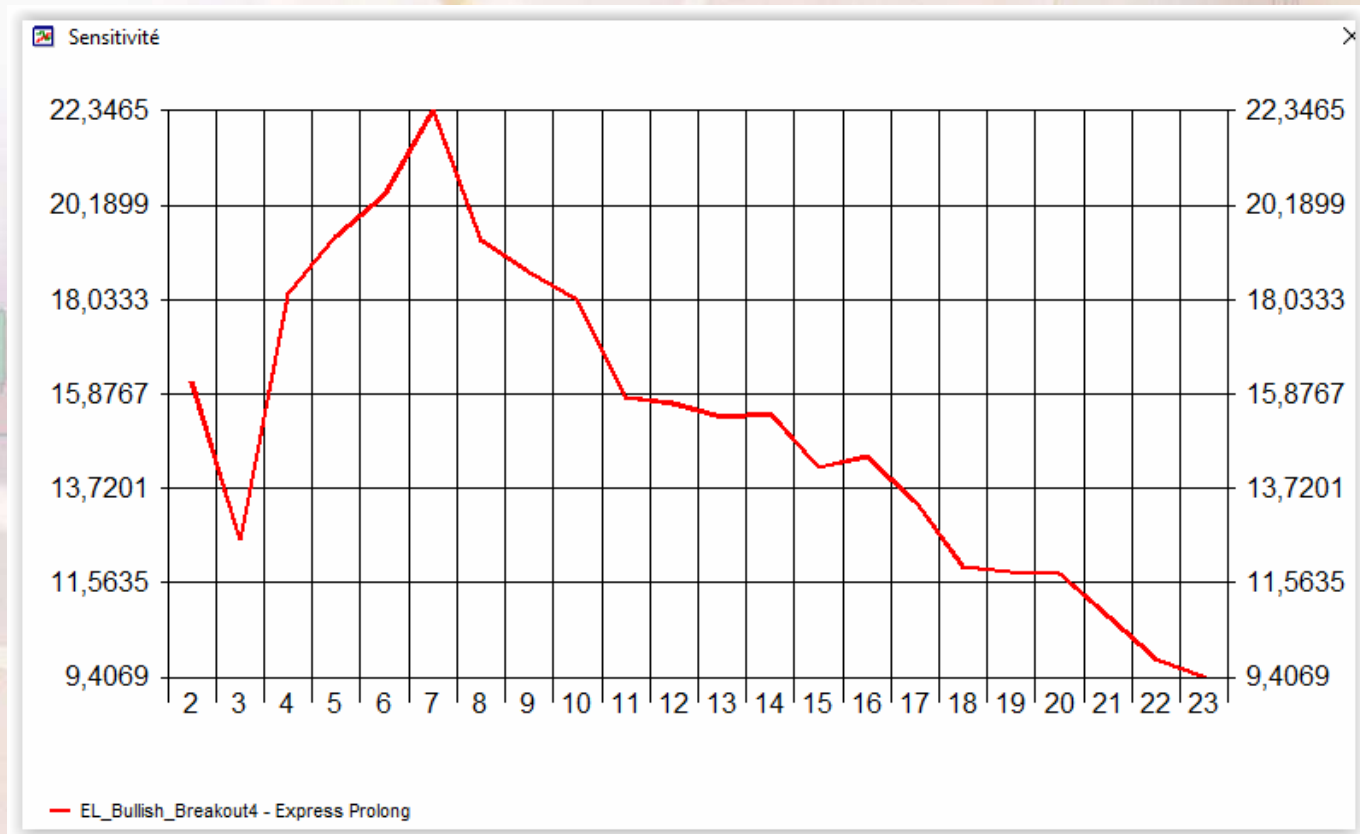
- Augmenter le minimum d'écart pour le tracé diminuera le nombre de trades sans améliorer le trade moyen.
- Diminuer le maximum d'écart pour le tracé du signal augmente fortement le trade moyen à partir de 11.



On adoptera 9 pour la longueur maxi.

# Améliorer la qualité du signal de cassure

La longueur de prolongation de la ligne de signal après traçage entre les deux sommets



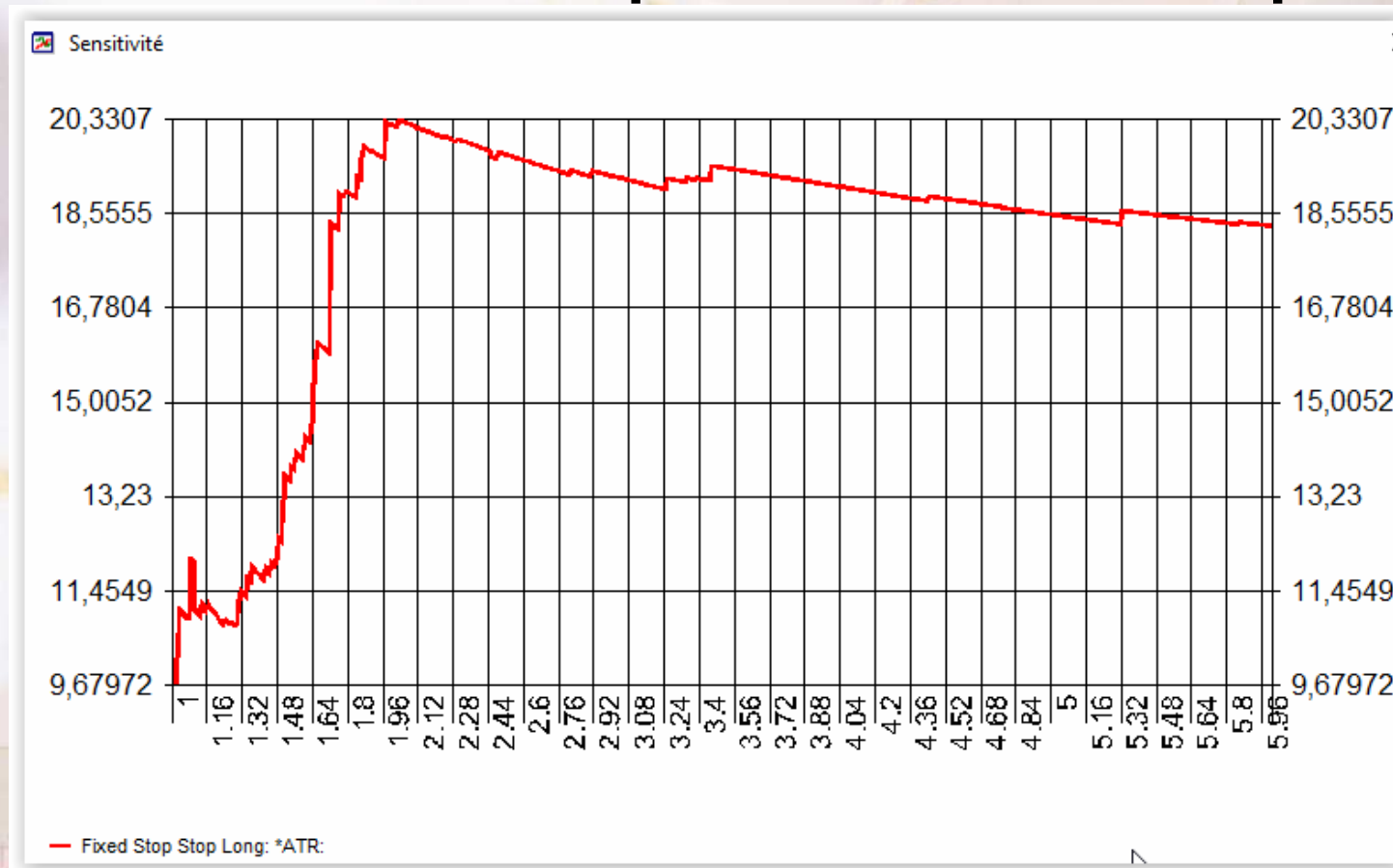
- Diminuer légèrement la prolongation de ligne (actuellement 10 périodes) augmenterait la performance. Attention cependant à la sur optimisation.

## Ajouter un stop loss

- Pour limiter la perte maximum nous pouvons essayer d'utiliser un stop fixe calculé en nombre d'ATR (volatilité).



## Estimer la distance optimale du stop loss



Le graphe est clair: rapprocher le stop en dessous de 2 ATR serait improductif. On met le stop au plus près sans amputer les performances!

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Notre système actuel

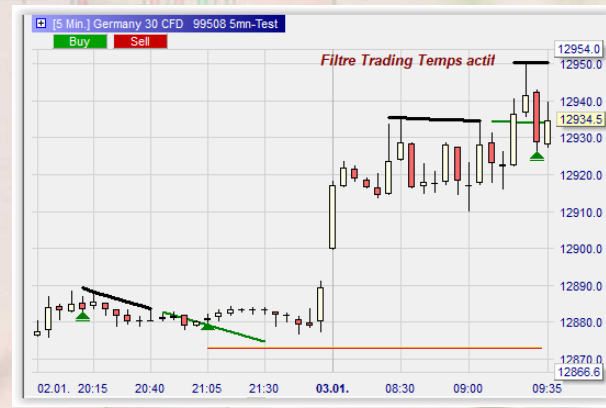


# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

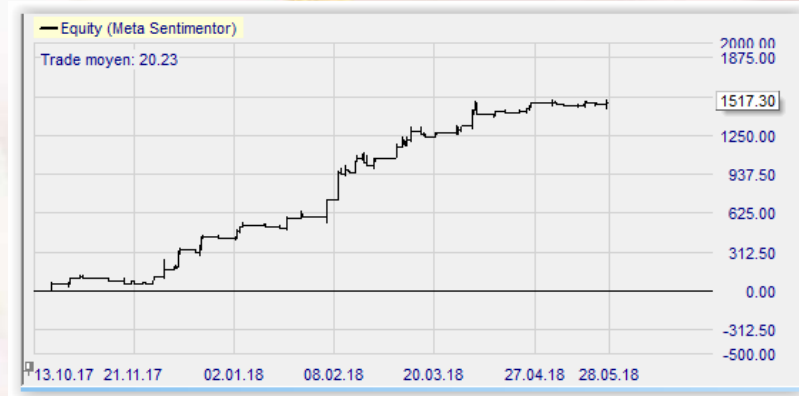
## Eplucher les trades gagnants et perdants

- Quelles circonstances ?
- Quel comportement des trades ?

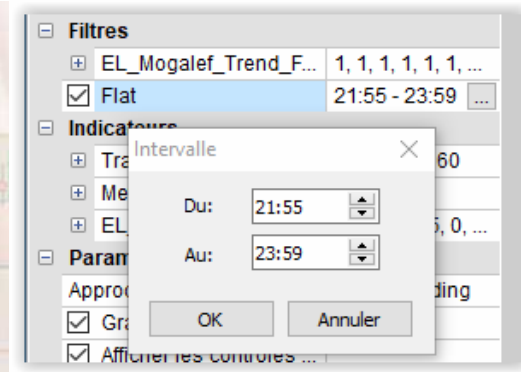


# Envisager la sortie intraday

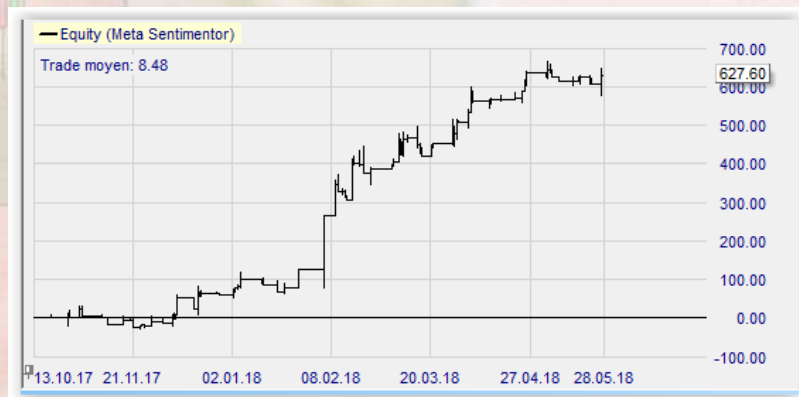
Sans sortie en fin de journée :



On ajoute la sortie en fin de journée :



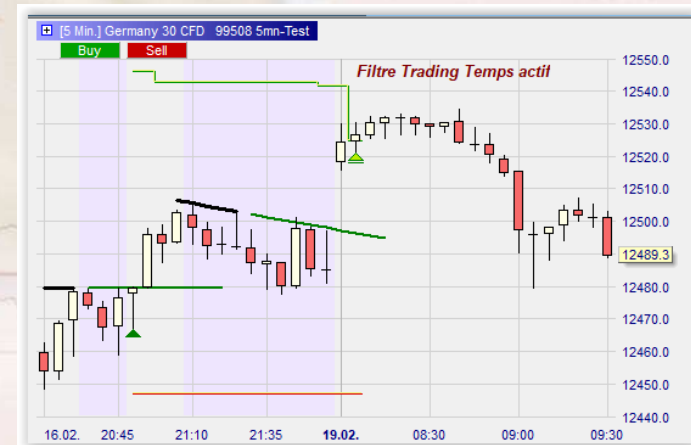
Sortir systématiquement en fin de journée : réduit fortement la rentabilité du système.



## Opportunité d'un objectif

Réfléchir aux objectifs possibles et cohérents avec l'idée de trading

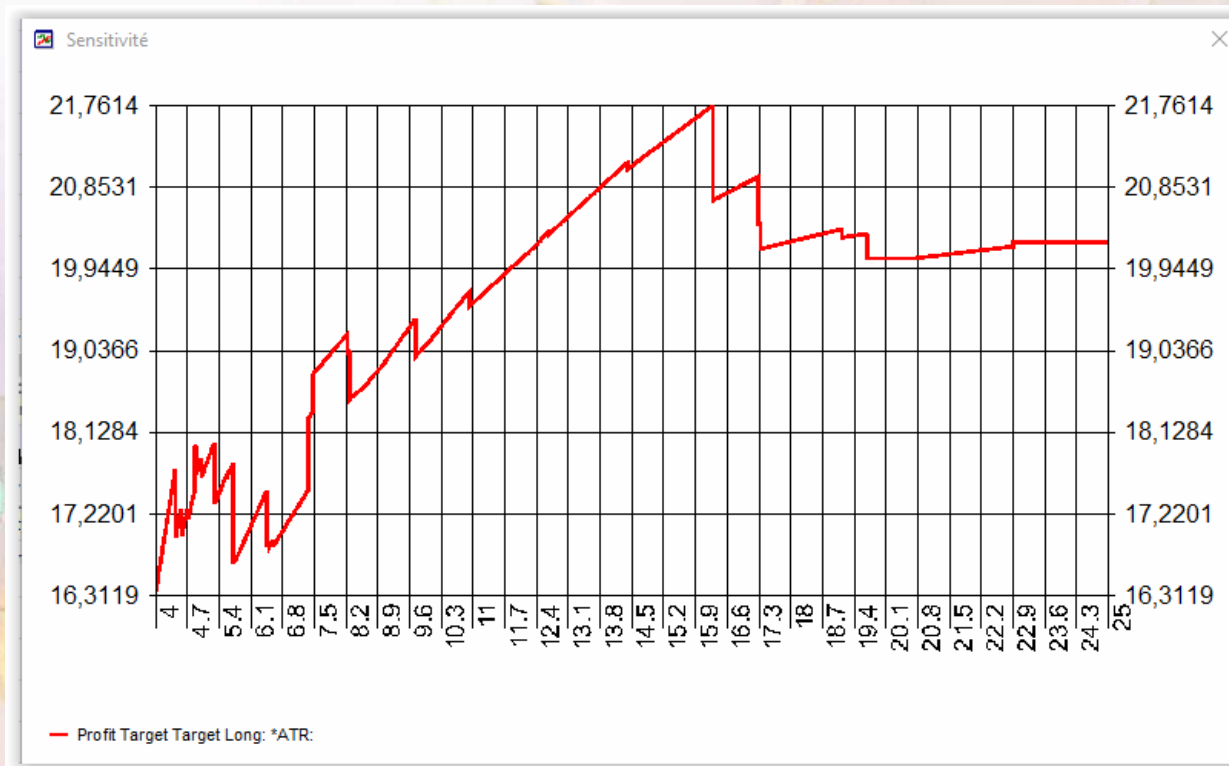
- Objectif fixe ATR
- Intelligent scalping target



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Objectif nombre fixe d'ATR (Profit Target)



On arrive à peine à faire légèrement mieux pour le trade moyen.

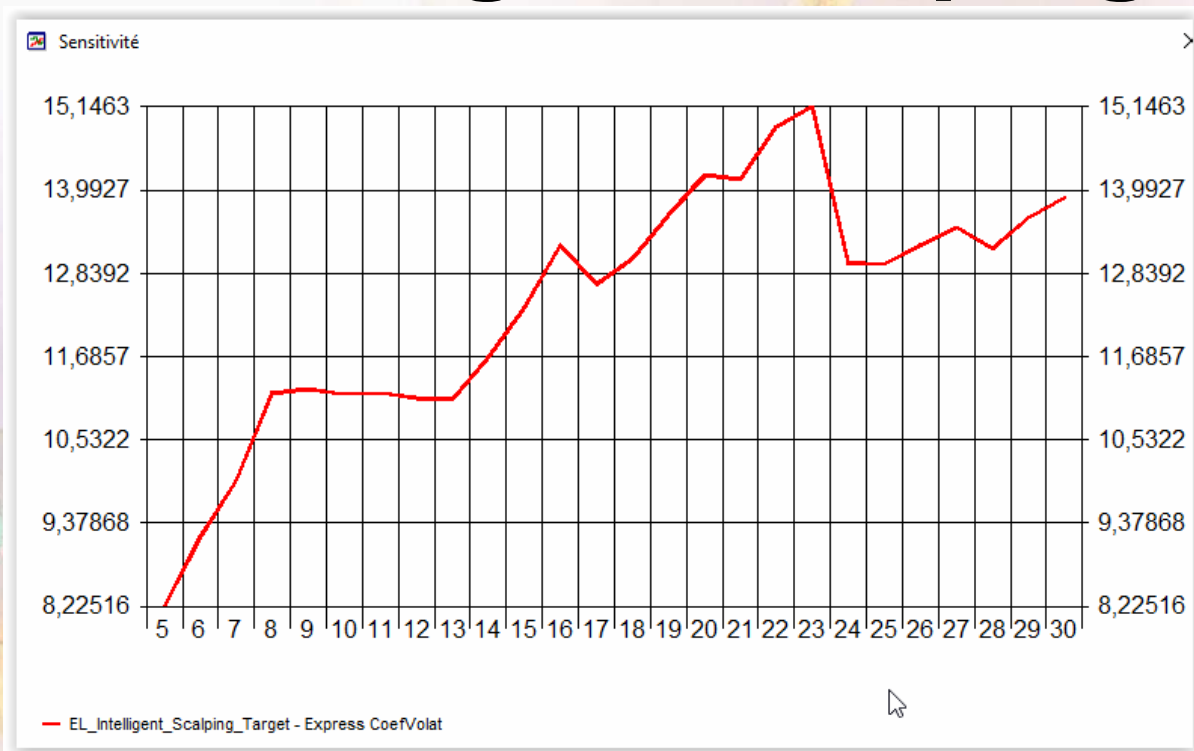
Plus on rapproche l'objectif, plus le % de trades gagnants augmentera.

Elément	Période d'Opti...
Trade moyen	21.67
Profit total net:	1625.60
Nb total de trades:	75
Nb de trades gagnants:	45
Nb de trades perdants:	30
Trades gagnants (en %):	60.00%
Facteur bénéfice:	4.82
Gain moyen / perte mo...	3.21

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Objectif: Intelligent Scalping Target



- La rentabilité par trade diminue, même si jusqu'au réglage 23 du paramètre on augmente fortement le % de trades gagnants.

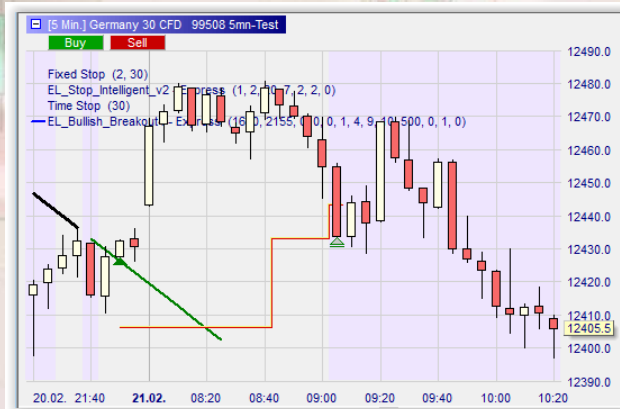
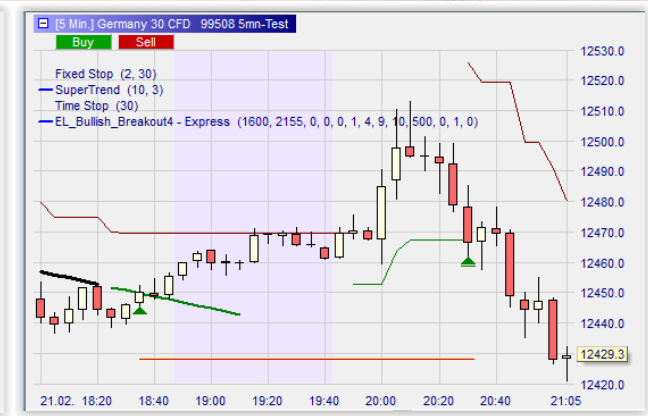
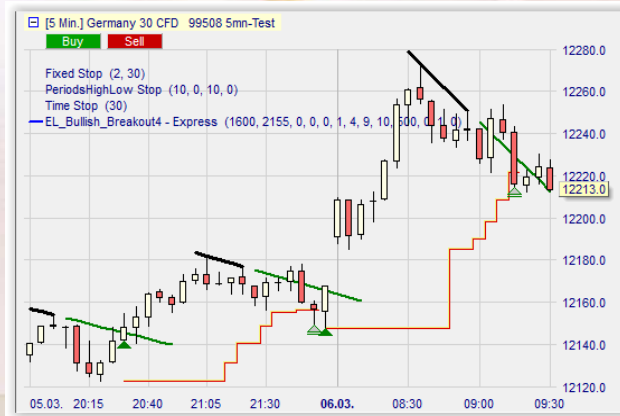
Élément	Période d'Opti...
Trade moyen	15.15
Profit total net:	1181.41
Nb total de trades:	78
Nb de trades gagnants:	53
Nb de trades perdants:	25
Trades gagnants (en %):	67.95%
Facteur bénéfice:	4.06
Gain moyen / perte mo...	1.91
Trade moyen (gain & p...	15.15

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Opportunité d'un stop suiveur

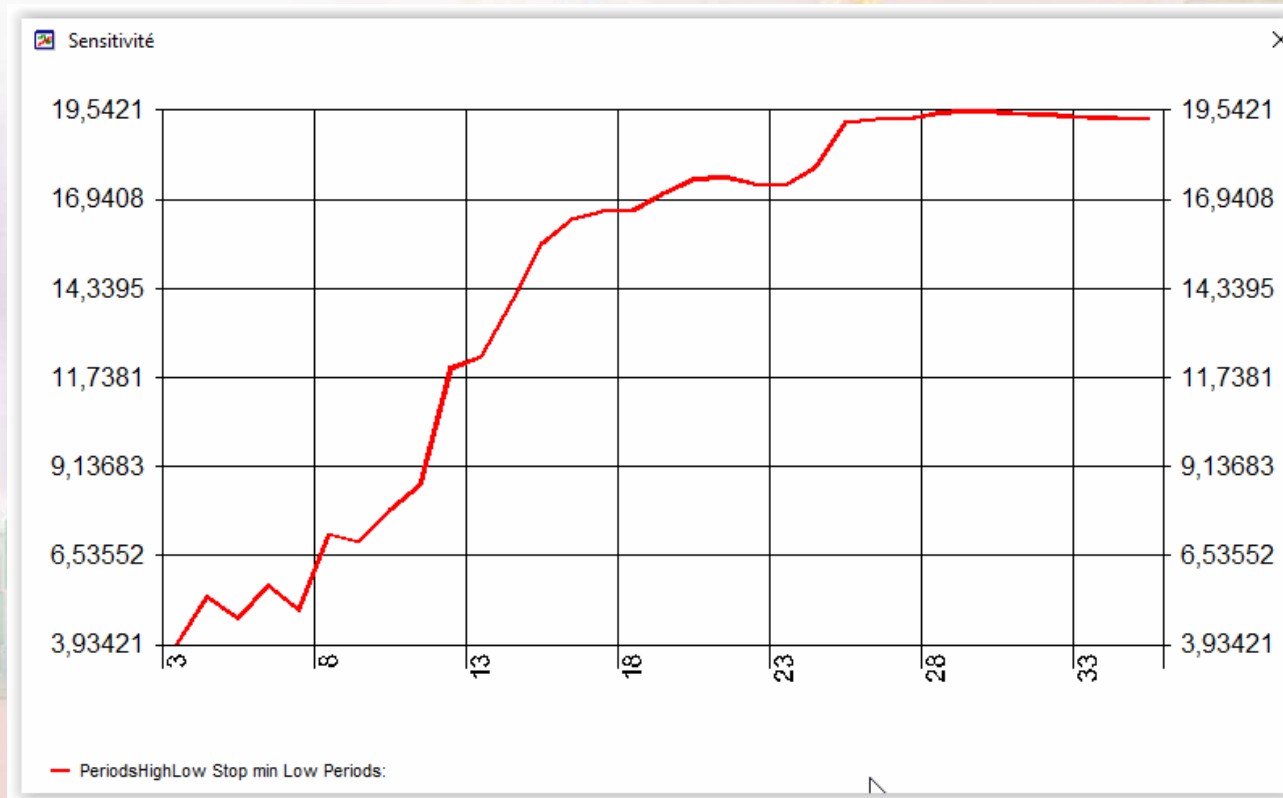
- Period High Low
- Supertrend
- Stop intelligent
- Parabolic Stop



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Period High Low

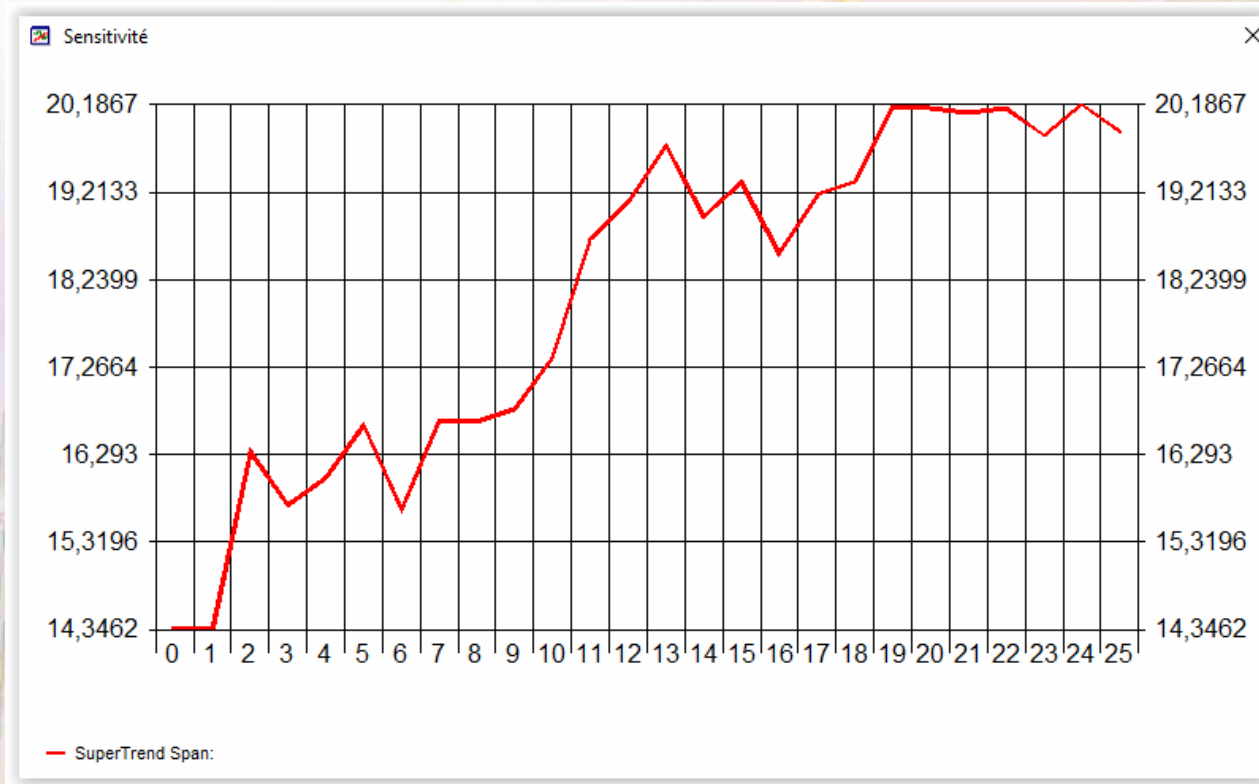


Dégrade la performance, particulièrement quand il se rapproche.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

# SuperTrend

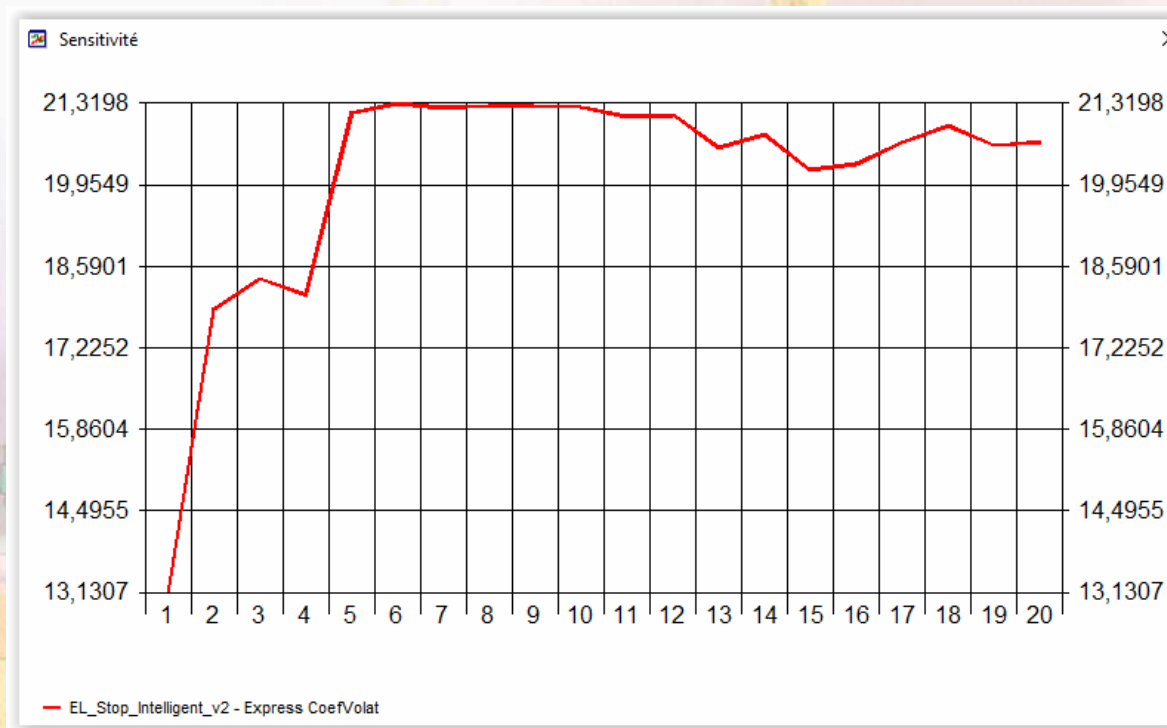


Réduit le gain moyen, n'arrive jamais à améliorer la performance.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Stop Intelligent



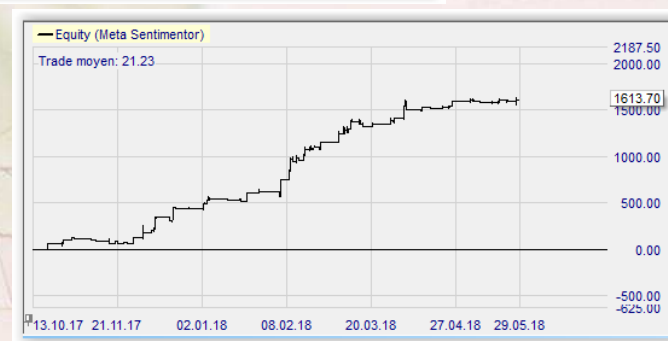
Elément	Période d'Opti...
Trade moyen	20.23
Profit total net:	1517.30
Nb total de trades:	75
Nb de trades gagnants:	43
Nb de trades perdants:	32
Trades gagnants (en %):	57.33%
Facteur bénéfice:	4.05
Gain moyen / perte mo...	3.02
Trade moyen (gain & p...	20.23

Avant

EL_Stop_Intelligent_...	1, 2,
Quality	1
RecentVolat	2
RefVolat	20
CoefVolat	7
FirstLowOrMore	2
FirstHighOrMore	2
WaitForXtrem	1

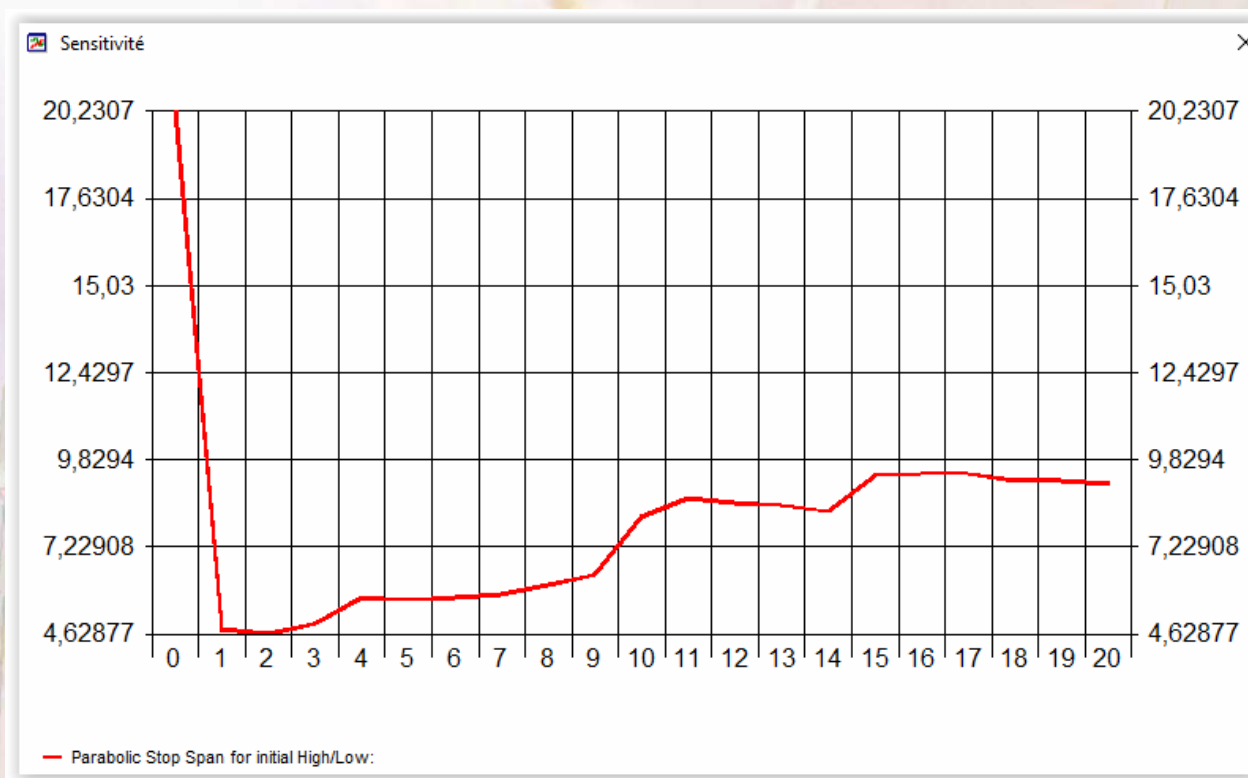
Elément	Période d'Opti...
Trade moyen	21.23
Profit total net:	1613.70
Nb total de trades:	76
Nb de trades gagnants:	46
Nb de trades perdants:	30
Trades gagnants (en %):	60.53%
Facteur bénéfice:	4.76
Gain moyen / perte mo...	3.10
Trade moyen (gain & p...	21.23

Après



Petit gain, peut-être du à une sur optimisation.

## Parabolic Stop

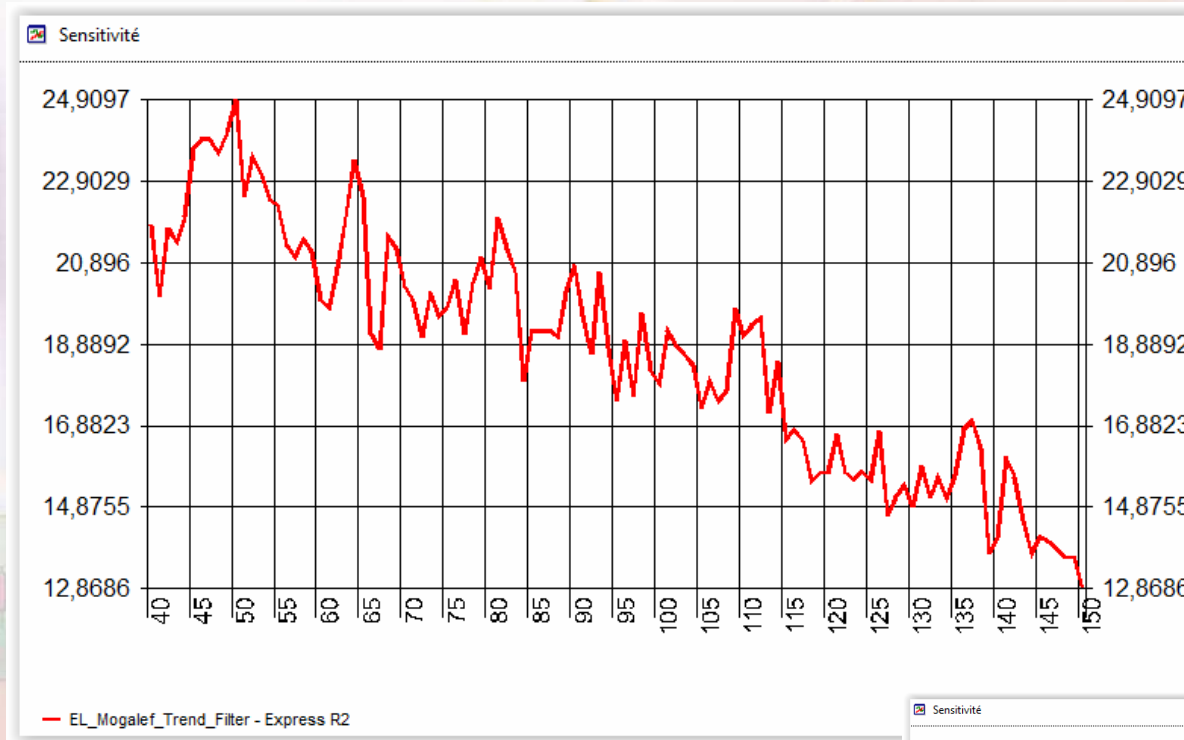


Dégrade fortement la performance, le plus mauvais des quatre.

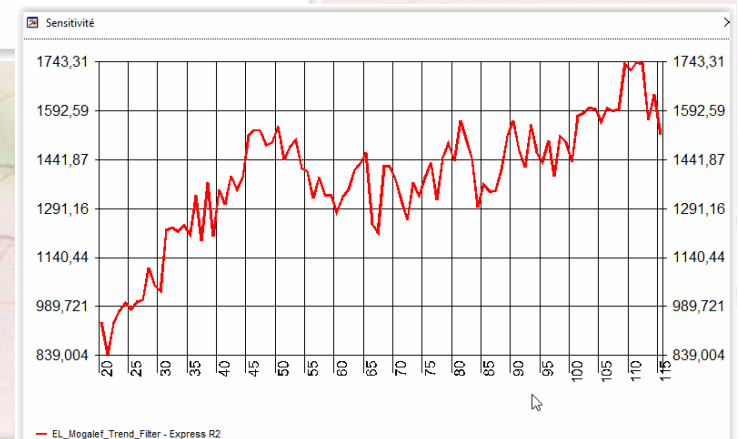
# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Retour sur le filtre MTF paramètre R2



- On voit que diminuer le paramètre R2, c'est à dire rendre plus rapide et plus réactif le filtre, augmente le gain moyen.
- Par contre nous diminuerions le nombre de trades et donc notre gain total:



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Gardons donc le système le plus simple possible



## Récapitulatif

- Idée de départ
- Sélection du support
- Sélection du signal adapté
- Pertinence du signal avec Time Stop
- Examen de plage horaire
- Recherche de filtre logique
- Estimer le temps de trade
- Affiner les paramètres du signal
- Ajout d'un Stop Loss, réglage de distance
- Envisager une sortie horaire (intraday)
- Recherche d'un objectif améliorant le système