

Systeme de scalping sur DAX

Présenté par Eric Lefort de Mogalef-Trading.com

En collaboration avec WH Selfinvest

Mot de passe pour le PDF : Polaire

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Les impératifs du scalping

- Fort pourcentage de réussite.
- Forte exposition pour compenser au mieux les frais.



Trading	
Compte	1550045
Volume d'Ordre	40
Etat automatisation	Désactivé
Type d'Ordre Limite	Limit
Type d'Ordre Stop	Stop

Les conséquences

- Les tests seront faits pour 10 CFD Dax. Il vous faudra donc un capital minimum de 8000€ pour arriver à cette taille de position.
- Si vous êtes sur Futures, il vous faudra AU MINIMUM 4000€ pour opérer avec deux mini Dax (5€ le point), et 10000€ pour un « gros » Dax (25€ le point).

Trading	
Compte	Paper
Volume d'Ordre	10
Etat automatisation	Désactivé
Type d'Ordre Limite	Limit
Type d'Ordre Stop	Stop

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Problème de mesure d'efficacité

- Beaucoup de systèmes empiriques
- Impossibilité d'estimer l'efficacité



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

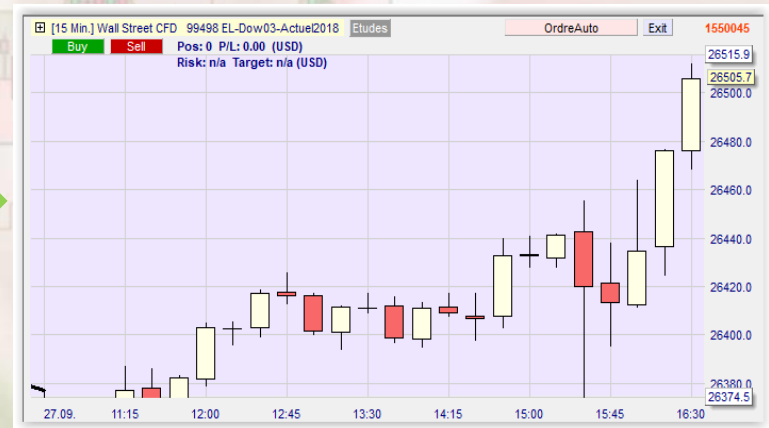
Résultats des systèmes vérifiables

- La plupart des méthodes de scalping vont chercher des configurations sur de petites unités de temps ou cherchent à exploiter de petits mouvements.
- Les trades sont souvent filtrés en fonction d'une unité de temps supérieure ou d'un contexte plus large.



L'idée d'inversion du raisonnement

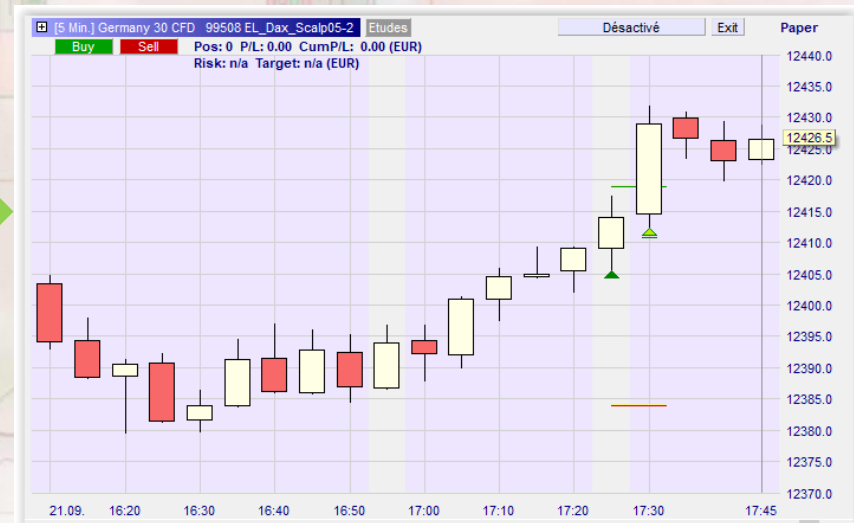
- Au lieu de partir de l'UT la plus petite et de filtrer en fonction d'une vue plus large...



- Et si l'on partait avec un signal sur vue plus large (30mn par exemple) pour profiter de l'élan en scalpant sur une UT plus petite (5mn par exemple)?

Base du système

- On se repose sur la cassure haussière en 30 mn pour donner le signal d'entrée en scalp sur le 5mn.
- C'est donc un signal d'achat fort sur le 30 minutes qui va déclencher le scalp sur le 5 minutes.



On utilise le signal de cassure haussière sur le 30 mn

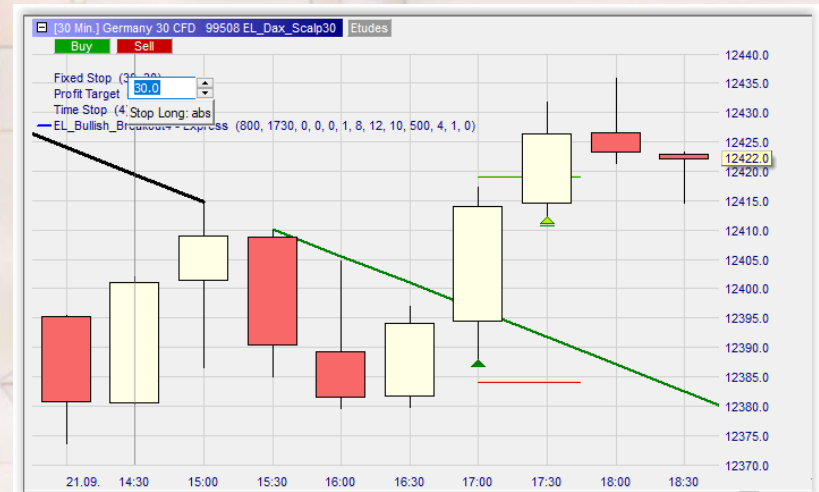
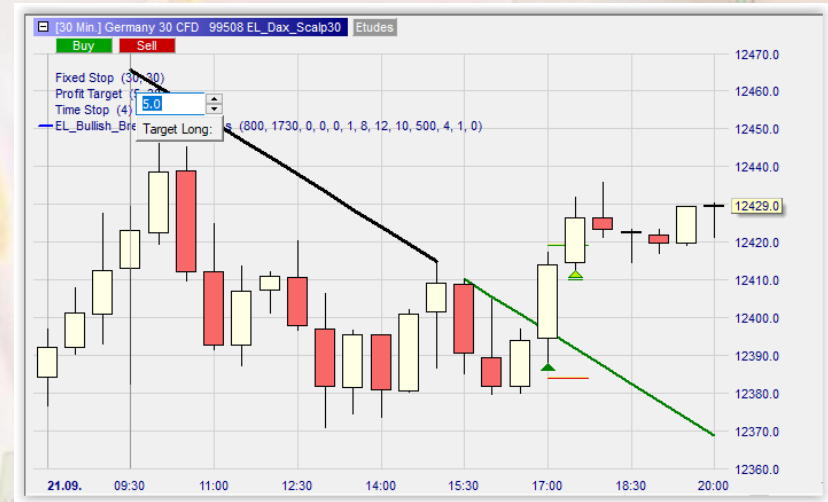
- Ce signal est particulièrement efficace pour les trades de longue durée (travail de tendances).
- On cherchera à profiter de l'élan pour trader un court mouvement.

EL_Bullish_Breakout4 - Express 30.	
StartTime	759
EndTime	1730
SendEmail	0
PlaySound	0
MessageBox	0
Smooth	1
Mini	8
Maxi	12
Prolong	10
MaxHighInclination	500
MinHighInclination	4
EntryStrategy	1
DifferEntry	0



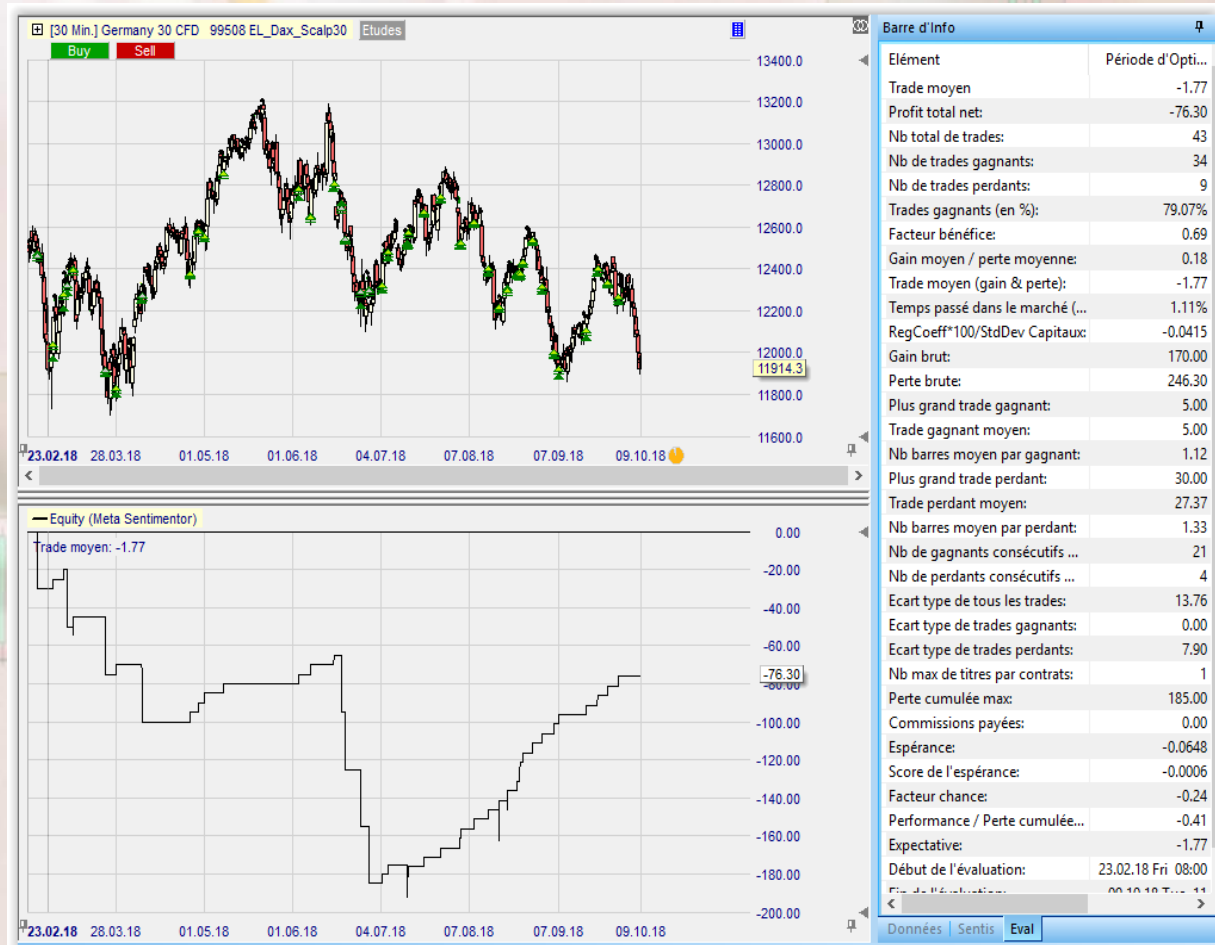
Objectif et stop-loss

- L'objectif doit être proche pour rechercher un très gros pourcentage de réussite.
- Un stop de sécurité est nécessaire. Il doit être placé relativement loin pour ne pas se déclencher trop souvent et ainsi faire baisser le pourcentage de réussite.



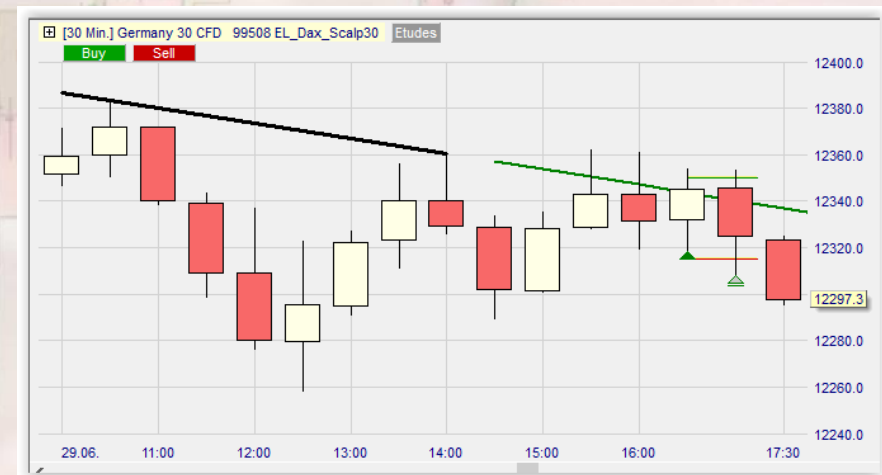
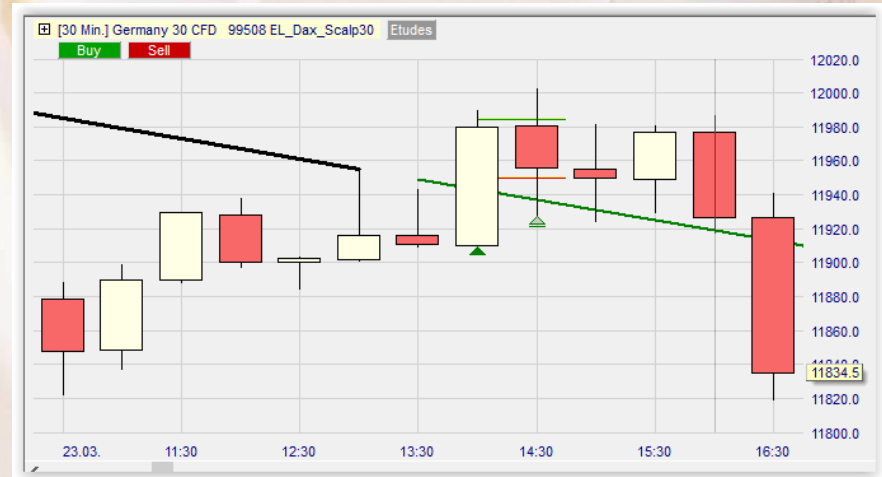
Résultat de test sur le 30 minutes

- La stratégie sur le 30mn semble perdante !



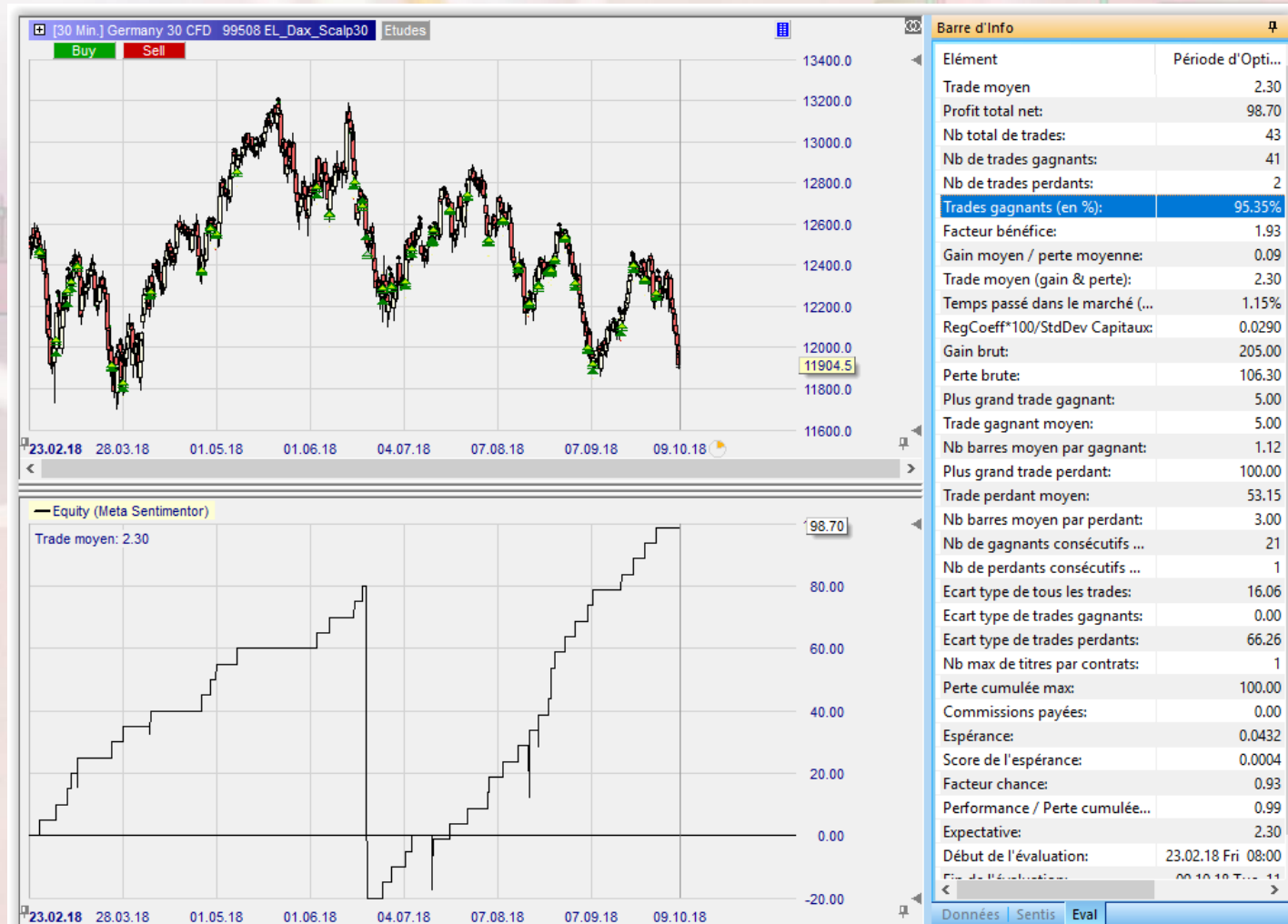
Mais examinons le détail des trades

- Beaucoup de trades considérés comme perdants sur la plateforme ont peut-être en fait été gagnants !



Élargissons le stop sur le 30mn à 100 points pour avoir une meilleure idée du pourcentage de trades gagnants.

- On obtient un pourcentage de 95%.
- Néanmoins, le stop trop éloigné ne permet pas un scalping efficace.
- C'est pourquoi il est nécessaire de descendre sur une UT inférieure.
- Nous essaierons avec le 5mn.

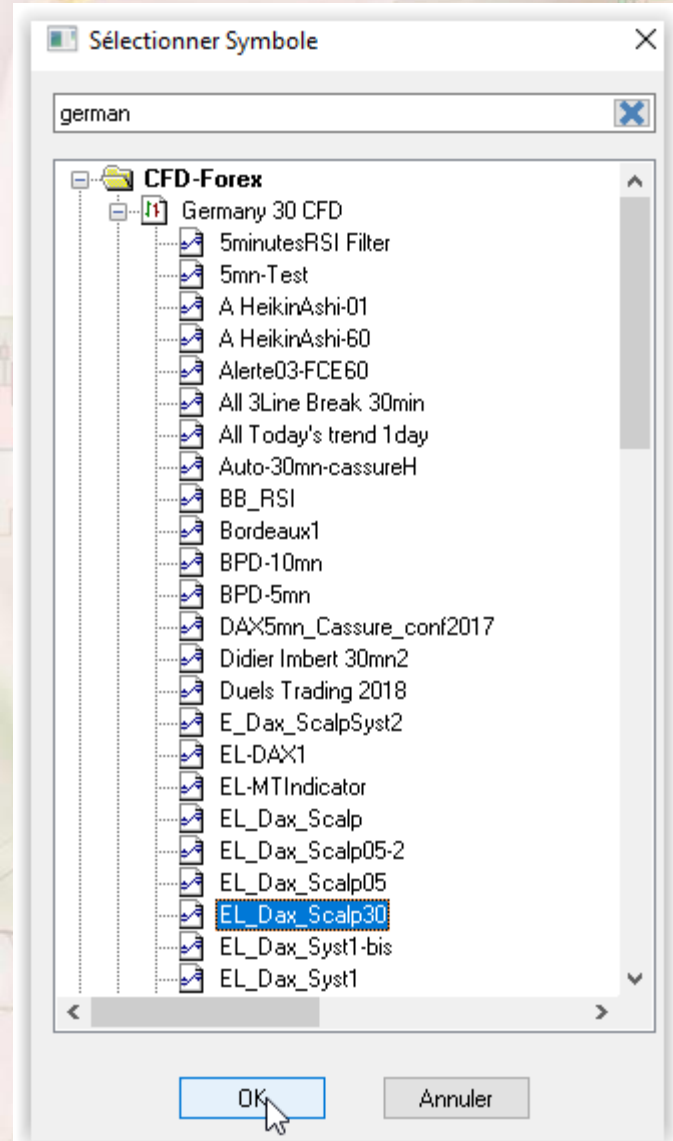
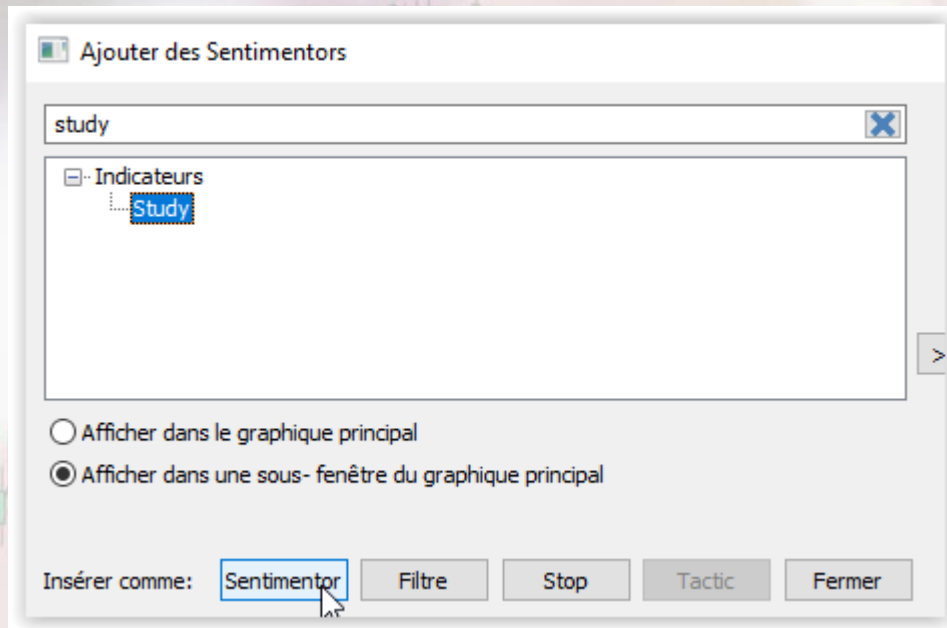


Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Sur le graphe 5 minutes

- On insère les signaux du 30 minutes



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- On fixe l'objectif à 5 points
- On inclue un stop de sécurité à 30 points. Cet éloignement sera sans doute au moins nécessaire pour ne pas faire baisser le pourcentage de réussite.
- On ajoute un TimeStop de 10 périodes pour ne pas rester trop longtemps en position.

The screenshot shows a 'Barre de Personnalisation' (Customization Bar) in a trading software interface. The bar is divided into several sections, each with a list of settings and their values.

Trading	
Compte	1550045
Volume d'Ordre	10
Etat automatisation	Désactivé
Type d'Ordre Limite	Limit
Type d'Ordre Stop	Stop

Brackets	
Profit Target	5, 30
Fixed Stop	30, 30
Unité pour Brackets etc.	Points
Envergure de l'ATR	20
Limites Multiples	Non
Stops Multiples	Non
Information	
Raccourci Clavier	

Boutons Tactiques	
Stop Sentimentors	
Time Stop	10

Filtres	
Indicateurs	
Trading	76, 24, 40, 60
Meta Sentimentor	1, 1
Smoothness-Span	1
Study 'Germany 3...	1
Study 'Germany 30 C...	1, 0

Effets du signal 30mn sur le 5mn

- Ce signal peut éventuellement déboucher sur une « rafale » de trades pendant 30 mn.
- Il faudra voir s'il est rentable de conserver ces « rafales » ou s'il ne faut tenir compte du signal qu'au début de la demi-heure.



Filtres pour éliminer les rafales

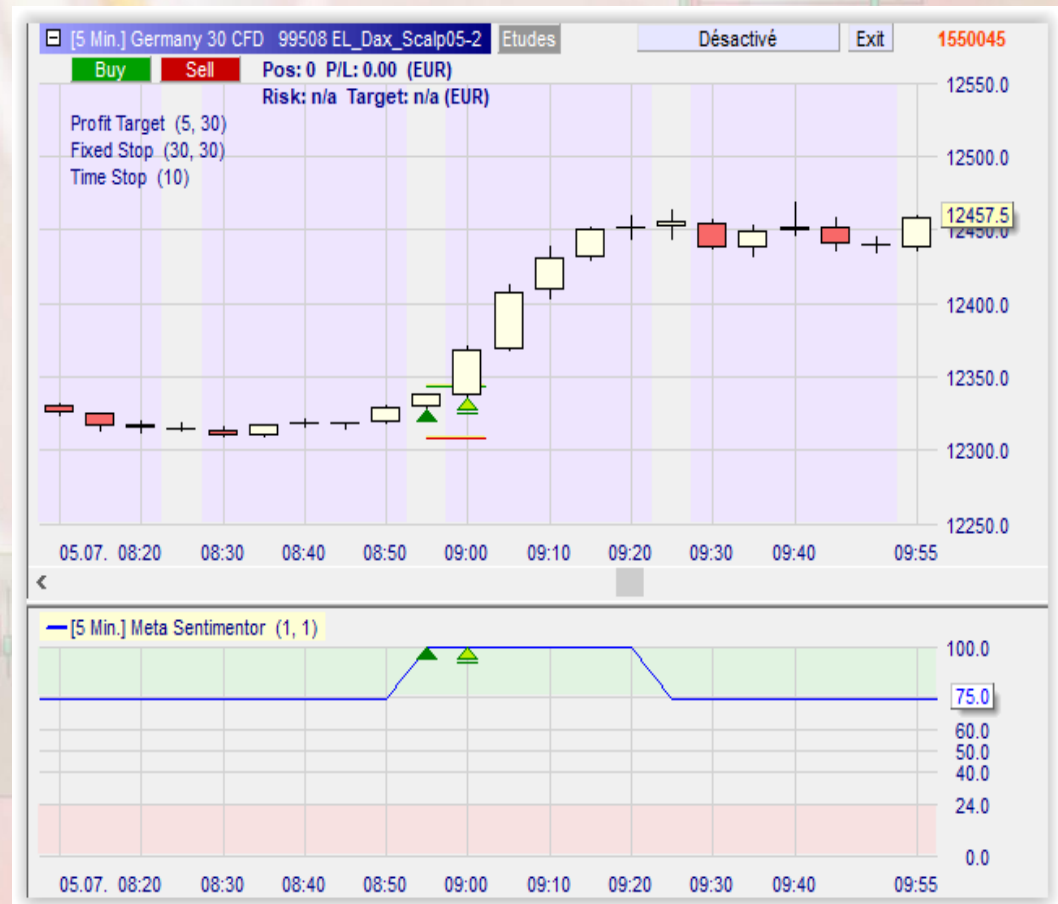
Barre de Personnalisation

Filtres

<input checked="" type="checkbox"/>	Block	09:02 - 09:28
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	09:32 - 09:58
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	10:02 - 10:28
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	10:32 - 10:58
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	11:02 - 11:28
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	12:02 - 12:28
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	12:32 - 12:58
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	13:02 - 13:58
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	14:02 - 14:28
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	15:02 - 15:28
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	16:02 - 16:28
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	17:02 - 17:28
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	17:32 - 17:58
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	18:02 - 23:59
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	14:32 - 14:58
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	00:00 - 07:59
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	16:32 - 16:58
<input type="checkbox"/>	EL_Mogalef_Trend_F...	1, 0, 0, 0, 0, 0, ...
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	08:02 - 08:28
<input checked="" type="checkbox"/>	Block	08:32 - 08:58

Indicateurs

<input type="checkbox"/>	Trading	76, 24, 40, 60
<input type="checkbox"/>	Meta Sentimentor	1, 1



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Premier résultat, frais inclus, sans le mode « rafale »



Quand laisser ou bloquer le mode « rafale »

- Les tests montrent que le mode « rafale » n'est vraiment profitable qu'entre 8h et 10h. Au-delà il vaut mieux se limiter à des entrées possibles uniquement toutes les demi-heures.
- Ceci veut dire que le temps de propagation (court terme) des signaux de cassure en 30mn est fort avant 10h et faible après 10h.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Résultats en présence du mode « rafale » entre 8h et 10h



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" √

Filtrage au niveau du 5mn



- On filtre la tendance au niveau du 5mn pour éliminer les signaux quand la pression est fortement baissière.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Est-il possible de faire mieux?

- Oui en terme de % mais pas en terme de gain total, en éliminant les signaux qui ont lieu lors de ranges en 30mn :



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" ∨

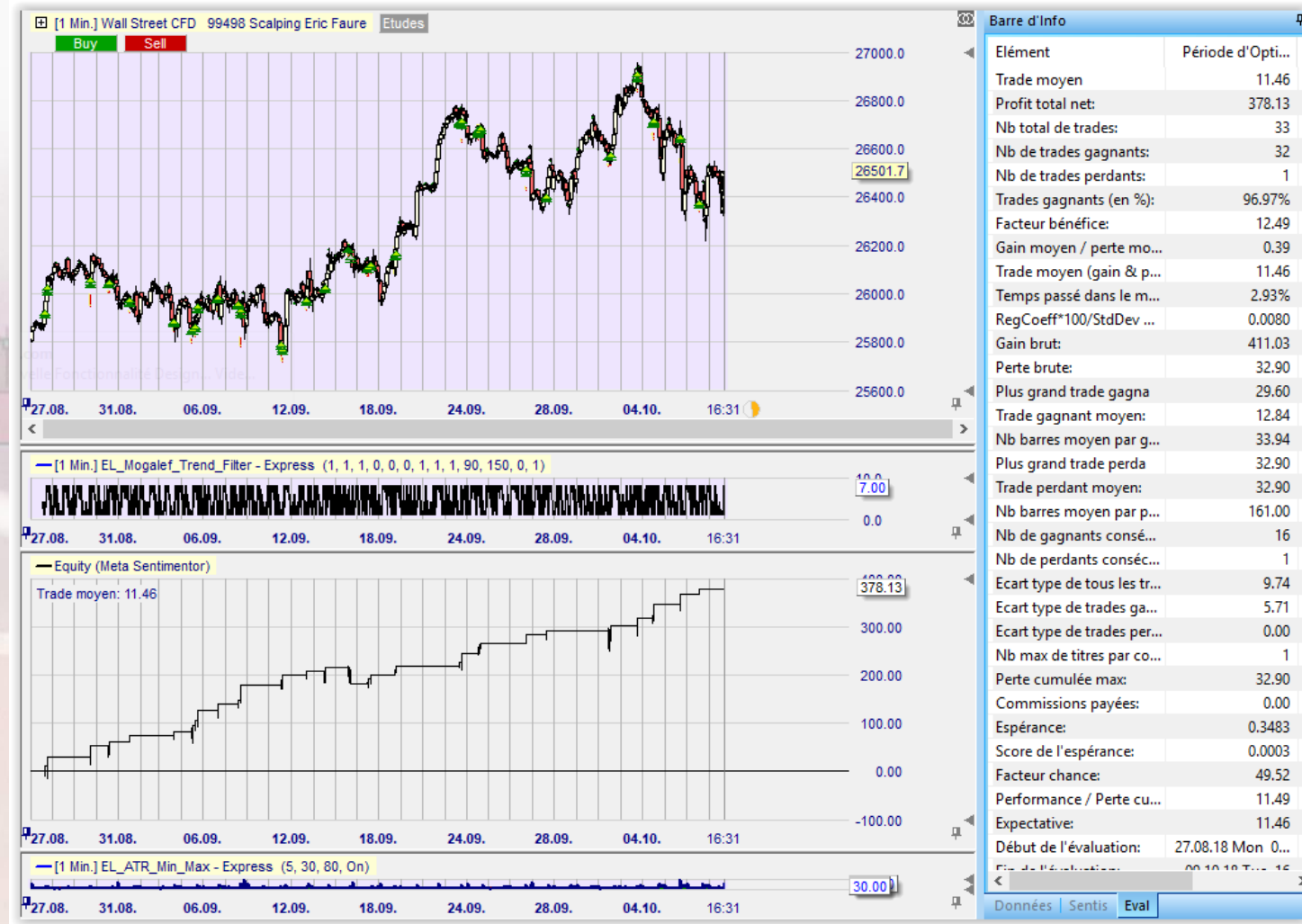
Ce qui donne, sur le 5mn :



Conclusion

- La méthode qui consiste à trader des signaux sur le 30mn avec un réel suivi sur le 5mn semble très favorable.
- Un léger filtrage des trades sur le 5mn (cas 1 sur 8 cas possibles) supprime les gros trades perdants.
- Un filtrage des périodes de range sur le 30mn filtre la totalité des trades perdants mais ne semble pas nécessaire.
- Un suivi « à blanc » sur quelques mois pourrait apporter une sécurité supplémentaire.

- Un système de scalping sur le DJ imaginé par un membre du club Mogalef. (Je ne peux pas vous en donner le détail faute d'autorisation de l'auteur).
- Ici on est descendu sur le 1mn pour l'exécution et on utilise un filtre de volatilité prochainement inclus dans le pack Mogalef.



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Principe du filtre ATR

- Quand on a un objectif en nombre d'ATR on ne maîtrise pas la distance réelle en points de cet objectif.
- Ici on détermine :
- - La valeur minimum (en dixièmes de points) de l'ATR en dessous de laquelle le trade sera filtré (ne sera pas pris). En effet, un objectif trop proche peut rendre un trade neutre ou même perdant à cause du coût de transaction.
- - La valeur maximum (en dixièmes de points) de l'ATR au-dessus de laquelle le trade sera filtré. En effet, un objectif trop éloigné peut être impossible ou très difficile à atteindre.
- Quand on a un stop en nombre d'ATR on ne maîtrise pas la distance réelle en points de ce stop.
- Ici on détermine :
- - La valeur maximum (en dixièmes de points) de l'ATR au-dessus de laquelle le trade sera filtré. Ainsi on maîtrise le risque en imposant une limite maximum en nombre de points (valeur maximum x nombre d'ATR du stop).
- L'usage de ce filtre permet donc, par exemple, simultanément d'adapter son risque à son portefeuille et d'éliminer les trades pas assez gagnants pour être rentables. C'est une sécurité de très grande valeur.



Pour réduire le spread sur CFD

- Pour le graphe 5mn (mais pas sur le graphe 30mn!) pensez à utiliser tous les jours le Germany 30 Tages

Accueil < Clients

◦ TABLEAUX DES INSTRUMENTS

Indices de Marchés (cash) ▼

	Spread (en points)	Marge *	Tick	Valeur du tick	Devise	Stop garanti	Heure (CET)
Australia 200	1 (5)	5%	1	1	AUD	No	24h with breaks
China A50	as low as 10	10%	1	1	USD	No	24h with breaks
EU Stoxx 50	2	5%	1	1	EUR	No	08.00 - 22.00
France 40	1 (1,5) (6)	5%	0,1	0,1	EUR	Yes	08.00 - 22.00
Germany 30	1 (2) (6)	5%	0,1	0,1	EUR	Yes	00.00 - 23.00 except Fridays till 22.15
Germany 30 Mini	1 (2) (6)	5%	0,1	0,01	EUR	Yes	00.00 - 23.00 except Fridays till 22.15
Germany 30 Tages	0,8	5%	0,1	0,1	EUR	Yes	08.00-22.00 daily expiration

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" ∇

