

Trader la cassure haussière en automatique ou en discrétionnaire

Présenté par Eric Lefort de Mogalef-Trading.com
En collaboration avec WHSelfinvest

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

Le PDF de la conférence est disponible au bas de cette page :

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 2017
Conférences WHSelfinvest 2016
Conférence Salon AT 2016
Conférences SALON AT 2015
Conférences SALON DU TRADING 2014

Trading system Breakout for Germany 30

Eric Lefort, 2017 June the 19.

This trading system is using the natural markets characteristic : uptrends are more frequent and longer than downtrends. "Bullish Breakout" is the signal. It's completed by the trailing stop "Stop Intelligent".

This system is succesfully used by the author since more than 6 months. Sometime neutral periods are accounted, but it takes advantage of the strong bullish periods.

Acces to the trading system  

Germany 30 CFD: 99500 RSI-02

Subscriptions to Mogalef Club are for 1, 3 or 12 months

25% OFF (for 12 months subscription)

SUBSCRIBE NOW!

New : **FREE** three months Trading Systems and **FREE** three months Tools and Indicators for all account opened HERE.



Paramètres StartLine	
total	max
100	10

Niveau d'évaluation	
31	1710 000
100	209

Equity (Meta Sentiment)	
Trade moyen	33.52

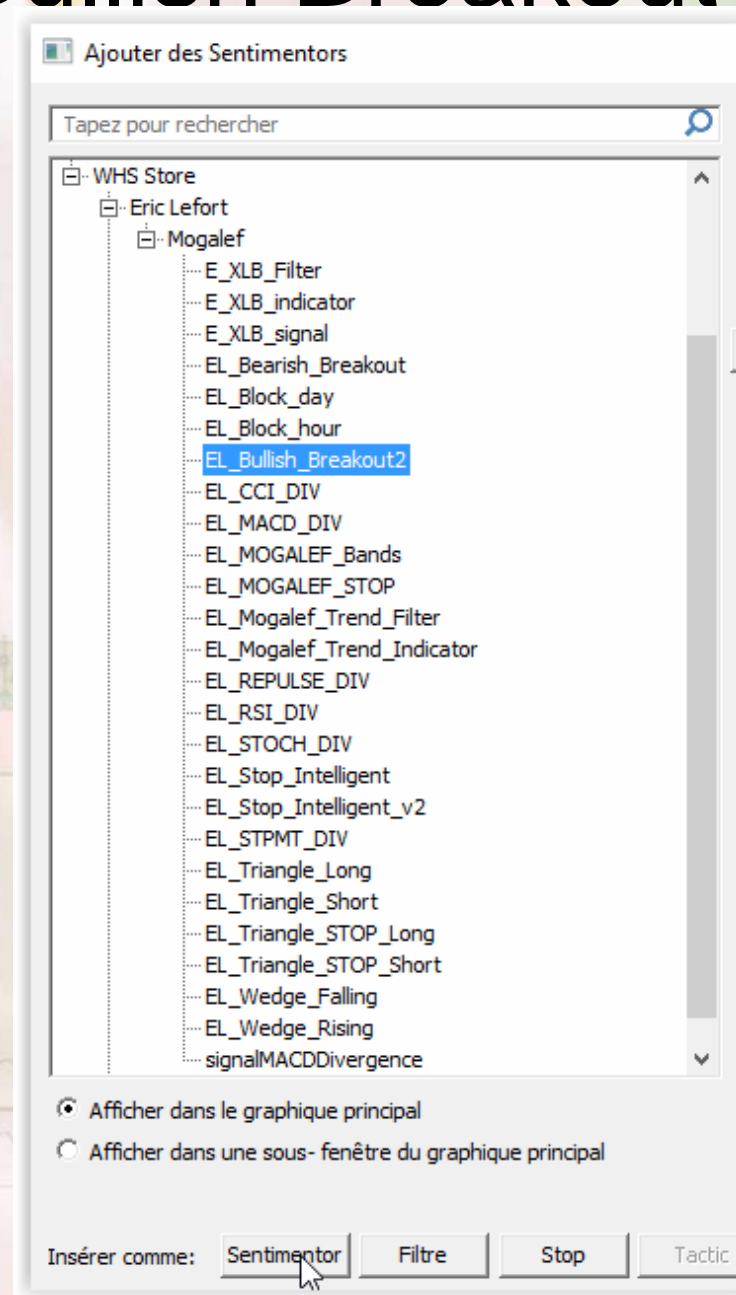
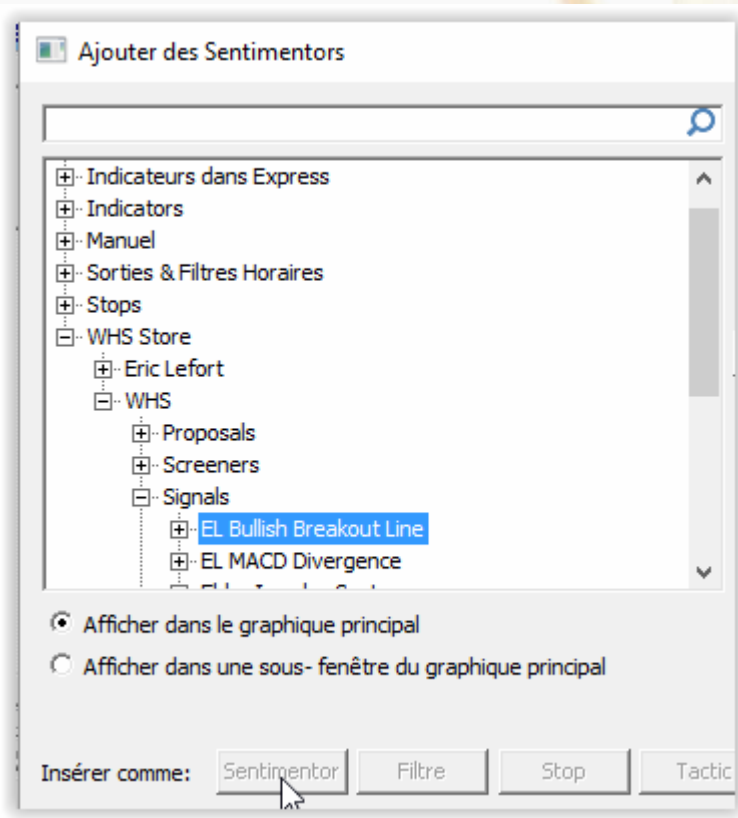
Statistiques	
Profit total net	1776.4
Nb total de trades	1776.4
Nb de trades gagnants	1776.4
Nb de trades perdants	1776.4
Trades gagnants (en %)	56.60
Facteur bénéfici	4.2
Gain moyen / perte mo...	3.1
Trade moyen (gain & p...	33.2
Temps passé dans le m...	26.54
Profit/€100/StdDev C...	0.69
Gain brut	23627
Perte brute	5853
Plus grand trade gagna...	382.5
Trade gagnant moyen	78.5
Nb de trades moyen par g...	46.8
Plus grand trade perdant	164.4
Trade perdant moyen	25.5
Nb de trades moyen par p...	22.2
Nb de gagnants consécut...	103.5
Nb de perdants consécut...	34.4
Ecart type de tous les tr...	94.4
Ecart type de trades ga...	103.5
Ecart type de trades per...	34.4
Nb max de trades par co...	103.5
Perte cumulée max	204.1
Commissions payées	0.4
Esperance	1.311
Score de l'esperance	0.000
Facteur chance	9.0
Performance / Perte cu...	8.1
Expectation	33.2
Début de l'évaluation	17.10.16 Max 0
Fin de l'évaluation	26.05.17 Fin 224

Au minimum il faut :

- Un signal d'entrée
- Un signal de sortie
- Un stop loss
- Un signal de sortie ou un objectif
- Si possible un filtre (de type filtre de tendance par exemple)



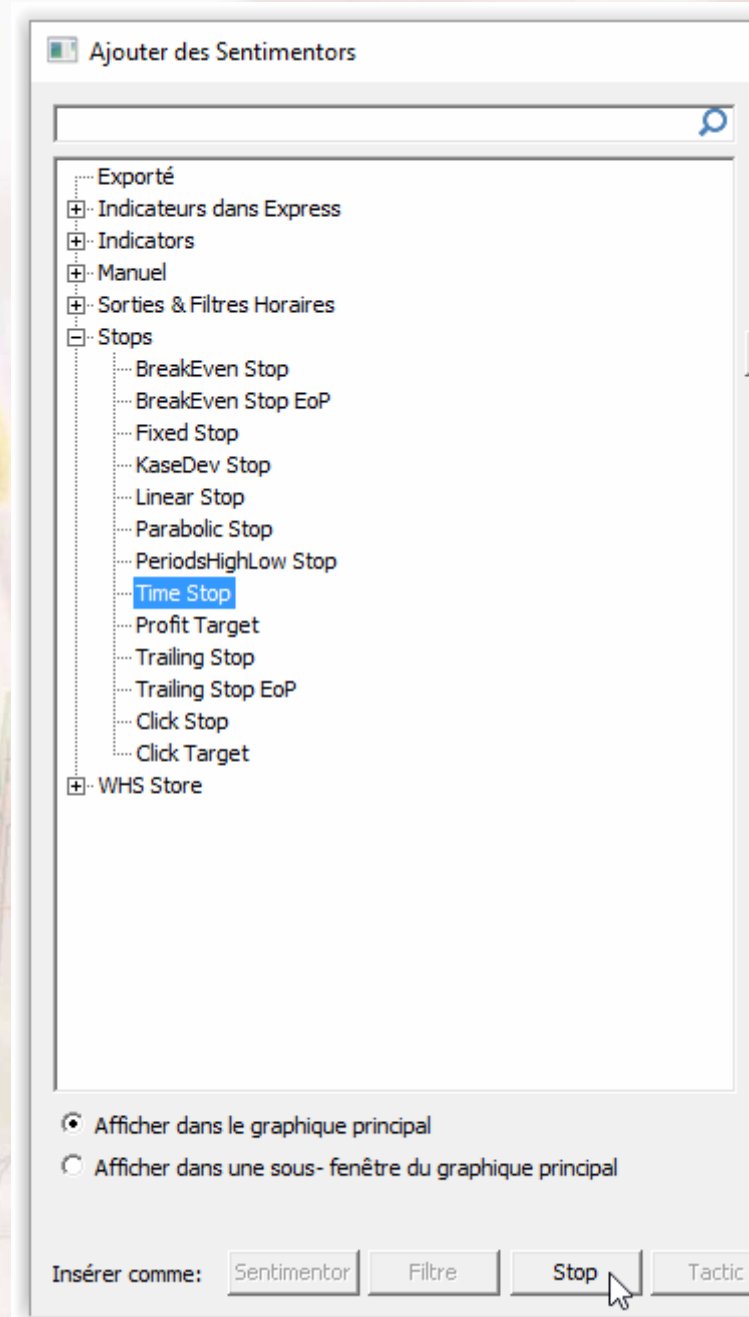
Entrer avec le EL Bullish Breakout



Le EL_Bullish_Breakout fait partie du pack d'indicateurs disponible en abonnement via la WHS Store.

Ajouter un time stop

- Le time stop va servir à sortir de position, Il pourra ultérieurement être secondé ou remplacé par un objectif ou/et un stop suiveur...



Dans un premier temps on intègre un Time Stop à 20 périodes et un Stop Loss à 2 ATR

L'objectif est ici de rester assez longtemps en position de manière à profiter des signaux situés en périodes favorables.

On a déjà l'ossature d'un système de trading.

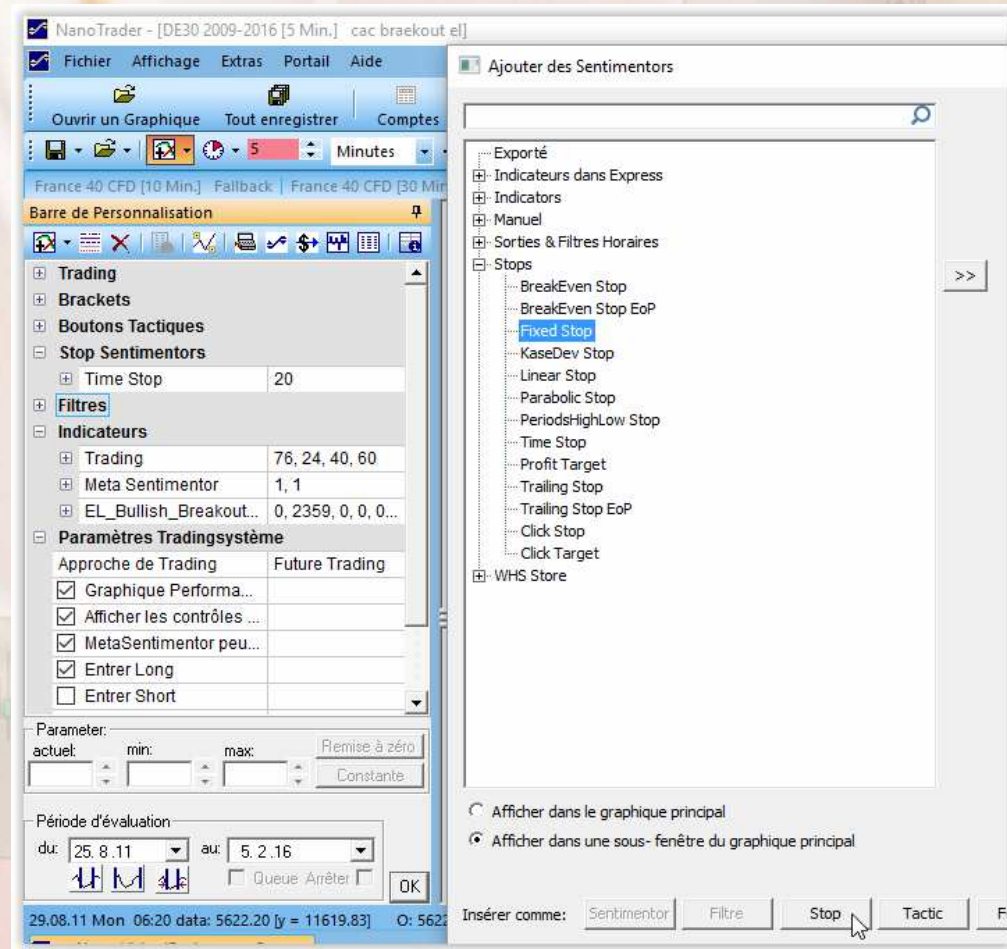


Sortie au bout de 20 bougies quelle que soit l'évolution des cours



Stop loss basé sur la volatilité (ATR)

On sélectionne un stop fixe dans la liste des sentimentors (indicateurs).



Paramètres du stop :

DE30 2009-2016 [5 Min.] DAX5mn_Cassure_conf2017_histo

Barre de Personnalisation

Trading

Compte	Choix...
Volume d'Ordre	1
Etat automatisation	Désactivé
Type d'Ordre Limite	n/a - Choisissez...
Type d'Ordre Stop	n/a - Choisissez...

Brackets

Fixed Stop

Stop Long: *ATR	2.00
Stop Short: *ATR	30

Unité pour Brackets etc. ATR

Envergure de l'ATR 20

Limites Multiples Non

Stops Multiples Non

Information

Raccourci Clavier

Les options de réglage du signal



- StartTime et EndTime permettent de déterminer la plage horaire pendant laquelle les signaux seront pris en compte et exécutés. Ici on règle cette plage de 9h00 à 17h30.
- SendEmail, PlaySound et MessageBox permettent d'être prévenu par mail, son ou boîte message quand un signal est détecté.

Les options de réglage du signal



- Smoth : l'indicateur de cassure cherche à tracer une ligne entre deux sommets. Smoth est le nombre de bougies de chaque côté d'un sommet nécessaire pour caractériser un sommet que l'indicateur pourra utiliser pour effectuer son tracé. 1: une bougie de chaque côté pour valider un sommet. 2: deux bougies ...
- Plus le smoth est élevé moins il y a de sommets, donc moins de tracés de ligne.

Les options de réglage du signal



- Mini est le nombre minimum de bougies que l'on exige entre deux sommets pour qu'une ligne de signal soit tracée.

Les options de réglage du signal



- Si on passe ce minimum de 4 à 8, seuls les sommets plus espacés donneront lieu à un tracé de ligne de cassure.

Les options de réglage du signal



- Maxi est le nombre maximum de bougies que l'on exige entre deux sommets pour qu'une ligne de signal soit tracée.

Les options de réglage du signal



- Si on passe ce maximum de 19 à 10, seuls les sommets plus proches donneront lieu à un tracé de ligne de cassure.
- Ici, cela a pour effet de nous enlever le trade gagnant.

Les options de réglage du signal



- MaxHighInclination est l'inclinaison maximum pour valider le tracé. Une inclinaison de 500 permet de valider même les tracés les plus pentus.
- MinHighInclination est l'inclinaison minimum pour valider le tracé. Une inclinaison de 0 permet de valider les tracés même si ceux-ci sont strictement horizontaux.

Les options de réglage du signal



- Passer l'inclinaison maximum de 500 à 20 permet ici de ne plus tracer les lignes dont l'inclinaison est forte.

Les options de réglage du signal



- Passer l'inclinaison minimum de 0 à 18 permet ici de ne plus tracer les lignes dont l'inclinaison est faible.

Les options de réglage du signal



- EntryStratégie. 1: on achète seulement si la clôture dépasse la ligne.
2: On achète si les cours dépassent la ligne.
- DifferEntry : on achète direct à la cassure (0) ou on diffère l'entrée d'1, 2 ou 3 bougies.

D'une manière général il est conseillé de ne pas toucher à ces deux paramètres.
A vous de voir...

Pour en revenir à notre étude, où en sommes nous?

On a déjà un système complet comprenant :

- Un signal d'entrée
- Un objectif (temporel)
- Un stop loss
- Une limitation des heures de trading

On peut avoir un aperçu de la courbe de gain et des performances du système.

Voyons la courbe de gains avec les paramètres standard, le time stop et le stop loss:



C'est généralement à ce niveau que les débutants abandonnent. C'est pourtant ici que commence le travail de réflexion et de recherche.

Un filtre de tendance ; Le Mogalef Trend Filter

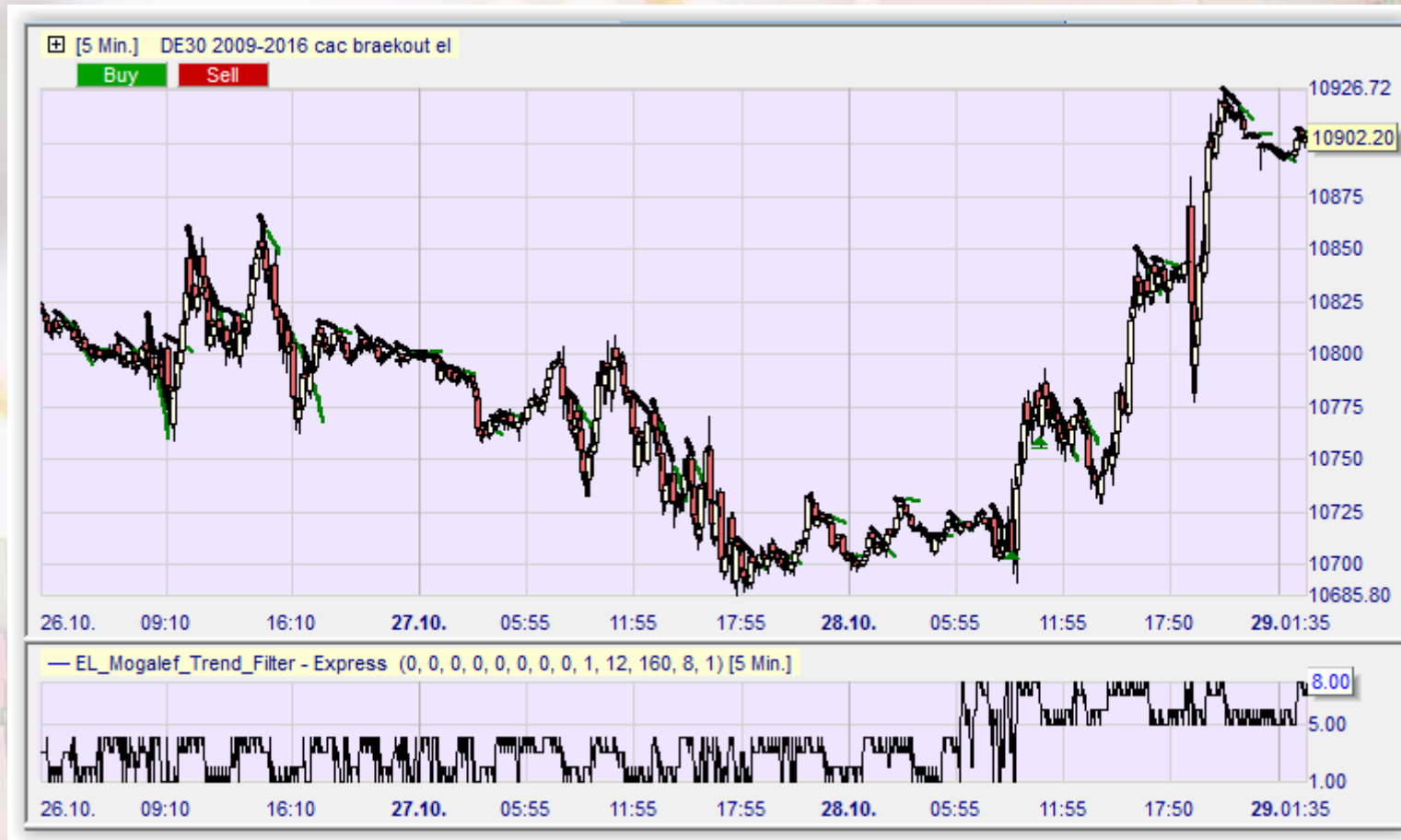
Si vous êtes abonnés aux outils Mogalef via le STORE de WHS, insérez le MTF en tant que filtre et réglez-le sur 1-12-160 pour qu'il soit utilisable en CFD.

Ce réglage résulte en fait d'une recherche visant à sélectionner les périodes de poussée haussière sur 1 bougie, 12 bougies (1 heure) et 160 bougies.

The screenshot shows the NanoTrader interface with the following details:

- Top Bar:** NanoTrader - [DE30 2009-2016 [5 Min.] cac braekout el]
- Menu:** Fichier, Affichage, Extras, Portail, Aide
- Toolbar:** Includes icons for file operations and a red circle around the 'Ajouter des Sentimentors' button.
- Market Data:** France 40 CFD (10 Min.) | Fallback | France 40 CFD (30 Min.)
- Barre de Personnalisation:** Contains various chart and tool icons.
- Boutons Tactiques:**
 - Stop Sentimentors: Time Stop 20
 - Filtres:
 - EL_Mogalef_Trend_F...: 0, 0, 0, 0, 0, 0, ...
 - BlockCase1 to BlockCase8: 0
 - R1: 1 (highlighted with a red box)
 - R2: 12 (highlighted with a red box)
 - R3: 160 (highlighted with a red box)
 - TradeOnlyThisCA...: 0
- Parameter TradeOnlyThisCASE:** actuel: 0, min: 0, max: 8, Remise à zéro, Constante
- Période d'évaluation:** du: 25.8.11, au: 5.2.16, Queue, Arrêter, OK
- Ajouter des Sentimentors Dialog:**
 - WHS Store: Eric Lefort, Mogalef
 - List of indicators: E_XLB_Filter, E_XLB_indicator, E_XLB_signal, EL_Bearish_Breakout, EL_Block_day, EL_Block_hour, EL_Bullish_Breakout2, EL_CCI_DIV, EL_MACD_DIV, EL_MOGALEF_Bands, EL_MOGALEF_STOP, EL_Mogalef_Trend_Filter (highlighted with a blue box), EL_Mogalef_Trend_Indicator, EL_REPULSE_DIV, EL_RSI_DIV, EL_STOCH_DIV, EL_Stop_Intelligent, EL_Stop_Intelligent_v2, EL_STPMT_DIV, EL_Triangle_Long, EL_Triangle_Short, EL_Triangle_STOP_Long, EL_Triangle_STOP_Short, EL_Wedge_Falling, EL_Wedge_Rising, signalMACDDivergence
 - Options: Afficher dans le graphique principal (unchecked), Afficher dans une sous-fenêtre du graphique principal (checked and circled in red)
 - Buttons: Insérer comme: Sentimentor, Filtre (circled in red), Stop, Tactic

Comment intervient ce filtre de poussée gradué de 1 à 8 ?



- Après test de chacun des 8 cas, il s'avère plus intéressant (et plus logique!) de ne trader que le cas 8:



Voyons l'effet du Mogalef Trend Filter sur la courbe de gain



La clé du Mogalef Trend Filter: le WHS Repulse à 1-12-160



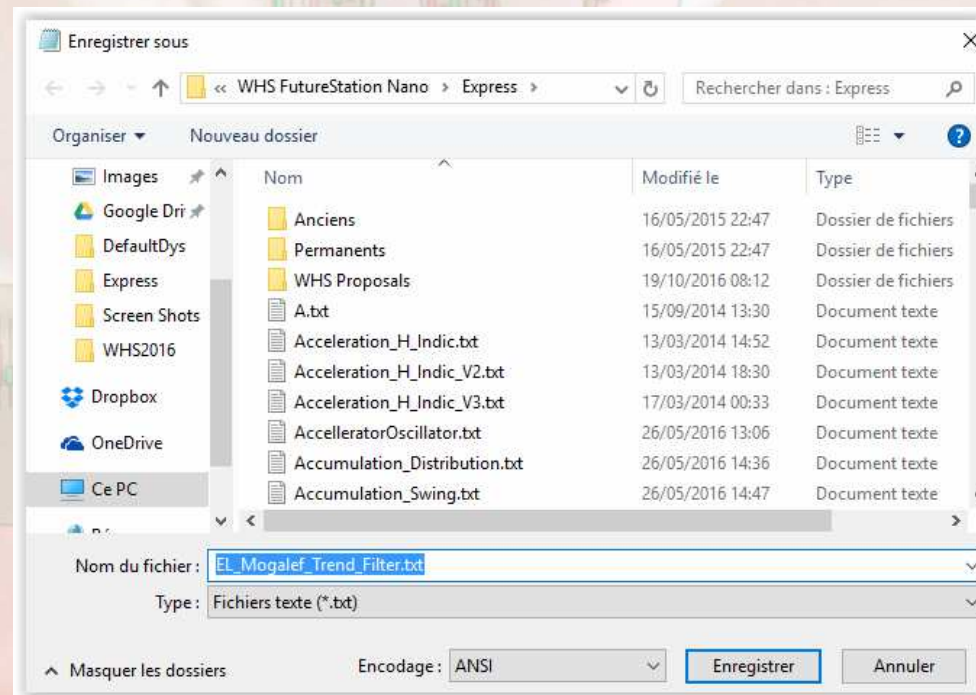
Télécharger et utiliser en test le Mogalef Trend Filter

- Téléchargez l'indicateur sur Mogalef-Trading.com:
- Menu HOME,
- Conférences WHS 2017

bouton « Download MTF »

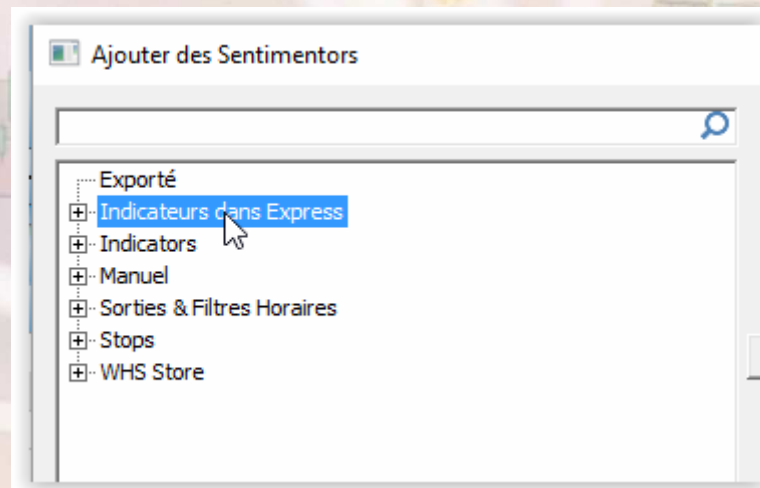
Télécharger et utiliser en test le Mogalef Trend Filter

- Enregistrez le fichier EL_Mogalef_Trend_Filter.txt dans le sous répertoire « EXPRESS » :



Télécharger et utiliser en test le Mogalef Trend Filter

- Lancez votre plateforme. L'indicateur sera disponible parmi les indicateurs Express :



L'indicateur est utilisable en direct jusqu'au 1/10/2017.

Il reste ensuite utilisable 1 an sur historiques.

Pour une utilisation infinie, rendez-vous dans la

WHS STORE de la Nano : outils Mogalef

Une fonction
extraordinaire
de la Nano :
La mesure de
sensibilité d'un
paramètre.

Barre de Personnalisation

- Stop Sentimentors
 - Time Stop 20
 - Max Periods 20
- Filtres
- Indicateurs
 - Trading 76, 24, 40, 60
 - Meta Sentimentor 1, 1
 - EL_Bullish_Breakout... 900, 1730, 0, 0, ...
 - StartTime 900
 - EndTime 1730
 - SendEmail 0
 - PlaySound 0
 - MessageBox 0
 - Smooth 1
 - Mini
 - Maxi
 - Prolong
 - MaxHighInclination
 - MinHighInclination
 - EntryStrategy
 - DifferEntry
- Paramètres Tradingsyst
 - Approche de Trading
 - Graphique Performa...
- Parameter Mini
 - actuel: 9 min: 4 max: 15
- Période d'évaluation
 - du: 2 1 au:

0.15 Thu 04:20 data: 6.00 ly =

Screeners CFD-Fo

[S Min.] DE30 2009-2016 DAX5mn_Cassure_conf2017_his

Buy Sell

08.01.09 15.01.10 13.01.11 11.01.12 11.01.13

Visualisation ...

Afficher le sentimentor dans une sous-fenêtre du graphique principal

Aggregation ...

Modifier Interprétation ...

Supprimer Sentimentor Actif

Remise à zéro Sentimentor Actif

Sensibilité du Sentimentor ...

Sensibilité du Paramètre ...

Recherche Tabou pour Sentimentor actif ...

Recherche Exhaustive du Paramètre actif ...

Recherche Exhaustive du Sentimentor actif...

Fixer le Sentimentor actif

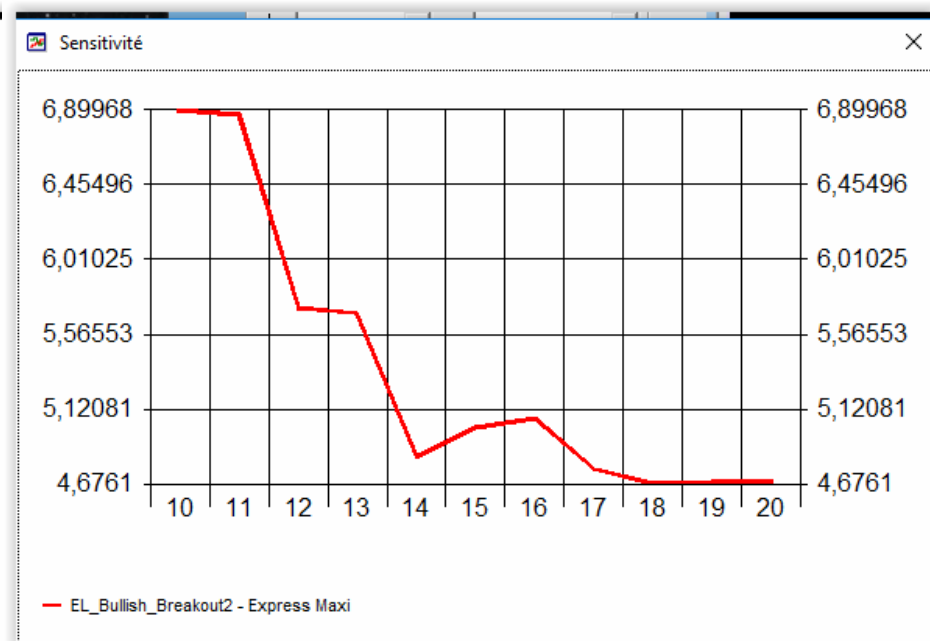
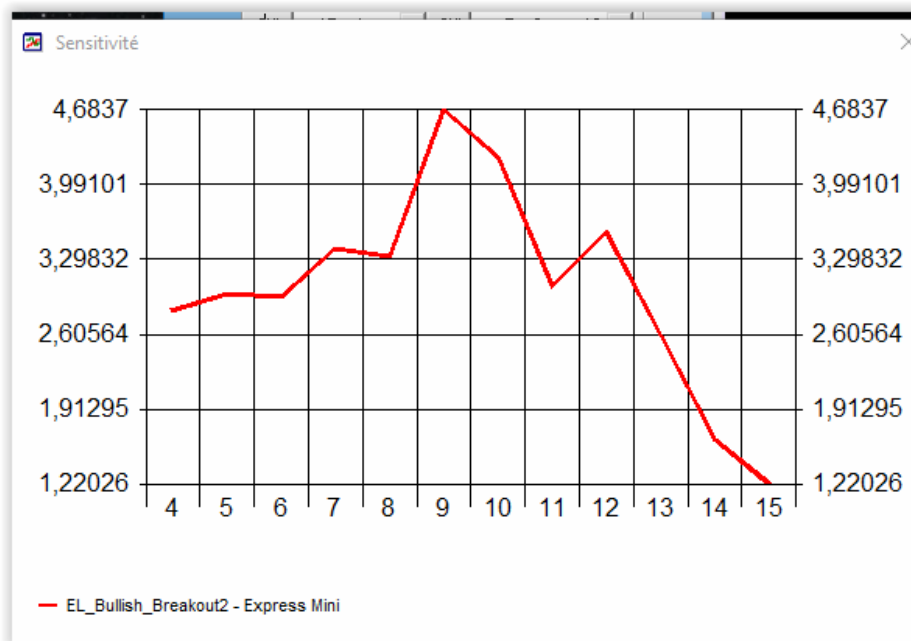
Exporter le Sentimentor actif...

Mise à Zéro de tous les Sentimentors

Fixer Tous les Sentimentors

Supprimer tous les Sentimentors

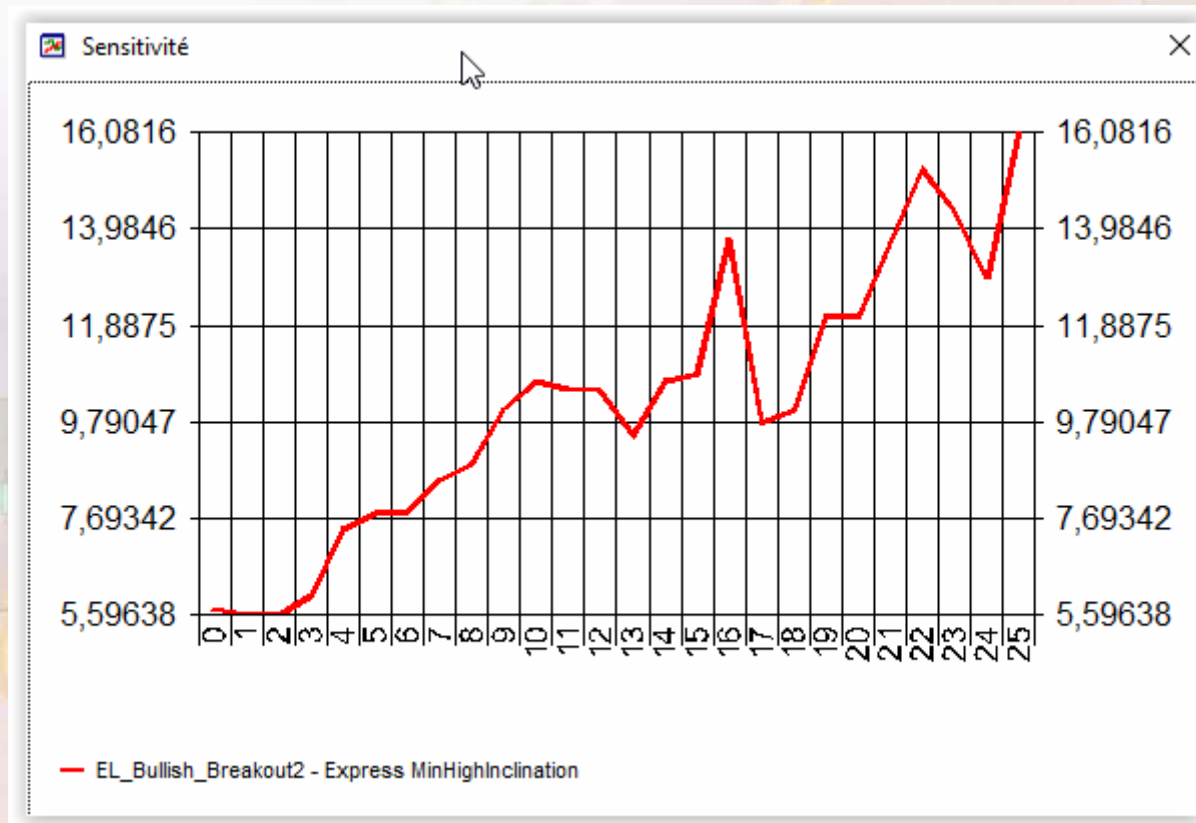
L'influence des paramètres Mini et Maxi



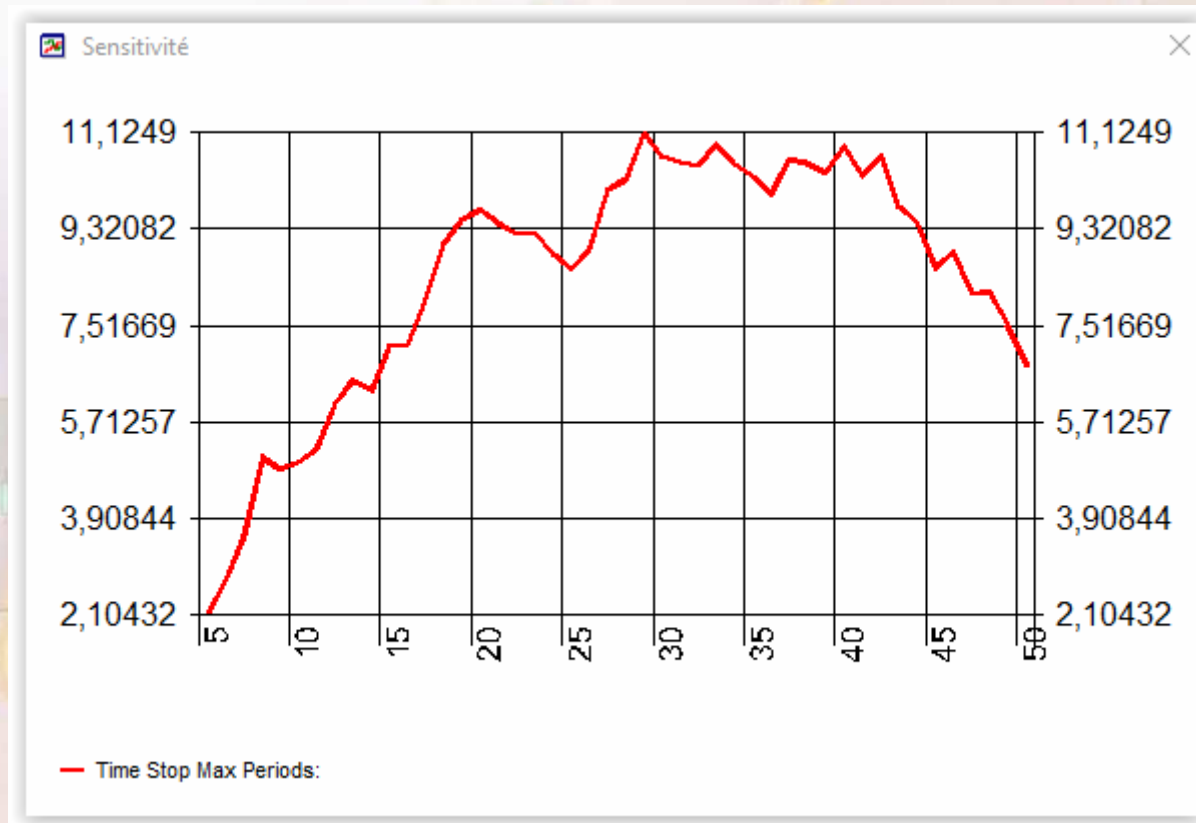
Nouvelle courbe de gain avec ces paramètres modifiés



L'influence de l'inclinaison maximum



L'influence du Time Stop



La courbe de gain obtenue



ACTUEL

Barre de Personnalisation

- Trading
 - Compte: 1550045
 - Volume d'Ordre: 2
 - Etat automatisation: Désactivé
 - Type d'Ordre Limite: Limit
 - Type d'Ordre Stop: Stop
- Brackets
- Boutons Tactiques
- Stop Sentimentors
 - Time Stop: 30
 - Max Periods: 30
- Filtres
- Indicateurs
 - Trading: 76, 24, 40, 60
 - Meta Sentimentor: 1, 1
 - EL_Bullish_Breakout...: 900, 1730, 0, 0, ...
 - StartTime: 900
 - EndTime: 1730
 - SendEmail: 0
 - PlaySound: 0
 - MessageBox: 0
 - Smooth: 1
 - Mini: 9
 - Maxi: 12

Parameter:
 actuel: min: max:

Période d'évaluation:
 du: 21.11 au: 12.06.17

[5 Min.] Germany 30 CFD 99508 DAX5mn_Cassure_conf2017

Buy Sell Pos: 0 P/L: 0.00 (EUR) Désactivé Exit 1550045

Risk: n/a Target: n/a (EUR)

Fixed Stop (2, 30)
Time Stop (30)
— EL_Bullish_Breakout2 - Express (900, 1730, 0, 0, 0, 1, 9, 12, 10, 500, 10, 1, 0)

— Equity (Meta Sentimentor)
Trade moyen: 20.81

— [5 Min.] EL_Mogalef_Trend_Filter - Express (0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 0, 1, 12, 160, 8, 1)

Barre d'Info

Elément	Période d'Opti...
Trade moyen	20.81
Profit total net:	145.70
Nb total de trades:	7
Nb de trades gagnants:	6
Nb de trades perdants:	1
Trades gagnants (en %):	85.71%
Facteur bénéfice:	8.67
Gain moyen / perte mo...	1.44
Trade moyen (gain & p...	20.81
Temps passé dans le m...	0.77%
RegCoeff*100/StdDev C...	-0.0002
Gain brut:	164.70
Perte brute:	19.00
Plus grand trade gagna...	49.30
Trade gagnant moyen:	27.45
Nb barres moyen par g...	29.00
Plus grand trade perdant:	19.00
Trade perdant moyen:	19.00
Nb barres moyen par p...	11.00
Nb de gagnants consé...	6
Nb de perdants consé...	1
Ecart type de tous les tr...	24.84
Ecart type de trades ga...	19.25
Ecart type de trades per...	0.00
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	19.00
Commissions payées:	0.00
Espérance:	1.0955
Score de l'espérance:	0.0003
Facteur chance:	14.47
Performance / Perte cu...	7.67
Expectative:	20.81
Début de l'évaluation:	21.11.16 Mon 0...
Fin de l'évaluation:	12.06.17 Mon 0...

Données | Sentis | Eval

Mogalef Trading

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

Actuel avec plus de trades



Ceci est un exemple,
mais il est préférable de travailler
sur des UT plus longues

Histoire de l'élaboration d'un système de trading sur le 30 minutes qui « tourne » actuellement.

The screenshot displays the Mogalef Trading website interface. At the top, the logo "Mogalef Trading" is accompanied by the tagline "There's no certitude, only opportunities." and a shopping cart icon labeled "Panier - Shopping Cart". A navigation bar includes links for HOME, SYSTEMS NEWS, INDICATORS, TOOLS, PRIVATES CLUBS, PRACTICE WITH MOGALEF, FORMATIONS, and PANIER. A dropdown menu under "SYSTEMS NEWS" lists various trading systems such as "Scalping Dax 30 CFD (MTI Club only)", "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 Continuation", "Bullish Breakout Tests results", "CCI Divergences", "Triangle Trading Systems", "Bullish Breakout on DAX CFD", "Wedge - Biseau 1", and "Trading System Alert03".

The main content area features a candlestick chart for "Germany 30 CFD" with a "Buy" signal and an "Intelligent Target" line. Text on the page includes "This target of its itself" and "Scalping Target) is Club Members. If the at a better price." A "Cette page en français" link with a French flag is also visible.

At the bottom right, a subscription offer is displayed: "Subscriptions to Mogalef Club are for 1, 3 or 12 months" with a "25% For 12 months" discount badge. A button labeled "Accès à la description" with a French flag is located below the menu.



Cassure haussière et time stop standard.

Première impression : rien à en tirer.

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



Ici on limite les entrées à des heures standard : de 9h00 à 20h00.



On augmente le nombre de trades en passant le minimum entre 2 sommets à 3 bougies. On observe une augmentation du trade moyen.

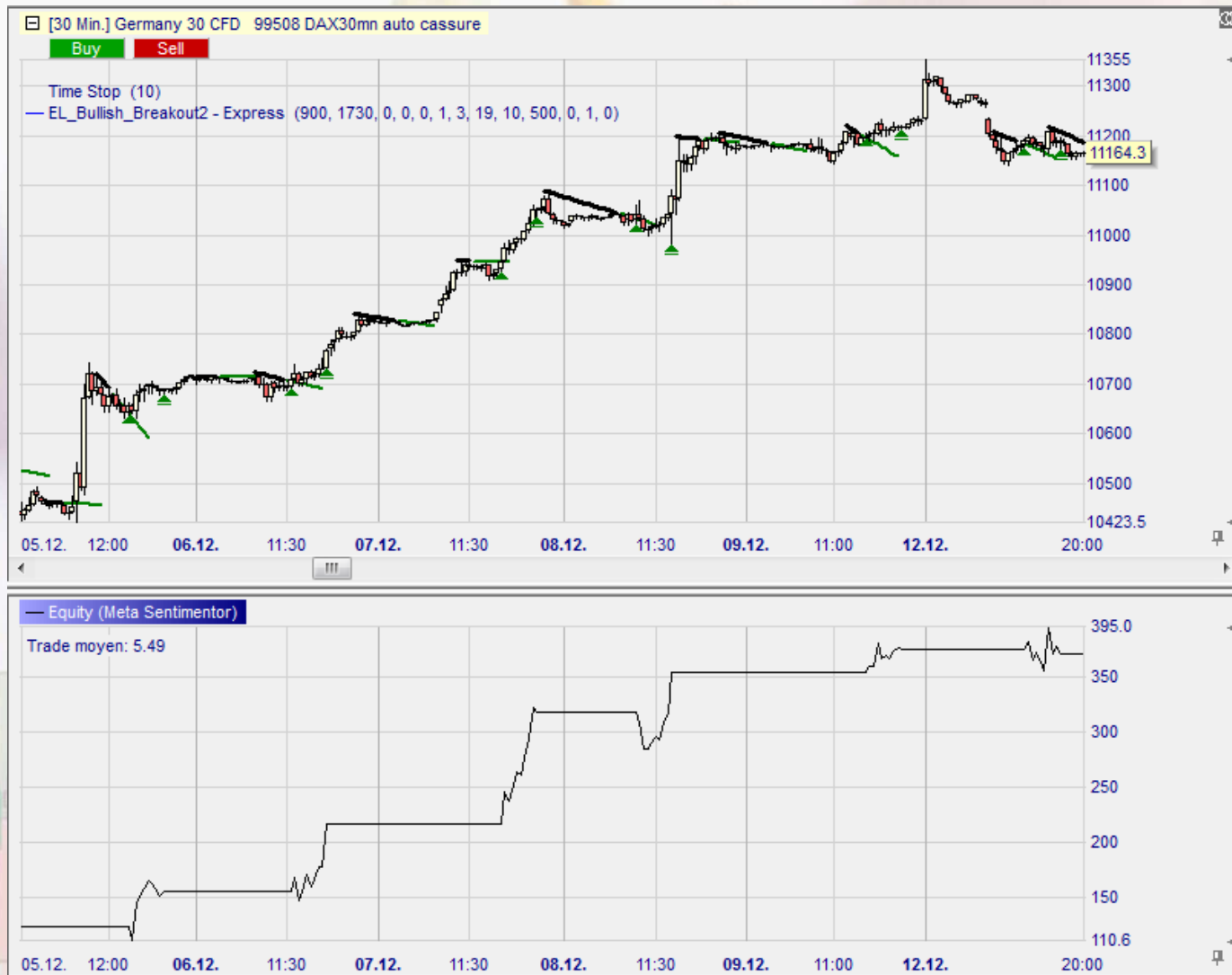
Mogalef Trading
"There's no certitude, only opportunities." V



En changeant de nouveau l'heure maximum et en se limitant à des entrées jusqu'à 17h30 on s'assure un meilleur gain moyen et le spread payé sera minimum, toujours égal à 1. On commence à avoir une bonne base.



On observe les périodes de fortes pertes. Ici un stop loss bien placé aurait limité les pertes. Mais il ne doit pas être trop proche pour ne pas nous sortir des trades gagnants.



On observe les périodes gagnantes : les entrées sont multiples et la poussée haussière est durable: il aurait été avantageux de rester plus longtemps en position. Un stop suiveur et supprimer le Time Stop aurait-il été intéressant ?



On supprime le Time Stop et on le remplace par un stop suiveur :
le Stop Intelligent.

Mogalef Trading

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



On ajuste le stop intelligent. Les tests montrent qu'il est intéressant de le rendre plus réactif aux sommets et creux mais aussi de lui demander d'attendre avant de serrer lors des phases de range.



On ajuste le stop intelligent. Les tests montrent qu'il est intéressant de le rendre plus réactif aux sommets et creux mais aussi de lui demander d'attendre avant de serrer lors des phases de range.

On diminue les pertes et on augmente les gains, donc on augmente le gain moyen.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities."



On examine l'effet de l'inclinaison maximum (MaxHighInclination).
 Une valeur autour de 20 augmenterait le trade moyen sans trop diminuer le nombre de trades.



Résultat du changement de MaxHighInclination : **AVANT** ...



Résultat du changement de MaxHighInclination : **APRES**



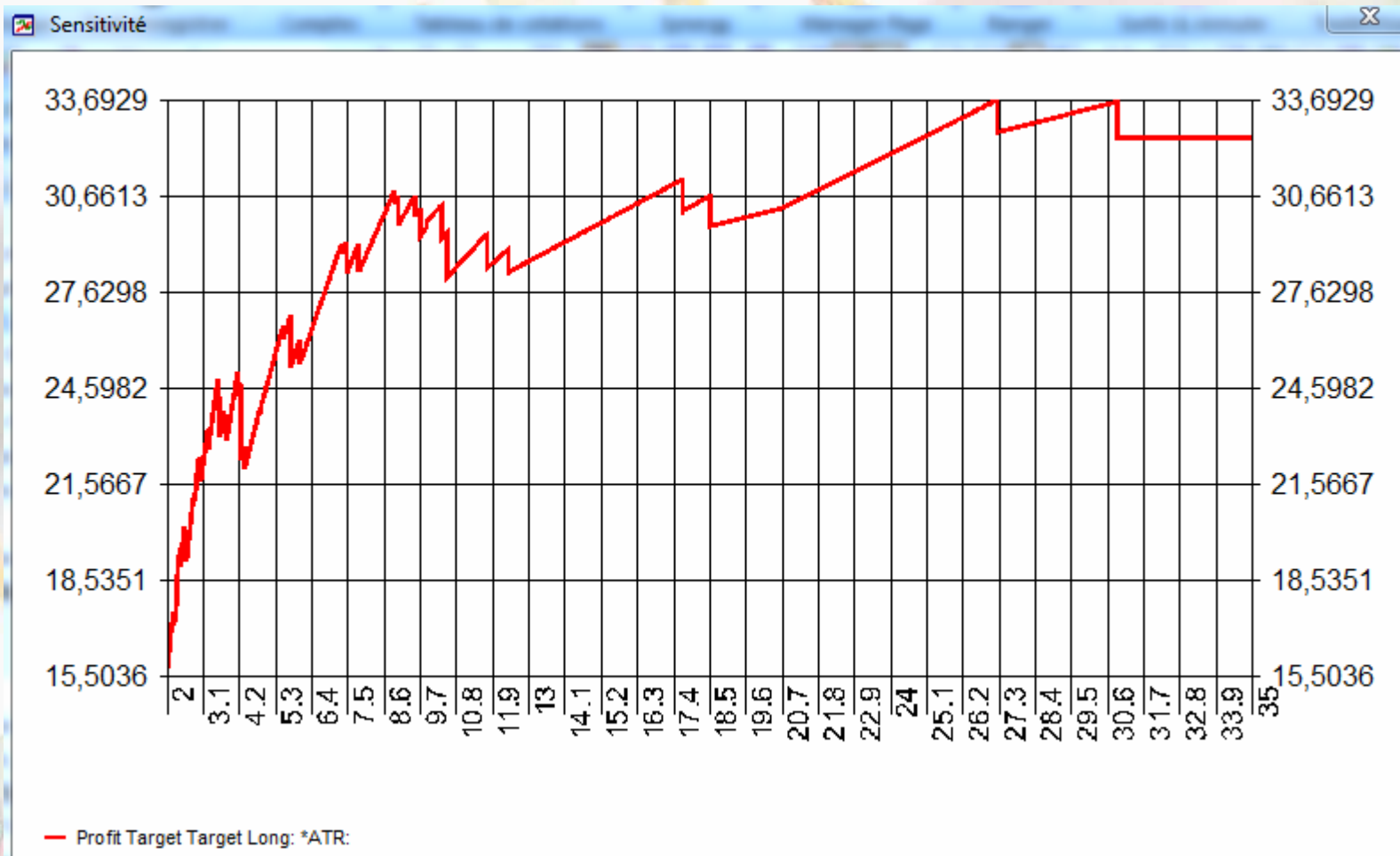
On regarde de nouveau les heures d'entrée et l'on remarque que l'horaire 9h – 10h30 n'est pas intéressant.

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



On adopte donc une plage horaire d'acceptation des signaux définitive:
de 11h à 17h30.

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



L'ajout d'un objectif apporte-t-il une amélioration ?

La réponse est non, il vaut mieux laisser courir les trades.

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

Conclusion

On se contente donc des ajustements opérés de manière à ne pas diminuer encore le nombre de trades.

Tant que le marché ne changera pas fondamentalement, il y a des chances pour que la rentabilité soit au rendez-vous.

Si le marché change, il a peu de chances pour que les pertes soient catastrophiques.

Bons trades à toutes et tous !

Télécharger le stop intelligent

- Menu HOME, puis conférences WHS 2017



- Télécharger l'indicateur puis le déplacer dans le répertoire « ../Documents/WHS FutureStation Nano/Express »
- EL_Stop_Intelligent sera alors disponible parmi vos indicateurs Express jusqu'au 30 septembre 2017.