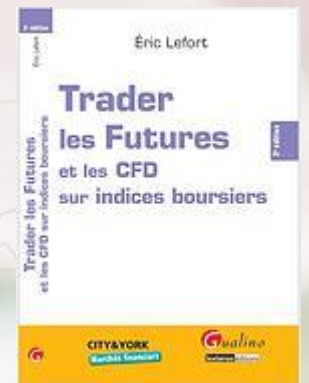


Détection et trading des divergences

MACD – RSI – CCI – Repulses – Stochastique PMT

Présentation conçue par le groupe Mogalef
Présentée par Eric Lefort



Sommaire

- Rappels sur les divergences
- MACD : l'indicateur
- L'indicateur de divergences et ses paramètres
- Bases de systèmes de trading
- RSI : l'indicateur
- L'indicateur de divergences et ses paramètres
- Une base de système de trading
- CCI : l'indicateur
- L'indicateur de divergences et ses paramètres
- Une base de système de trading
- Repulses : l'indicateur
- L'indicateur de divergences et ses paramètres
- Une base de système de trading
- STPMT : l'indicateur
- L'indicateur de divergences et ses paramètres
- Une base de système de trading

M

All charts are from WHSelfinvest NanoTrader

Mogalef Trading

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

WHS FuturaStation Nano

Log In

Panier - Cart

HOME SYSTEMS NEWS INDICATORS TOOLS PRIVATES CLUBS PRACTICE WITH MOGALEF FORMATIONS Forums Mogalef Membres

Conférences WHSelfinvest 2021

Conférences WHSelfinvest 2019

Conférences WHSelfinvest 2018

Conférences WHSelfinvest 2017

Conférence Salon du Trading 2017

Conférences WHSelfinvest 2016

Conférence Salon AT 2016

Conférences WHSelfinvest 2015

Conférences SALON AT 2015

Conférences SALON DU TRADING 2014

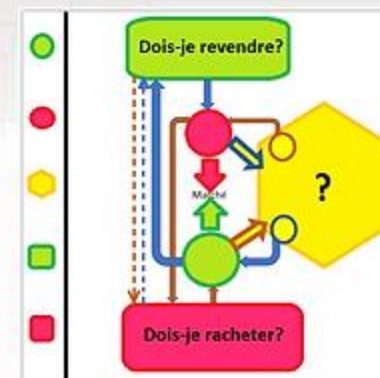
Stage formation 2017

21 daytrading et swingtrading

Eric Lefort le 22/11/2021

tables sur les indices (CAC,DAX,DOW...) et éventuellement sur les monnaies premières (Or) et le Bitcoin.

comportements récurrents des cours, c'est à dire sur des états psychologiques variables.



Indicateur gratuit

Eric Lefort le 24/10/2021

naussière fait partie des meilleurs signaux générateurs de gains. Il présente l'avantage de pouvoir être utilisé en automatique, le trade pas en automatique et il peut être pénible d'attendre le signal pendant des heures en regardant les cours.

... le monde n'a pas la NanoTrader FULL.

Jusqu'à présent il était possible d'être averti par un signal sonore que la position devait être prise immédiatement, mais rien ne prévenait que la **possibilité d'un signal d'achat** approchait. Ceci obligeait à constamment surveiller la formation d'une droite de cassure.

Cette nouvelle version vous permet d'**être averti par une alerte sonore dès qu'une droite de cassure se forme**. Vous aurez donc à surveiller le marché uniquement à partir de ce moment.

Téléchargement Indicateur de cassure avec alerte

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Divergence baissière

Un **signal de vente** apparaît si les cours font un nouveau plus haut, plus haut que le plus haut précédent, pendant que le MACD fait un nouveau plus haut, moins haut que le plus haut précédent.

Cette situation indique un affaiblissement de la tendance haussière, favorable soit à une sortie de position longue, soit à une entrée en position courte contre la tendance.



Divergence haussière

Un **signal d'achat** apparaît si les cours font un nouveau plus bas, plus bas que le plus bas précédent, pendant que le MACD fait un nouveau plus bas, plus haut que le plus bas précédent.

Cette situation indique un affaiblissement de la tendance baissière, favorable soit à une sortie de position courte, soit à une entrée en position longue contre la tendance.



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Divergence baissière inverse

Un **signal de vente** apparaît si les cours font un nouveau plus haut, moins haut que le plus haut précédent, pendant que le MACD fait un nouveau plus haut, plus haut que le plus haut précédent.



Divergence haussière inverse

Un **signal d'achat** apparaît si les cours font un nouveau plus bas, plus haut que le plus bas précédent, pendant que le MACD fait un nouveau plus bas, plus bas que le plus bas précédent.



MACD : convergence divergence de moyenne mobile

- Des divergences peu nombreuses et bien placées caractérisent cette tendance nette avec de belles oscillations.

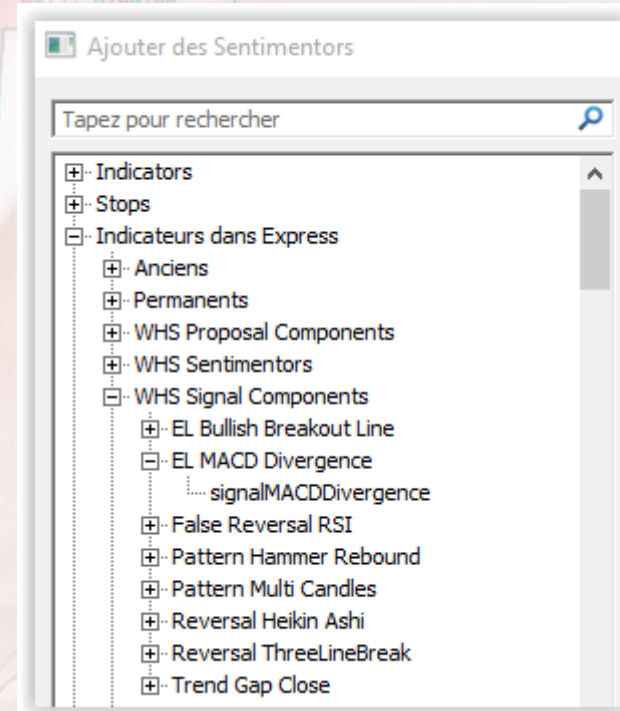
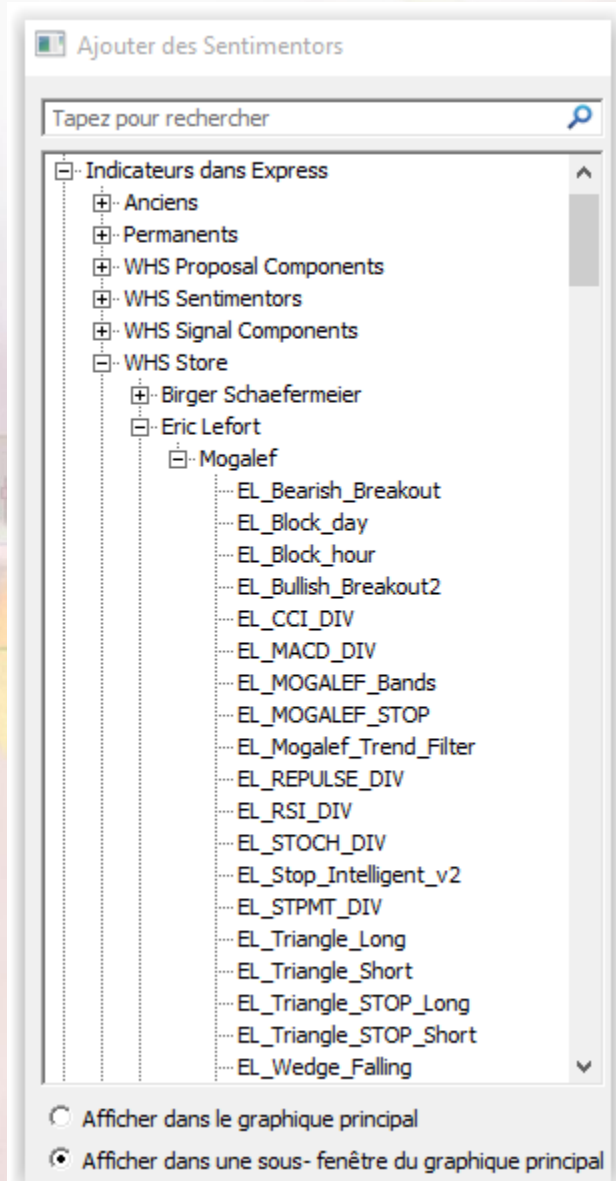


MACD : convergence divergence de moyenne mobile

- De faibles oscillations et une tendance molle provoqueront d'office des divergences.



Où trouver l'indicateur de divergence MACD ?



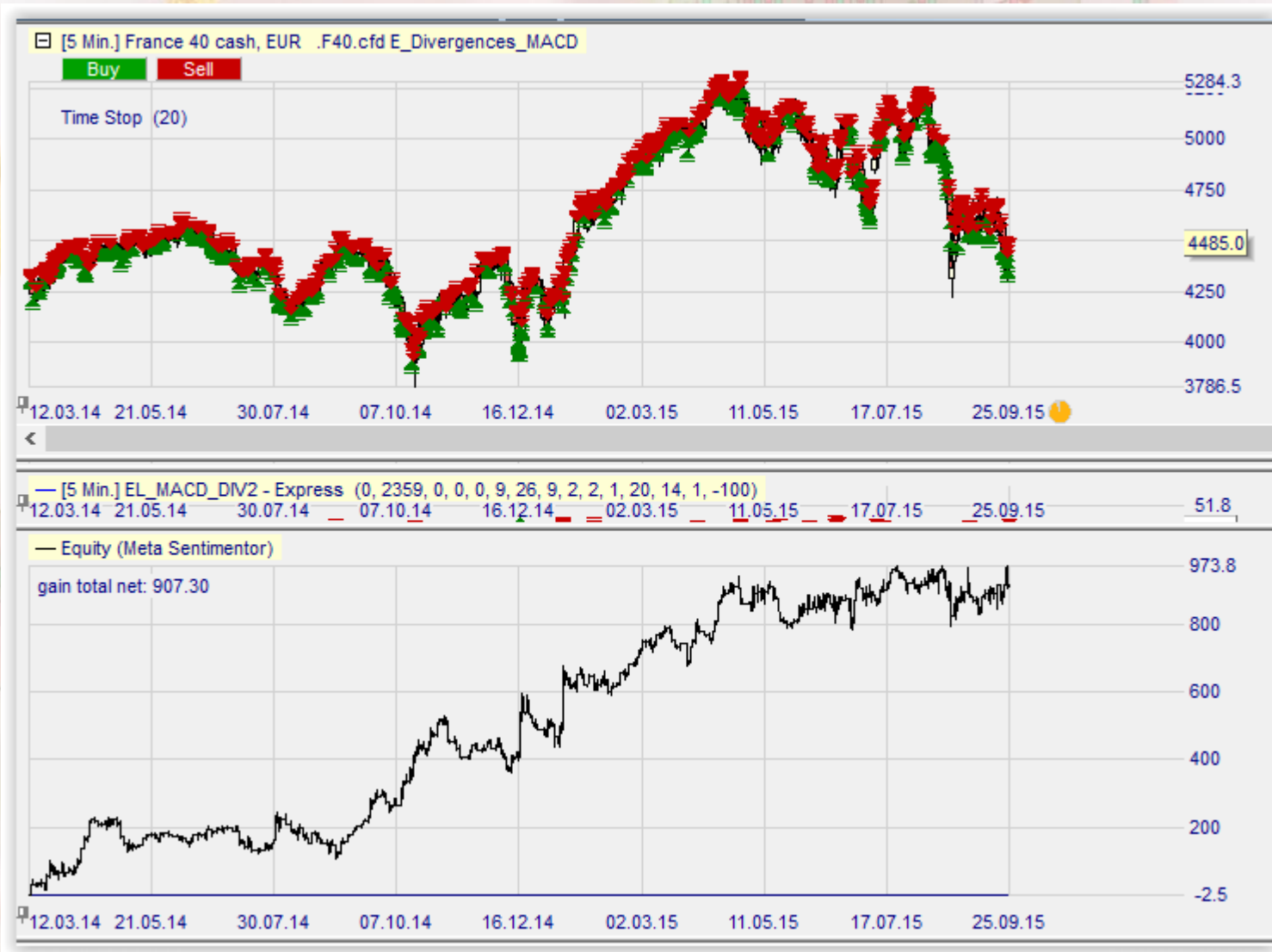
Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Aperçu d'une courbe de gain sur le 5 minutes.

Les paramètres de base :

EL_MACD_DIV - Express	0, 2359, 0, ...
StartTime	0
EndTime	2359
PlaySound	0
MessageBox	0
SendEmail	0
EMAFast	12
EMASlow	26
EMA	9
smothH	2
smothL	2
ONone1Normals2Inverses3All	1
DistanceMaxH	200
DistancemaxL	200
DifferEntry	0
StrengtRepulsionTicks	-100



Filtre horaire

- Ne laisse passer les signaux de divergence qu'entre l'heure de début et l'heure de fin :
- StartTime : heure de début au format HHMM
Ex : 815 pour 8h15
- EndTime : heure de fin au format HHMM
Ex : 2130 pour 21h30

Utile par exemple pour éviter les signaux intervenant sur des gaps, ne pas rester en overnight (en association avec un filtre horaire), sélectionner ou éviter les heures US ou les heures de statistiques ...

Alertes

- PlaySound : 0=non 1=oui
Joue une alerte sonore en cas de divergence détectée.
- MessageBox : 0=non 1=oui
Affiche une boîte d'alerte en cas de divergence détectée.
- Send email : 0=non 1=oui
En cas de divergence, envoie un mail à l'adresse donnée.



EMA Fast et EMA Slow

- Moyenne exponentielle rapide
- Moyenne exponentielle lente

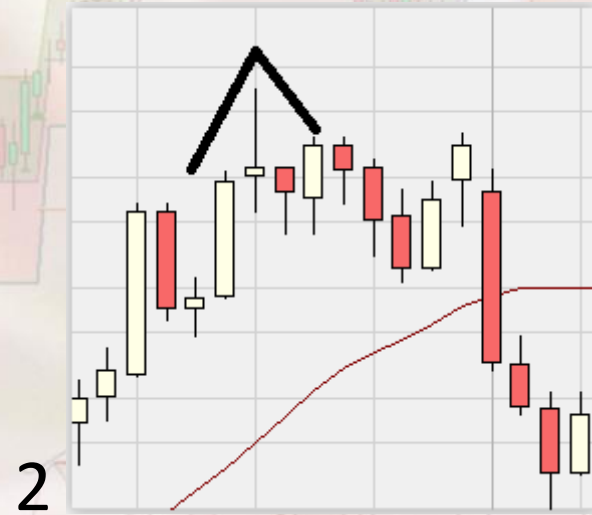


Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Smoth H et Smoth L

- Il s'agit du nombre de bougies nécessaires de chaque coté d'une bougie centrale pour qu'un sommet ou un creux soit validé comme tel.



0None1Normals2Inverses3All

- 0 : aucune divergence ne sera signalée.
- 1 : Seules les divergences normales seront signalées.
- 2 : Seules les divergences inverses seront signalées.
- 3 : Toutes les divergences seront signalées.



DistanceMaxH et DistanceMaxL

- Il s'agit de la distance maximale admise entre deux creux ou entre deux hauts pour tracer une divergence.
- Notez que la distance minimum est gérable grâce au paramètre smoth



DifferEntry

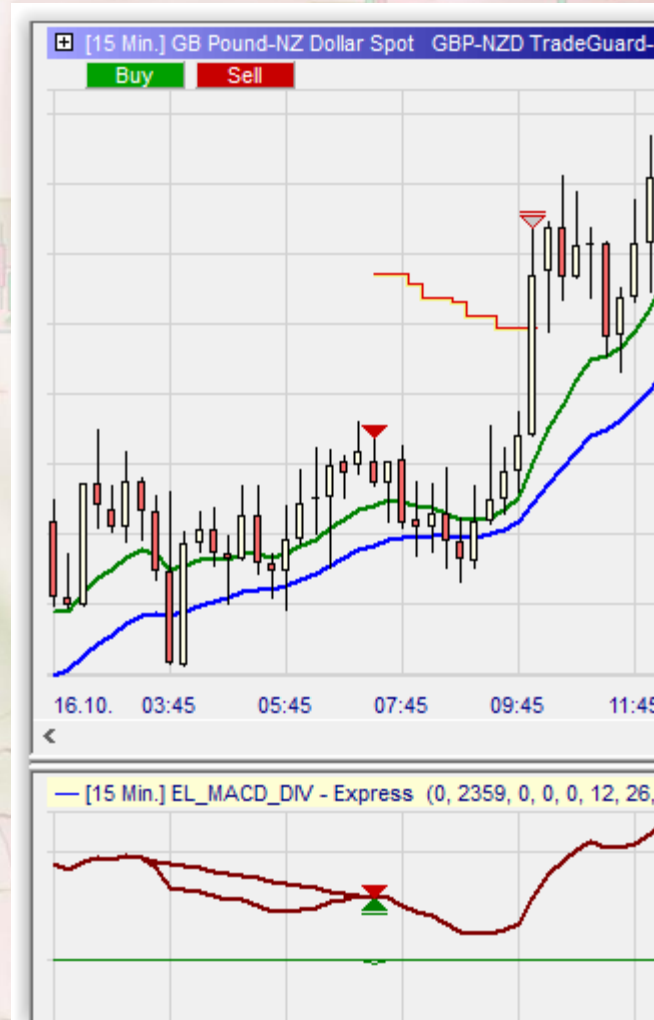
Permet de différer l'entrée d'un certain nombre de bougies (ici deux bougies).



StrengtRepulsionTicks

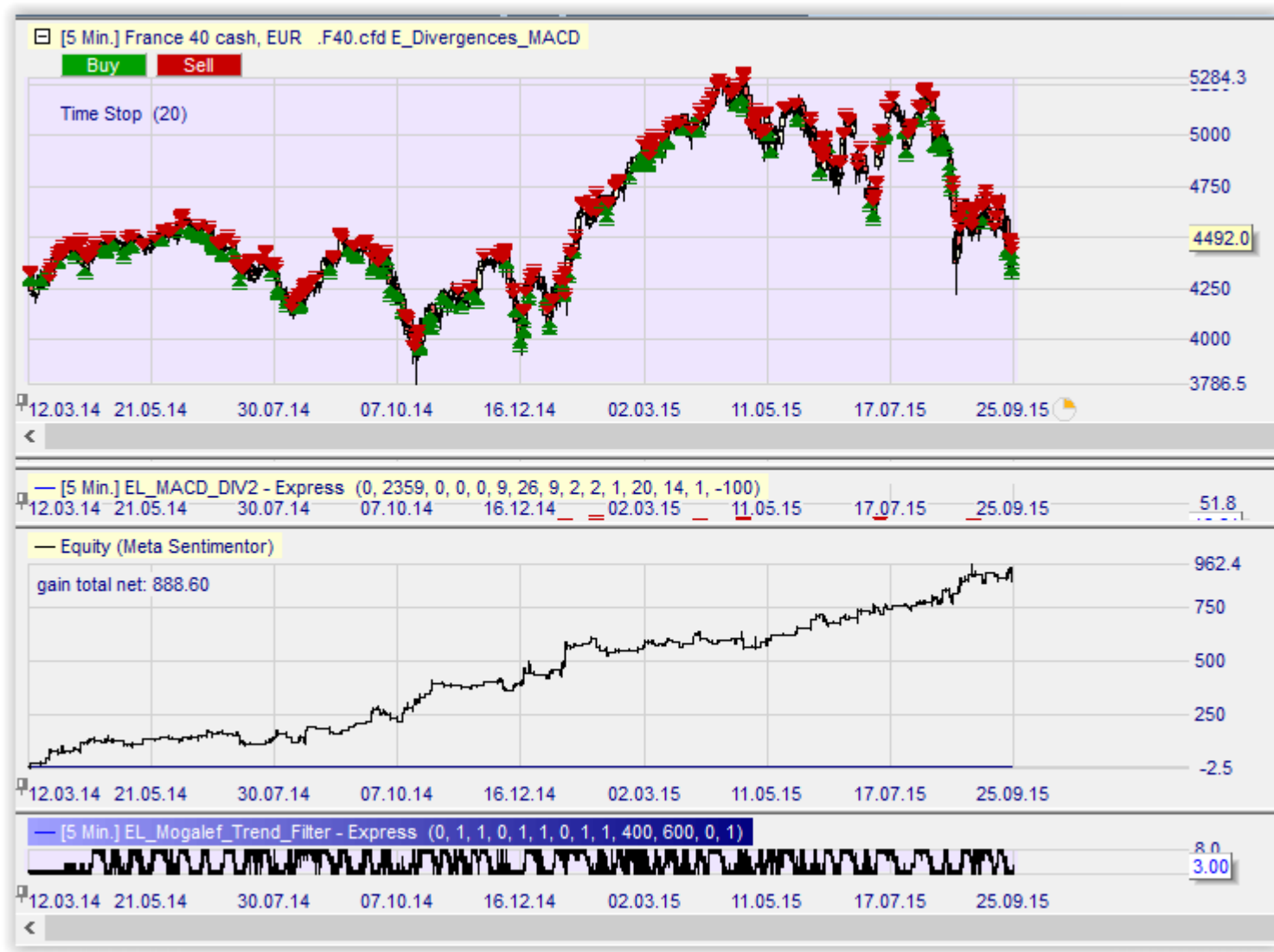
- Permet d'éliminer les signaux qui n'ont pas assez de force.
La mesure s'effectue en nombre de ticks.

Ici -100 puis +500



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



On voit que l'on peut utiliser les divergences sur le 5 minutes. Cependant, le gain moyen apporté sera relativement faible. Il faudra donc utiliser d'autres avantages que les divergences en simultan  avec celles-ci.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



On peut aussi être plus exigeant sur la puissance des divergences.

Ceci reste valable de nos jours.



RSI : gain réalisé sur période fixe

- La divergence baissière apparaît car le gain réalisé sur 14 bougies est moins fort à 13h30 qu'à 12h30.



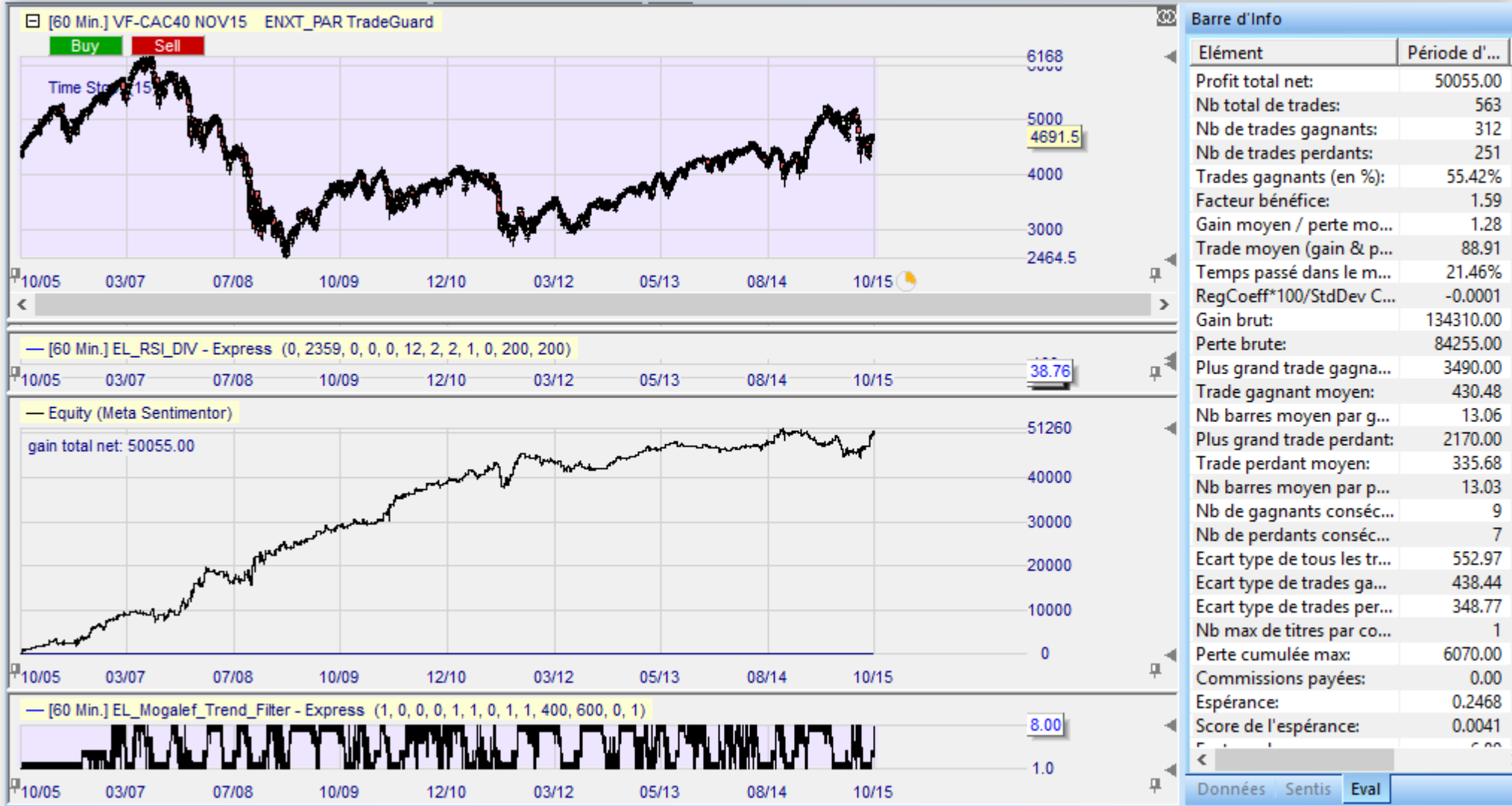
RSI les paramètres de l'indicateur de divergence

- On retrouve les paramètres vus précédemment.
- Le RSI par défaut est le RSI 14.

EL_RSI_DIV - Express	0, 2359, 0, 0, 0,...
StartTime	0
EndTime	2359
MessageBox	0
PlaySound	0
SendEmail	0
RSIlengt	14
smothH	2
smothB	2
ORien1Normales...	1
DifferEntry	0
DistanceMaxH	200
DistancemaxB	200

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Ceci ne reste que peu valable de nos jours.



Elément	Période d'Optimi...
Trade moyen	35.33
Profit total net:	15545.00
Nb total de trades:	440
Nb de trades gagnants:	231
Nb de trades perdants:	209
Trades gagnants (en %):	52.50%
Facteur bénéfice:	1.16
Gain moyen / perte mo...	1.05
Trade moyen (gain & p...	35.33
Temps passé dans le m...	28.53%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0103
Gain brut:	109965.00
Perte brute:	94420.00
Plus grand trade gagna...	4180.00
Trade gagnant moyen:	476.04
Nb barres moyen par g...	18.98
Plus grand trade perda...	2800.00
Trade perdant moyen:	451.77
Nb barres moyen par p...	19.00
Nb de gagnants consé...	12
Nb de perdants consé...	6
Ecart type de tous les tr...	667.51
Ecart type de trades ga...	494.55
Ecart type de trades per...	464.61
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	10515.00
Commissions payées:	0.00
Espérance:	0.0782
Score de l'espérance:	0.0012
Facteur chance:	1.03
Performance / Perte cu...	1.48
Expectative:	35.33
Début de l'évaluation:	26.09.13 Thu 08...
Fin de l'évaluation:	13.12.21 Mon 1...

CCI : index de canal pour matières premières

- Un canal est délimité par les bornes -100 et +100



Le principe du CCI



Le CCI trace un canal autour d'une moyenne mobile simple.

L'écartement de ce canal est de 1 fois et demi la déviation moyenne des cours par rapport à cette moyenne mobile.

La valeur du CCI est de 100 fois l'écartement des cours (l'unité étant la largeur du canal) par rapport à la moyenne mobile.

Un CCI égal à -100 veut donc dire que les cours sont sous la MM et écartés de 1.5 fois la déviation moyenne.

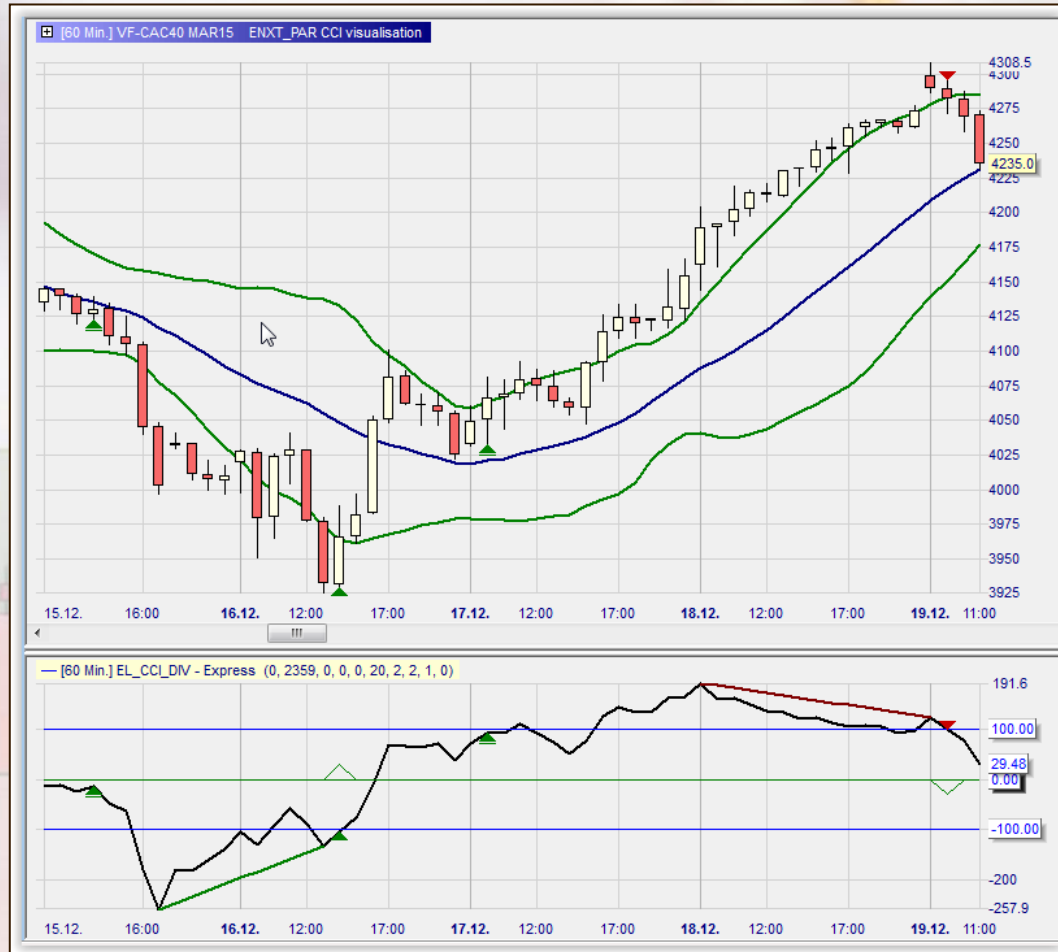
L'aspect du CCI



Le canal de 1.5 fois la déviation moyenne se trouve projeté à plat.

Ce sont les valeurs 100 et -100 du CCI.

Usages habituels du CCI



Sur achat et sur vente

Divergences

CCI les paramètres de l'indicateur de divergence

- On retrouve les paramètres vus précédemment.
- Le CCI par défaut est le CCI 20.

Indicateurs	
EL_CCI_DIV - Express	0, 2359, 0, 0, 0,...
StartTime	0
EndTime	2359
MessageBox	0
PlaySound	0
SendEmail	0
CCIperiod	20
smothH	2
smothB	2
ORien1Normales...	1
DifferEntry	0

- Il est assez difficile de trouver un bon réglage



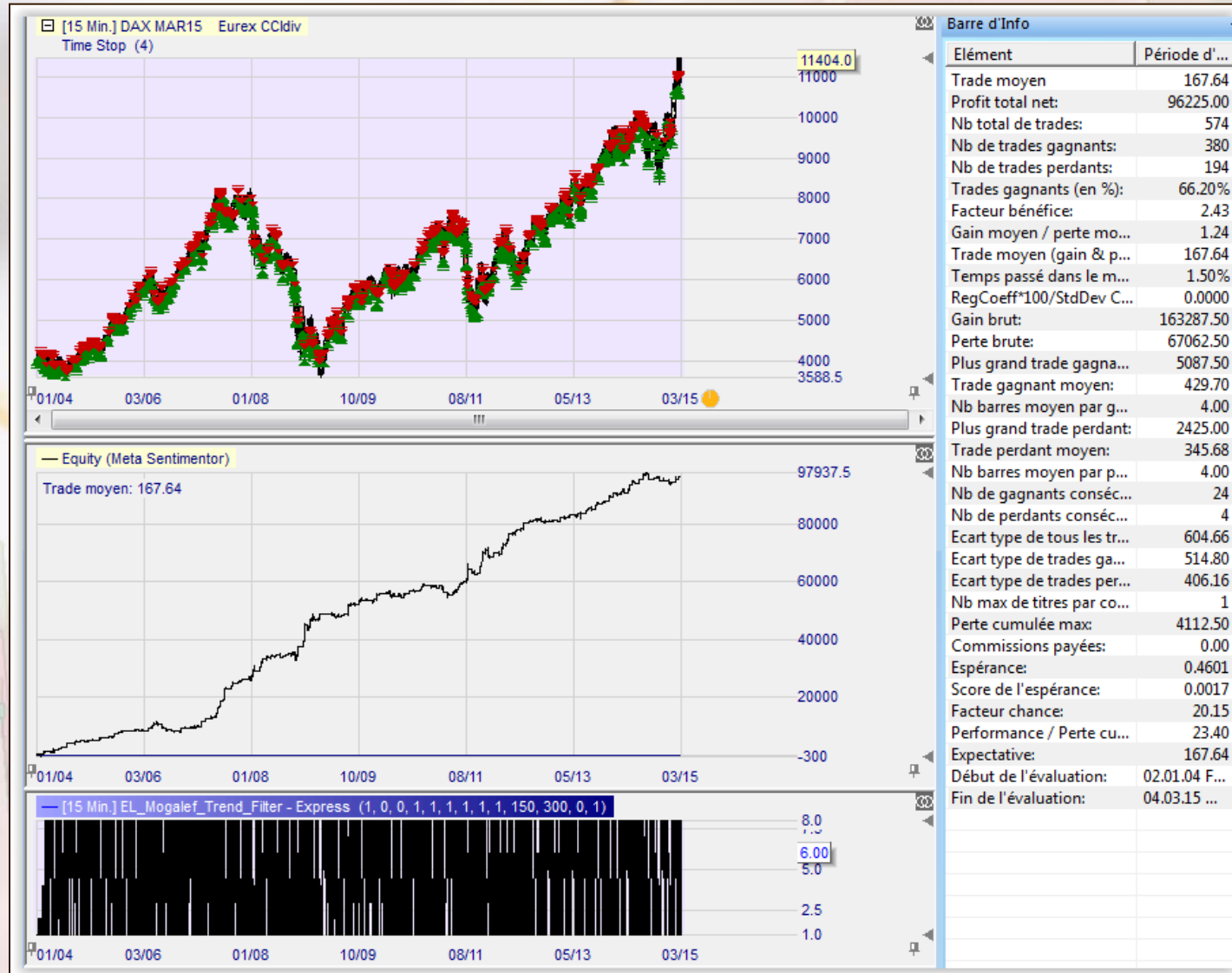
- Il est assez difficile de trouver un bon réglage
- Block 8h – 12h59



- Il est assez difficile de trouver un bon réglage
 - Block 8h – 9h59

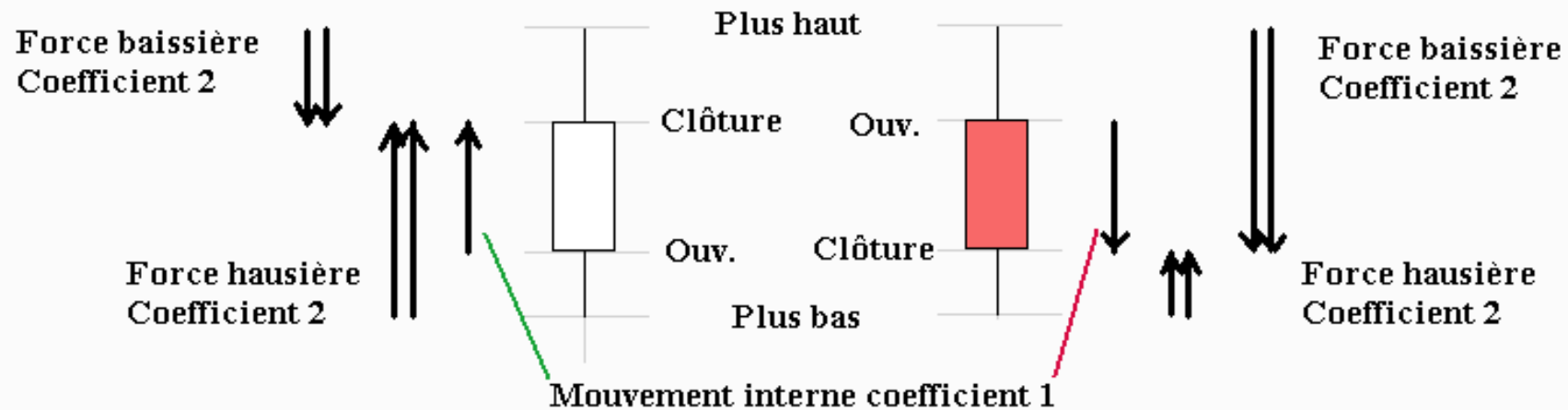


Un filtre sévère sur le DAX 15'



REPULSES : forces de répulsion comparées

**Repulse : 1 fois mouvement interne
+ 2 fois force haussière
+ 2 fois force baissière**



Bougie haussière Bougie baissière

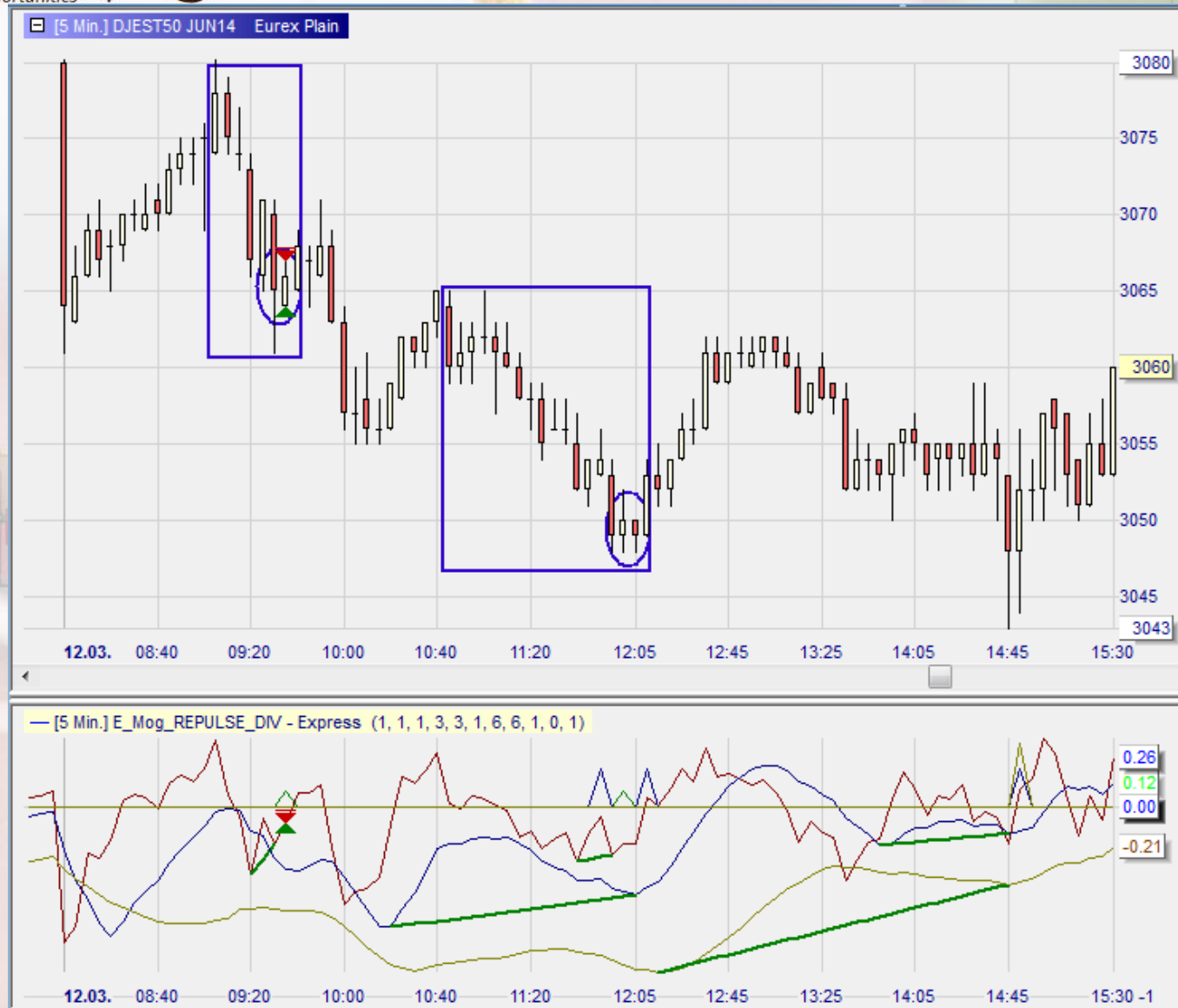
Trois Repulses disponibles avec l'indicateur

- Repulse 1 :
Une bougie
- Repulse 5 :
Cinq bougies
- Repulse 15 :
Quinze bougies



Mogalef Trading

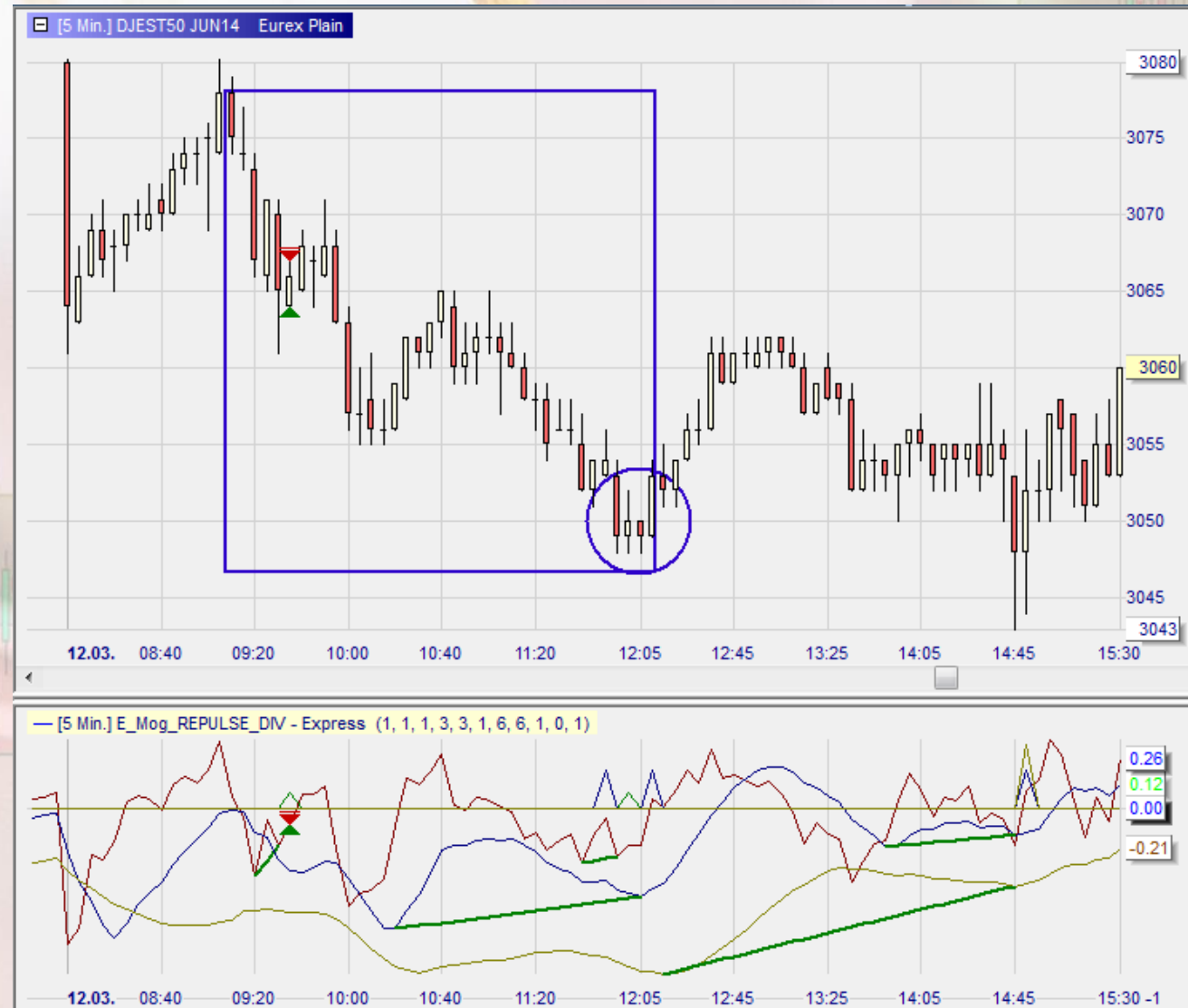
"There's no certitude, only opportunities" V



- Le repulse 1 pour les impulsions.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



- Le repulse 5 pour les oscillations successives.

Mogalef Trading

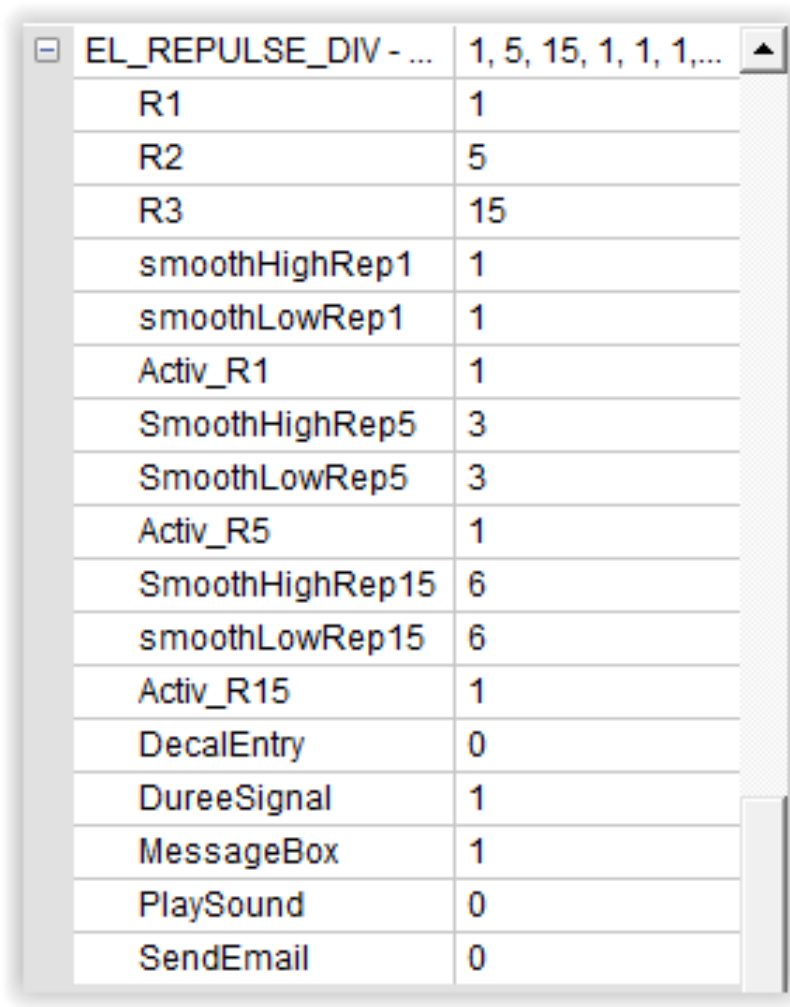
"There's no certitude, only opportunities" V



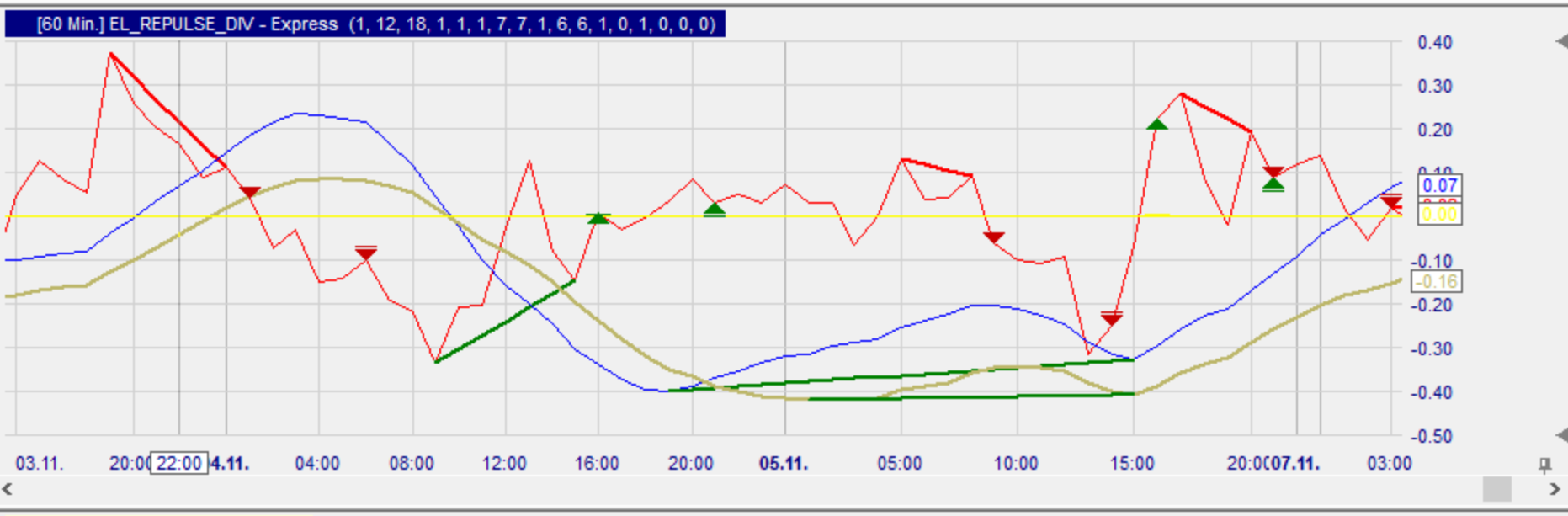
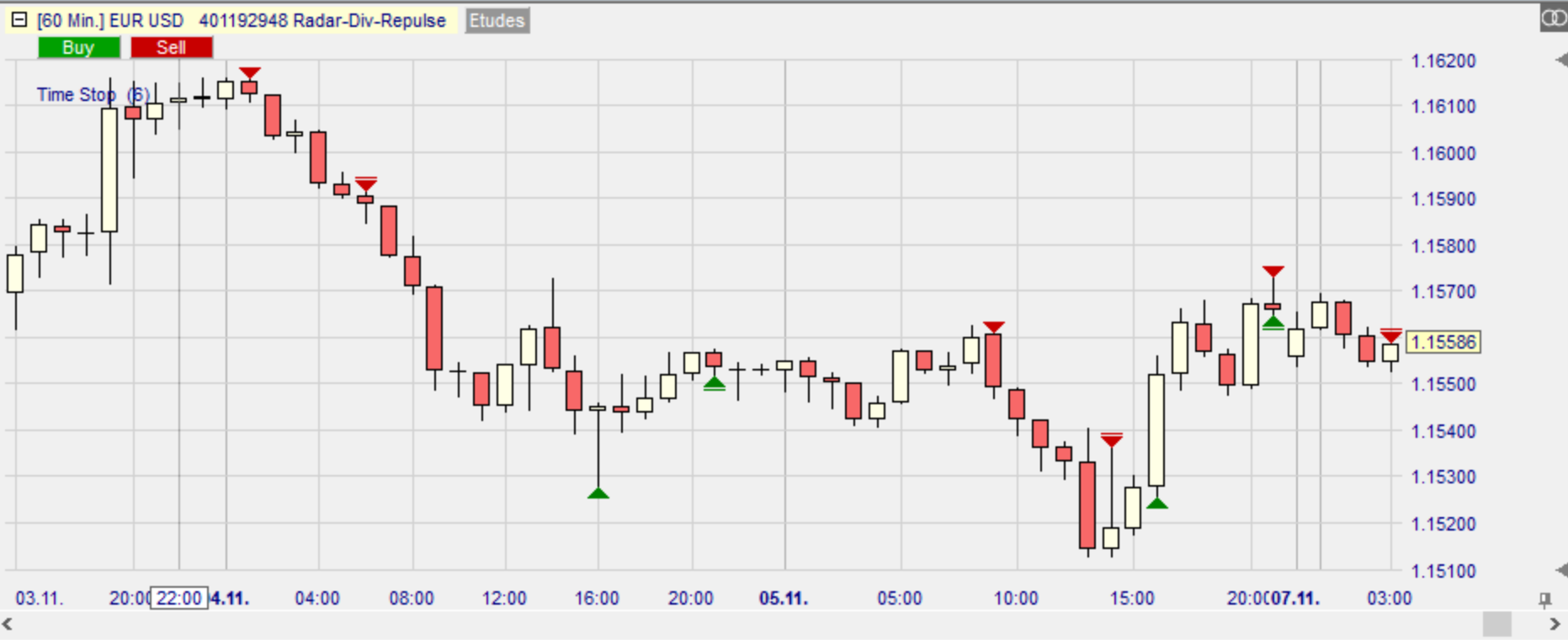
- Le repulse 15 pour la force des mouvements.

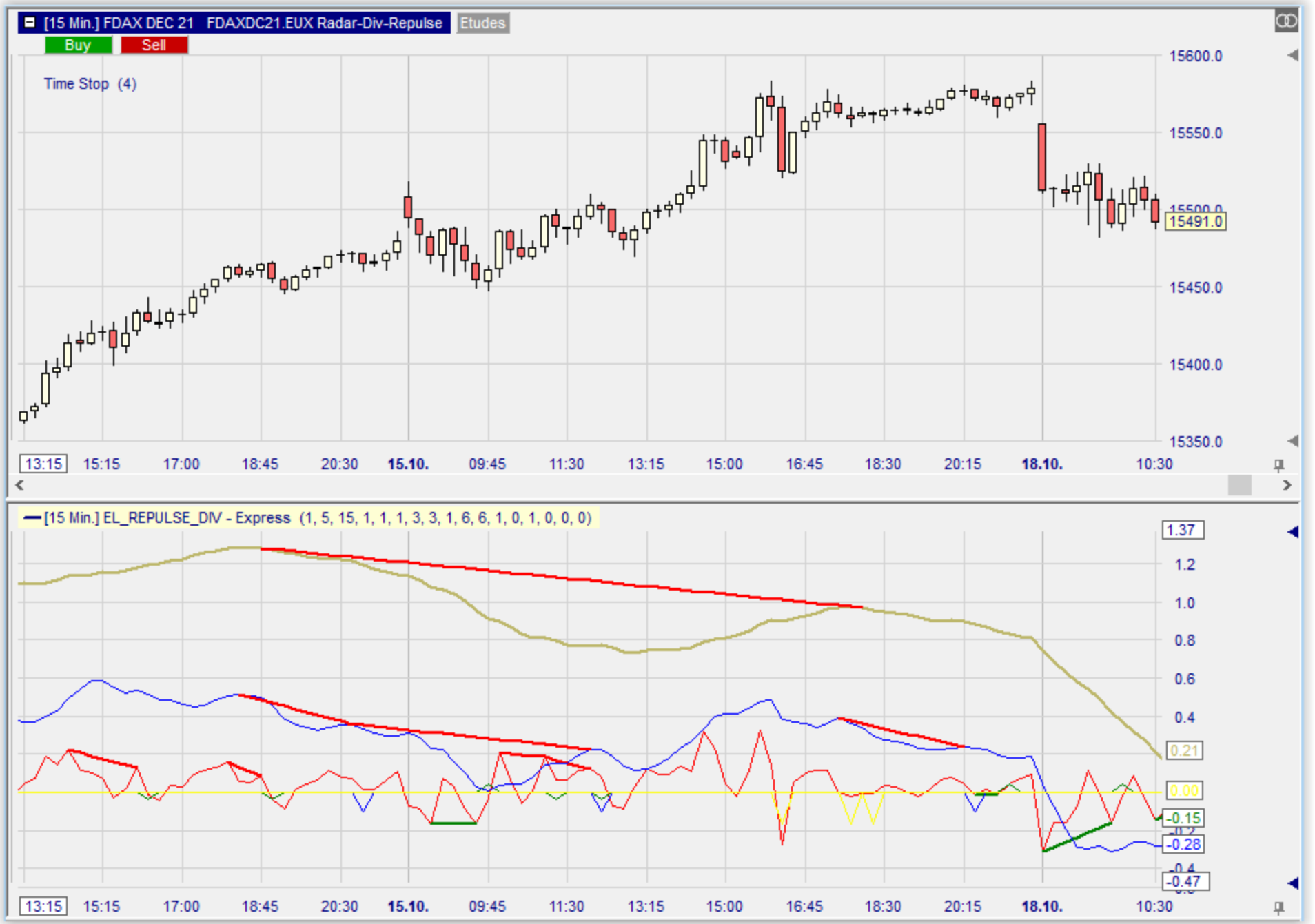
Repulse: les paramètres de l'indicateur de divergence

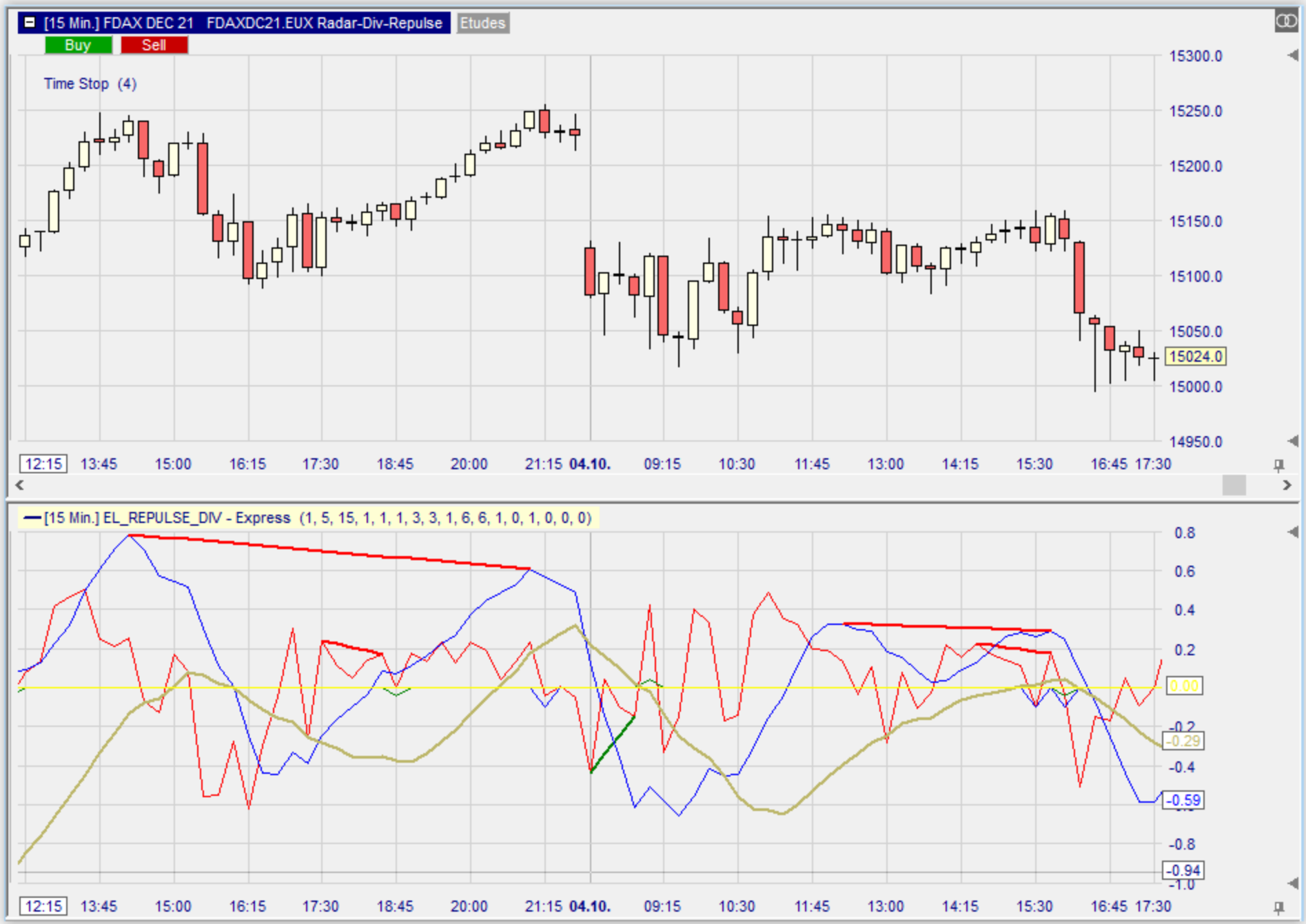
- Les Repulses par défaut sont :
1 5 et 15.
- On retrouve les paramètres habituels mais appliqués aux trois Repulses...

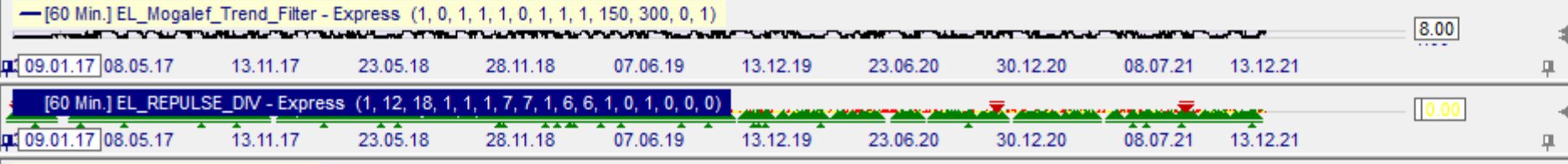
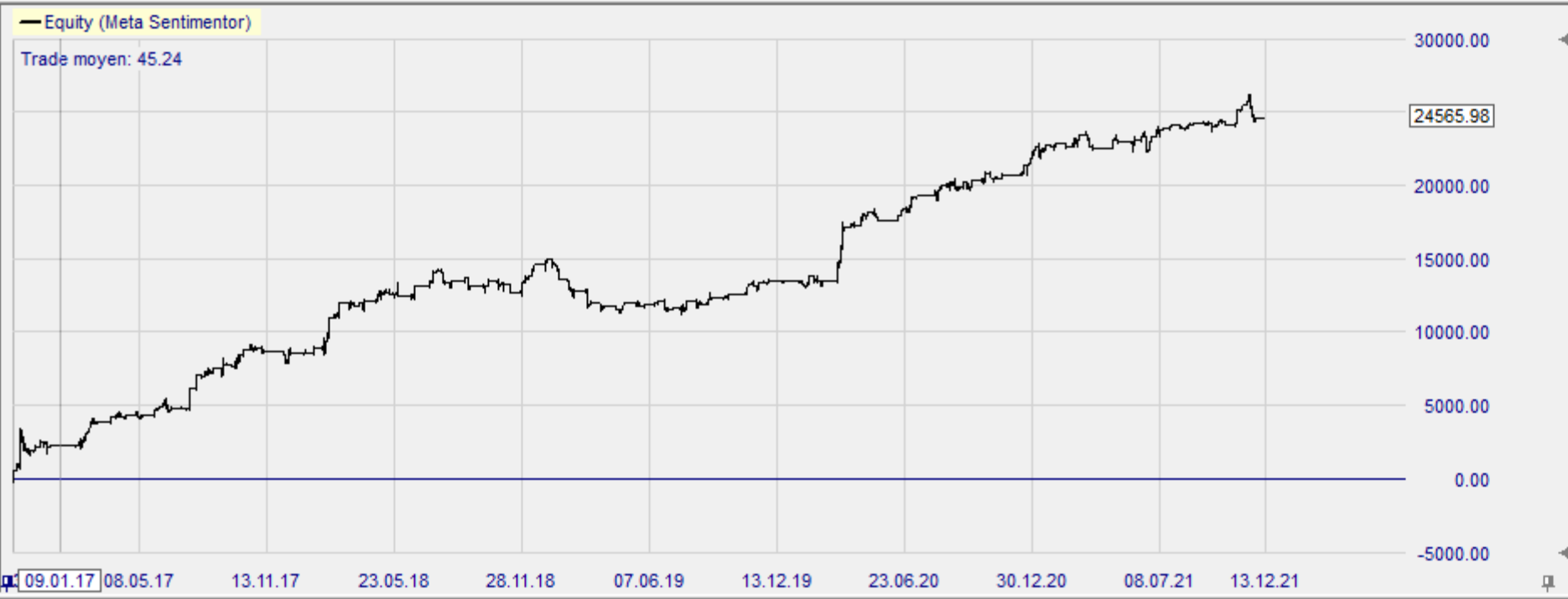
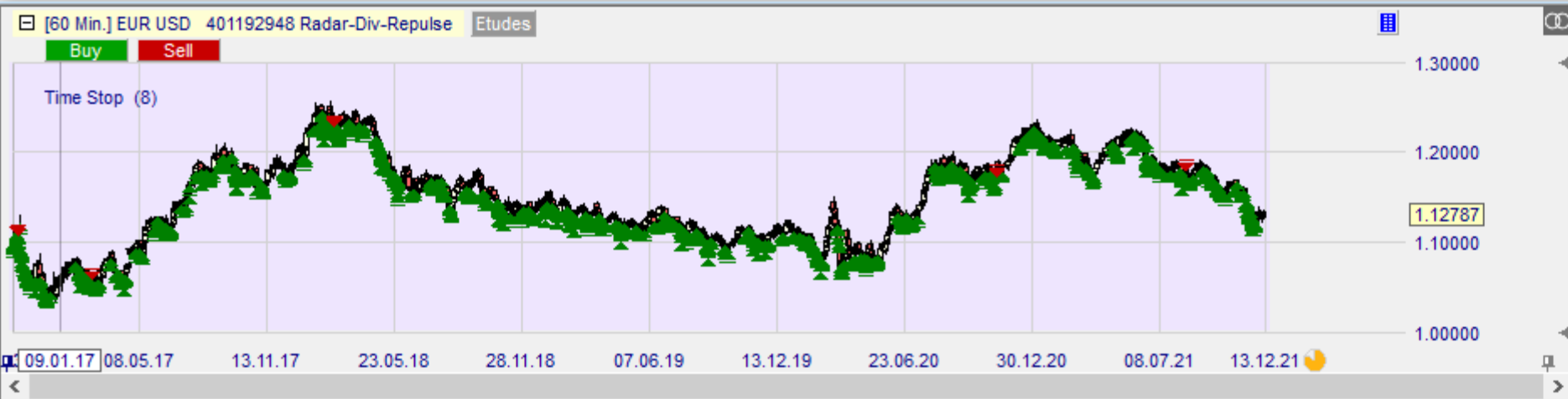


Parameter	Value
EL_REPULSE_DIV - ...	1, 5, 15, 1, 1, 1,...
R1	1
R2	5
R3	15
smoothHighRep1	1
smoothLowRep1	1
Activ_R1	1
SmoothHighRep5	3
SmoothLowRep5	3
Activ_R5	1
SmoothHighRep15	6
smoothLowRep15	6
Activ_R15	1
DecalEntry	0
DureeSignal	1
MessageBox	1
PlaySound	0
SendEmail	0









Barre d'Info

Élément	Période d'Optimi...
Trade moyen	45.24
Profit total net:	24565.98
Nb total de trades:	543
Nb de trades gagnants:	305
Nb de trades perdants:	238
Trades gagnants (en %):	56.17%
Facteur bénéfice:	1.62
Gain moyen / perte mo...	1.27
Trade moyen (gain & p...	45.24
Temps passé dans le m...	11.93%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0104
Gain brut:	63940.08
Perte brute:	39374.10
Plus grand trade gagna...	2024.01
Trade gagnant moyen:	209.64
Nb barres moyen par g...	7.00
Plus grand trade perda...	815.02
Trade perdant moyen:	165.44
Nb barres moyen par p...	7.00
Nb de gagnants consé...	10
Nb de perdants consé...	11
Ecart type de tous les tr...	271.11
Ecart type de trades ga...	220.70
Ecart type de trades per...	162.03
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	3667.09
Commissions payées:	0.00
Espérance:	0.2735
Score de l'espérance:	0.0047
Facteur chance:	6.13
Performance / Perte cu...	6.70
Expectative:	45.24
Début de l'évaluation:	30.10.16 Sun 22...
Fin de l'évaluation:	13.12.21 Mon 1...

Le nouveau paramètre « Durée Signal »

- Permet d'allier les divergences de Repulse avec un autre signal d'entrée.

Ici, la cassure haussière ne provoque un achat que si le Repulse 15 a préalablement été en divergence haussière.



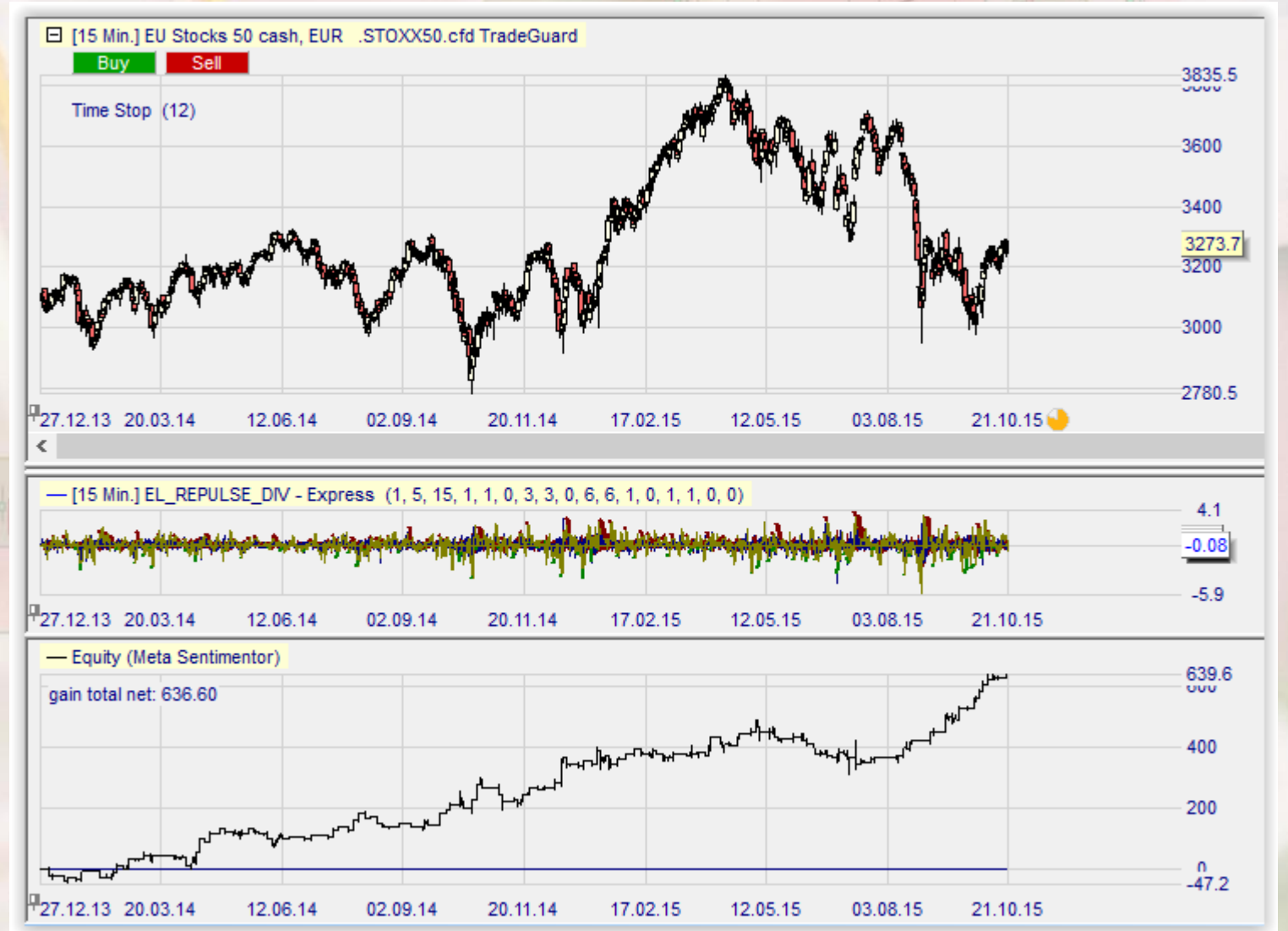
Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

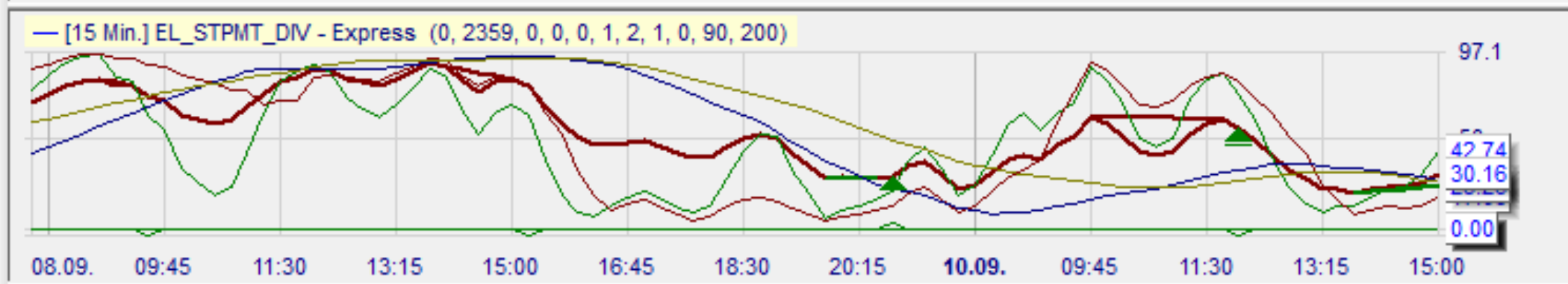
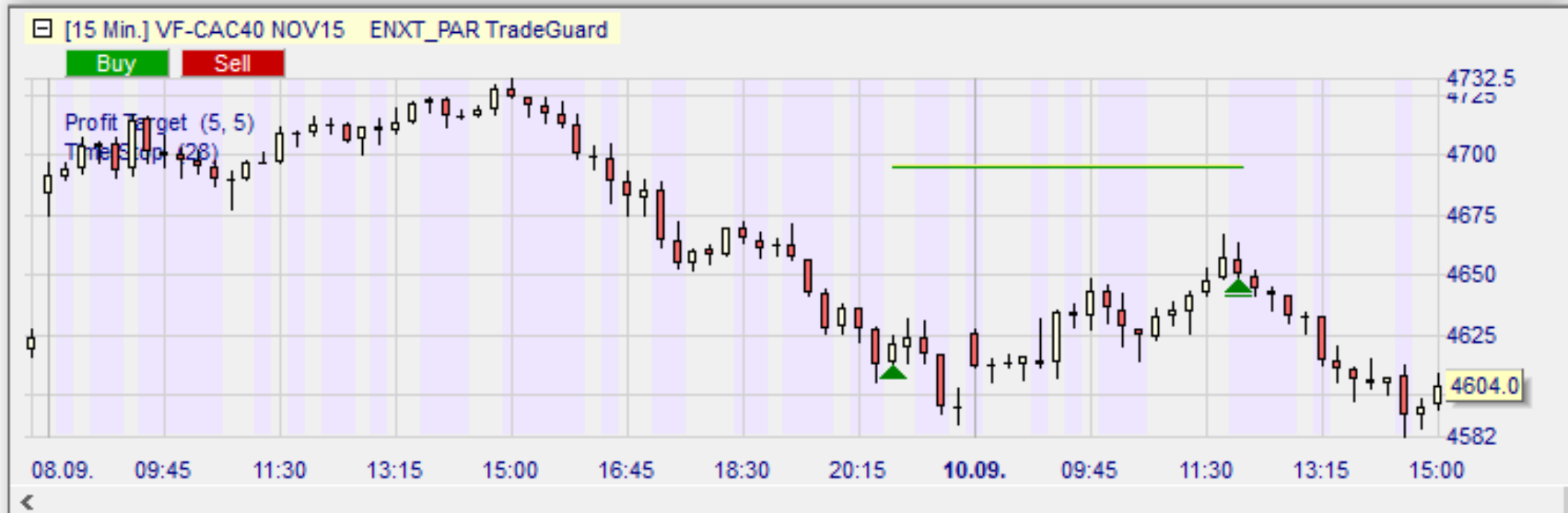
Divergences Repulse15 sur Estx50 en 15 mn

- Avec juste un Time stop de 3 heures

(Cours pris en compte de 8h à 22h)



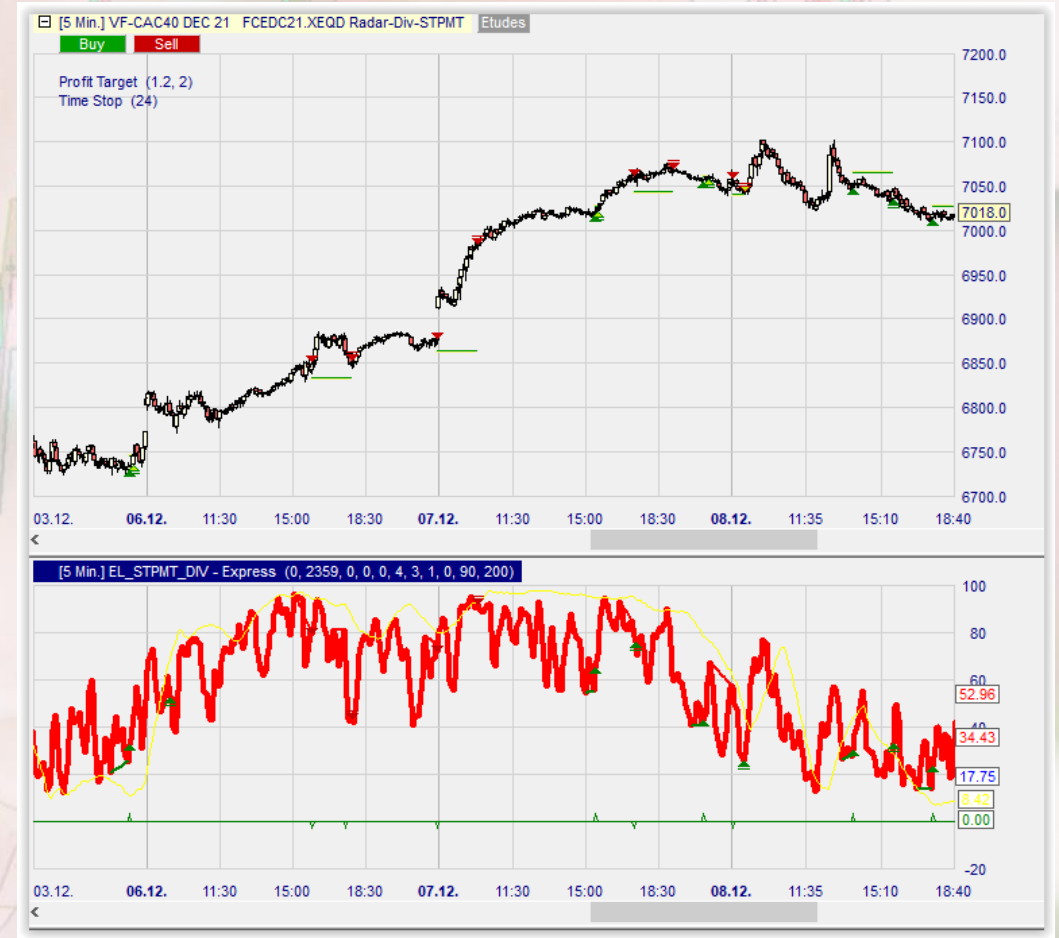
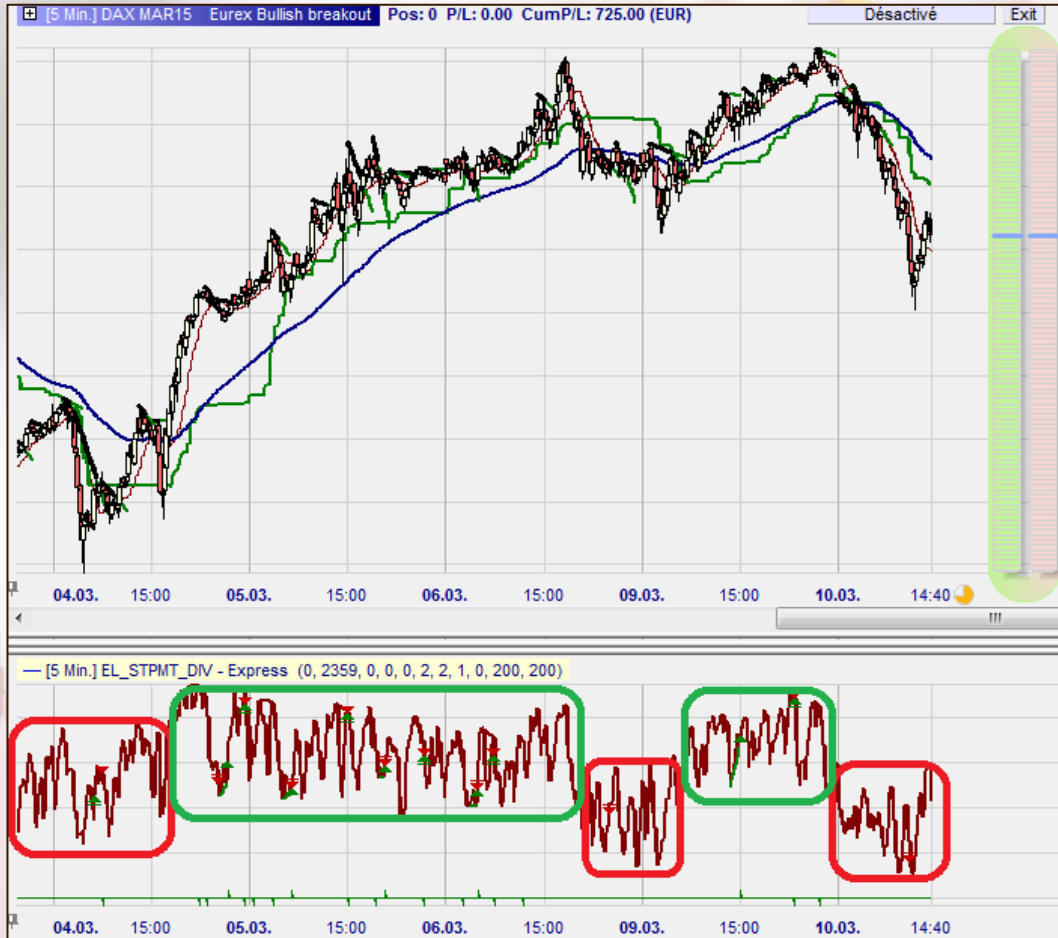
STPMT : stochastique pondérée moyen terme

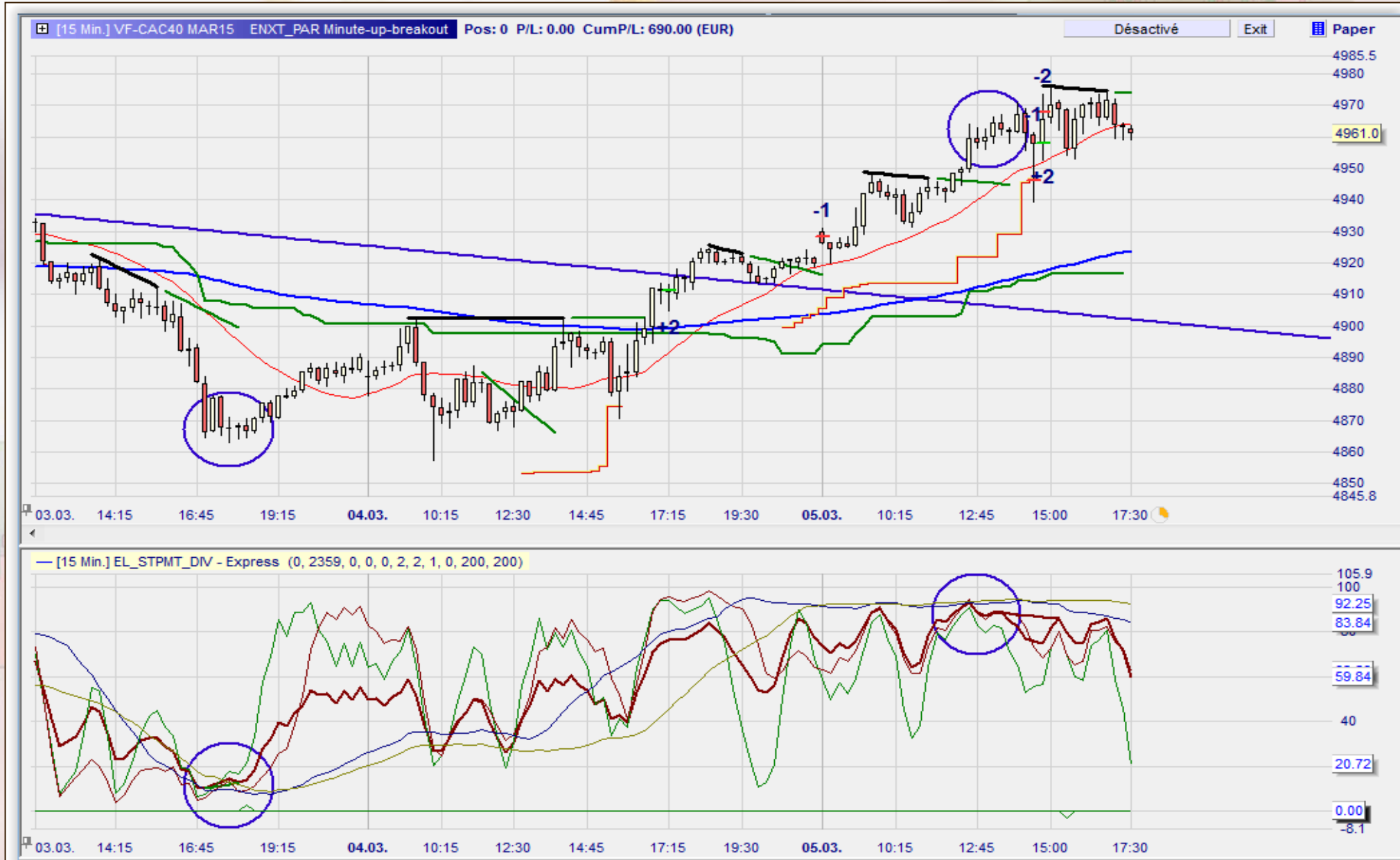


Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

En plus des divergences, indications de tendance





Les paramètres du détecteur de divergence STPMT

EL_STPMT_DIV - Exp...	0, 2359, 0, 0, 0,...
StartTime	0
EndTime	2359
MessageBox	0
PlaySound	0
SendEmail	0
SmoothH	2
SmoothB	2
ONone1Normals...	1
decalentry	0
DistanceMaxH	200
DistancemaxL	200

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Barre de Personnalisation



- Trading
- Brackets
- Boutons Tactiques
- Stop Sentimentors

Time Stop 20

Filtres

<input type="checkbox"/> Block	19:00 - 23:59
<input checked="" type="checkbox"/> Block	00:00 - 16:30
EL_Mogalef_Tre...	0, 1, 1, 0, 0, 0, 1, 1, 1, 4...
BlockCase1	1
BlockCase2	1
BlockCase3	1
BlockCase4	0
BlockCase5	0
BlockCase6	0
BlockCase7	1
BlockCase8	1
R1	1
R2	400
R3	600
TradeOnlyTh...	0
OffOn	1

Indicateurs

Trading	90, 24, 40, 60
Meta Sentimentor	1, 1
EL_STPMT_DIV ...	0, 2359, 0, 0, 0, 2, 2, 2, ...

Paramètres Tradingsystème

Approche de Trading	Future Trading
<input checked="" type="checkbox"/> Graphique Perfo...	
<input checked="" type="checkbox"/> Afficher les contr...	
<input type="checkbox"/> MetaSentimento...	
<input checked="" type="checkbox"/> Entrer Long	
<input checked="" type="checkbox"/> Entrer Short	
Plus de paramètres	

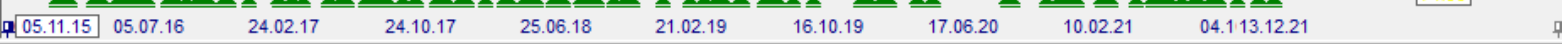
[15 Min.] FDAX DEC 21 FDAXDC21.EUX Radar-Div-STPMT Etudes



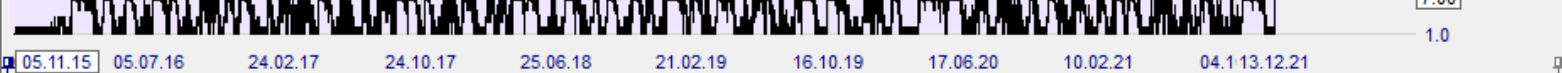
Equity (Meta Sentimentor)



[15 Min.] EL_STPMT_DIV - Express (0, 2359, 0, 0, 0, 2, 2, 2, 0, 50, 50)



[15 Min.] EL_Mogalef_Trend_Filter - Express (1, 1, 1, 0, 0, 0, 1, 1, 1, 400, 600, 0, 1)



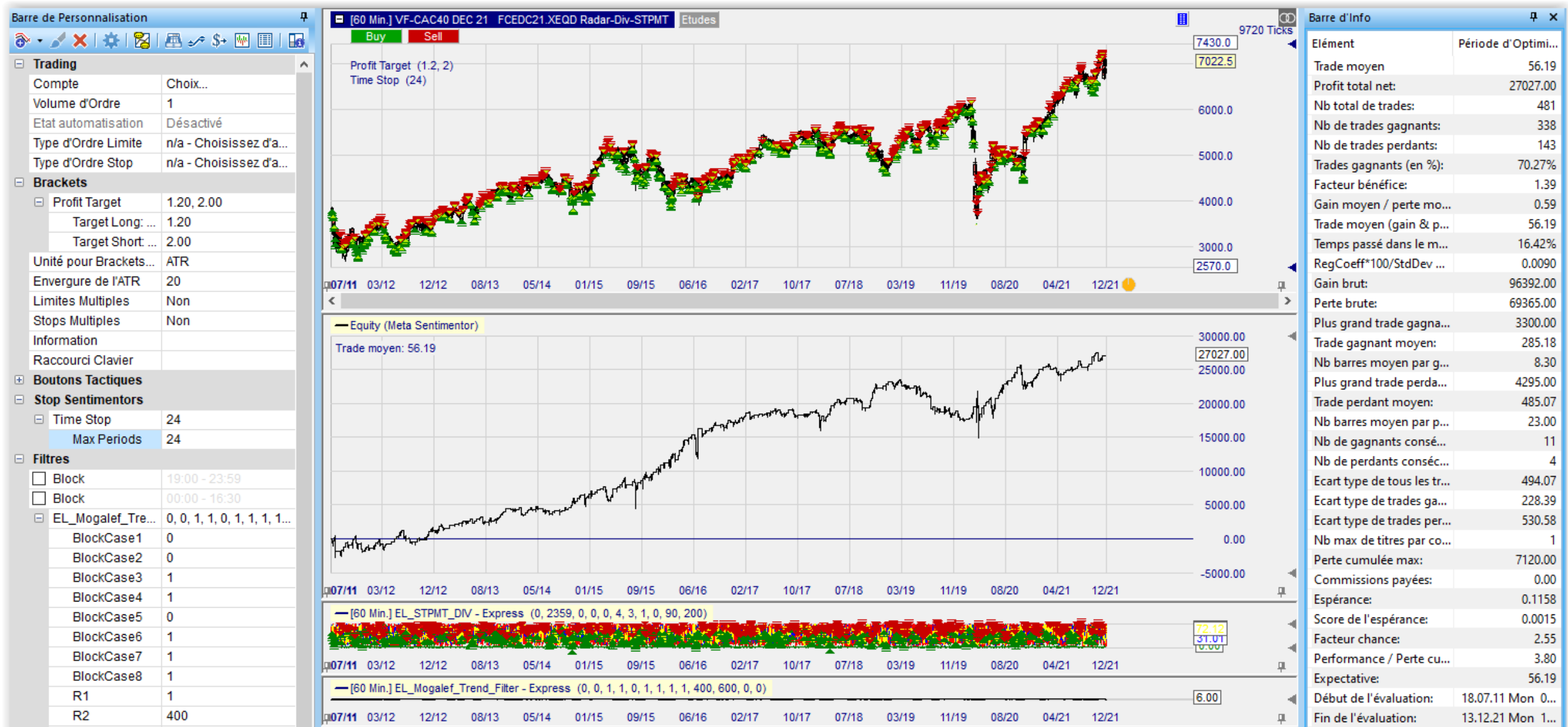
Barre d'Info

Elément	Période d'Optimi...
Trade moyen	396.82
Profit total net:	68650.00
Nb total de trades:	173
Nb de trades gagnants:	95
Nb de trades perdants:	78
Trades gagnants (en %):	54.91%
Facteur bénéfice:	1.74
Gain moyen / perte mo...	1.43
Trade moyen (gain & p...	396.82
Temps passé dans le m...	3.80%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0040
Gain brut:	161350.00
Perte brute:	92700.00
Plus grand trade gagna...	13575.00
Trade gagnant moyen:	1698.42
Nb barres moyen par g...	19.00
Plus grand trade perda...	4450.00
Trade perdant moyen:	1188.46
Nb barres moyen par p...	19.00
Nb de gagnants consé...	6
Nb de perdants consé...	6
Ecart type de tous les tr...	2072.50
Ecart type de trades ga...	1817.19
Ecart type de trades per...	963.02
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	7537.50
Commissions payées:	0.00
Espérance:	0.3339
Score de l'espérance:	0.0007
Facteur chance:	4.67
Performance / Perte cu...	9.11
Expectative:	396.82
Début de l'évaluation:	05.11.15 Thu 08...
Fin de l'évaluation:	13.12.21 Mon 0...

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" ∨

- 60' sans filtre



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



- 60' sans filtre

Elément	Période d'...
pourcentage profitable	70.26%
Profit total net:	31955.00
Nb total de trades:	491
Nb de trades gagnants:	345
Nb de trades perdants:	146
Trades gagnants (en %):	70.26%
Facteur bénéfice:	1.49
Gain moyen / perte mo...	0.63
Trade moyen (gain & p...	65.08
Temps passé dans le m...	15.79%
RegCoeff*100/StdDev C...	-0.0000
Gain brut:	96535.00
Perte brute:	64580.00
Plus grand trade gagna...	1830.00
Trade gagnant moyen:	279.81
Nb barres moyen par g...	8.08
Plus grand trade perdant:	2085.00
Trade perdant moyen:	442.33
Nb barres moyen par p...	21.53
Nb de gagnants consé...	12
Nb de perdants consé...	7
Ecart type de tous les tr...	420.96
Ecart type de trades ga...	180.10
Ecart type de trades per...	391.09
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	4765.00
Commissions payées:	0.00
Espérance:	0.1390
Score de l'espérance:	0.0018
Facteur chance:	5.50
Performance / Perte cu...	6.71
Expectative:	65.08
Début de l'évaluation:	02.01.04 F...
Fin de l'évaluation:	09.03.15 ...