

**Mogalef Trading**

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

# Corriger son trading

Réflexion du groupe Mogalef

Présenté par Eric Lefort

# Mogalef Trading

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

- Quel que soit votre technique ou votre système, vous utilisez des indicateurs, des filtres, des stops, des objectifs et/ou des configurations.
- Chacun possède des paramètres variables qui nécessitent un ajustement au support (Forex, indices, actions ...) et à l'unité de temps.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- Les logiciels vous proposent souvent une recherche des meilleurs paramètres, ou pire une adaptation automatique vous présentant les meilleurs paramètres possibles sur le passé.
- Ce leurre peut vous être vendu comme une panacée à un prix parfois exorbitant (jusqu'à 50000€ !). Mais une réelle adaptation des paramètres nécessite un travail intelligent, bien différent d'une simple optimisation sur le passé.

# Mogalef Trading

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

## Ce que vous propose la NanoTrader

- Comme tout logiciel avancé, la NanoTrader possède une fonction adaptant au mieux votre trading au passé.
- Elle comporte heureusement aussi des fonctions vous permettant une estimation intelligente des paramètres de votre trading et une réelle adaptation au support et aux conditions de marché.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Ce qu'il faut éviter

La solution de facilité consiste à déterminer les meilleurs paramètres sur le passé :

The screenshot displays the Mogalef Trading software interface. The main window shows a 'Barre de Personnalisation' (Customization Bar) with various trading tools. A 'Trading' panel is visible, containing several parameters:

- Brackets:** Profit Target (30, 30), Fixed Stop (3, 30), EL\_Stop\_Intelligent... (2, 2, 15, 5, 2, 2, 2), Trailing Stop EoP (40, 30). Unité pour Brackets etc. (ATR), Envergure de l'ATR (40), Limites Multiples (Non), Stops Multiples (Non).
- Boutons Tactiques:** Information, Raccourci Clavier.
- Filtres:** Block (11:00 - 14:00), EL\_Mogalef\_Trend\_F... (1, 1, 1, 1, 1, 0, 0, 0, 1, 90, 150, 0, 1).
- Indicateurs:** Trading (76, 24, 40, 60), Meta Sentimentor (1, 1), EL\_Bullish\_Breakout... (936, 7667, 0, 1, 0, 1, 1, 3, 7, 5, 3, ...).
- Paramètres Tradingsystème:** Approche de Trading (Future Trading), Graphique Performa (checked), Afficher les contrôles... (checked), MetaSentimentor peu... (checked), Entrer Long (checked), Entrer Short (unchecked).

Below the parameters, there is a 'Parameter' section with 'actuel', 'min', and 'max' fields, and a 'Remise à zéro' button. The 'Période d'évaluation' is set from '17 1 0:00' to '29 8 17:39'.

An 'Optimisation de EL\_Bullish\_Breakout4 - Express Temps d'exécution: 00:00:52' dialog box is open, showing the following data:

Progression: Essais: 33, Améliorations: 6, Dernière amélioration lors de l'essai: 30.

Meilleure Note Courante:

Élément	Valeur	Contr...	Queue
Trade moyen	440.10	0.00	0.00
Profit total net:	880.20	0.00	0.00
Nb total de trades:	2	0	0
Nb de trades gagn...	2	0	0

Stop après: Essais max.: 10000, temps max.: 03:01:00.

Buttons: Démarrer, Stop, Fermer, Confirmer Fermer, Évaluateur...

Table of results:

Rang	Période d'Optimi...	Période de Contr	Période de Queue
1	440.10	0.00	0.00
2	306.50	0.00	0.00
3	125.62	0.00	0.00
4	99.14	0.00	0.00
5	92.13	0.00	0.00
6	52.20	0.00	0.00
7	44.23	0.00	0.00

# Mogalef Trading

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

- C'est une erreur monumentale, sauf à examiner la stabilité de chaque paramètre et son absence d'optimisation.
- L'optimisation est l'erreur fatale dans laquelle il ne faut surtout pas tomber car elle conduit inévitablement à la perte future. C'est pourquoi les logiciels de sélection automatique de systèmes sont à proscrire au profit de l'analyse par l'Homme de l'efficacité des changements de paramètres.

# Mogalef Trading

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

- Si vous êtes en manuel et que vos signaux, stops, filtres ou objectifs ne sont pas programmables, vous devrez faire varier manuellement vos paramètres pour estimer si vos choix ne sont pas trop « pointus ». Ce serait une trop grande optimisation et révélerait la fragilité de votre méthode.

C'est un long travail qui nécessite patience et objectivité.

- Si vous utilisez des signaux programmables (ou déjà programmés) votre travail sera grandement facilité. La NanoTrader possède l'outil parfait, rapide et puissant, qui vous permettra en quelques clics d'avoir une idée exacte de la pertinence de vos choix.

# Mogalef Trading

*"There's no certitude, only opportunities"*

## Sommaire

- Etude préliminaire d'un signal : MACD
- Présentation d'un système sur le DJ
- Indicateurs et filtres
- Etude des performances
- Etude des contre performances

## Exemple d'examen d'un signal

- Si l'ensemble de votre système n'est pas programmable mais que votre signal d'entrée (par exemple) utilise un indicateur présent dans la NanoTrader, vous pouvez quand même utiliser l'outil pour estimer la pertinence de ce signal.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- Prenez un graphe vierge.
- Insérez votre indicateur ainsi qu'un TimeStop et le metasentimentor.
- Vous êtes prêts pour obtenir une bonne idée de l'efficacité de votre signal.
- Exemple : signal croisement de MACD avec stops et objectifs déterminés manuellement en fonction du marché.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Pour la suite vous aurez aussi besoin d'afficher la Barre d'Info et la Barre de Personnalisation.





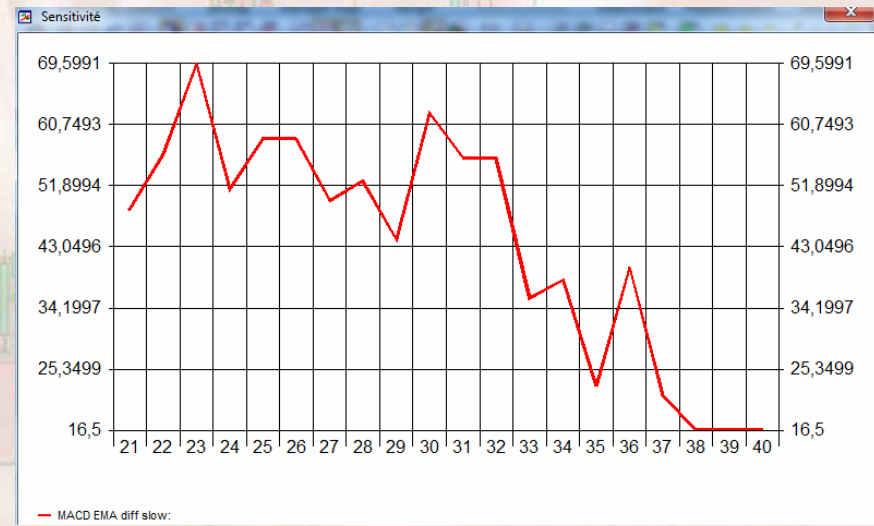
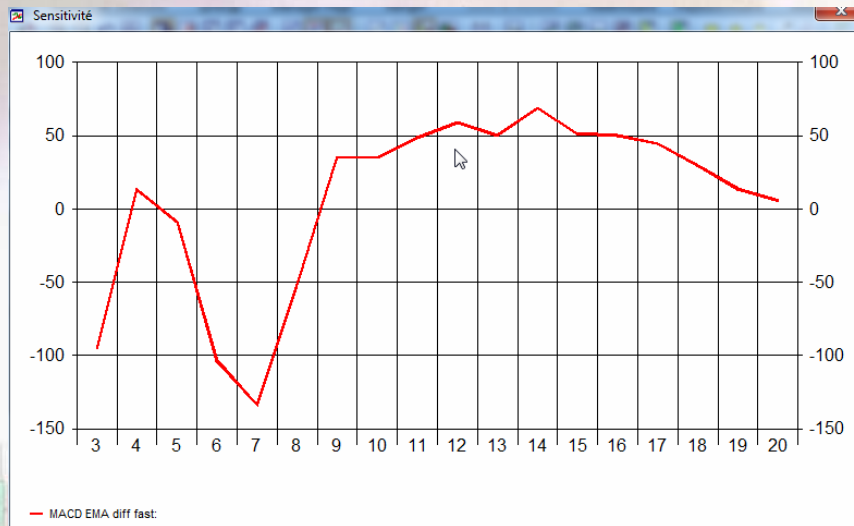
En cochant la case « Graphique Performance » s'affiche la courbe de gain du signal MACD si on sort de position 10 bougies après l'entrée.

Ceci donne une première idée de l'efficacité du signal d'entrée.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Vous pourrez aussi tester en 1 clic les différentes valeurs de chaque paramètre comme nous le verrons plus loin. Ici par exemple les valeurs des deux moyennes mobiles constituant la MACD



On voit ainsi rapidement que les valeurs 12 et 26 sont parmi les meilleures, mais que les performances restent médiocres.

Est-ce utile de continuer avec la MACD?

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Séparons trades longs et trades shorts

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

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

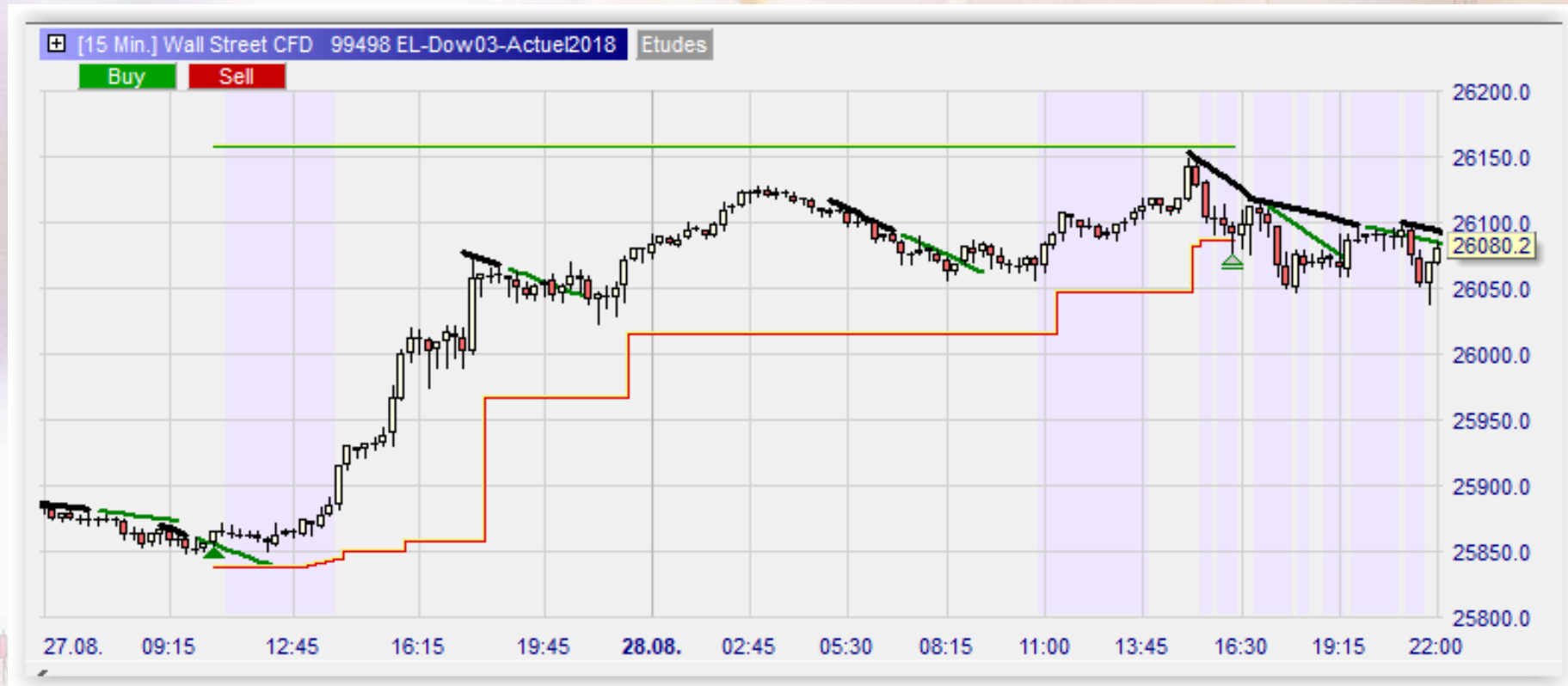


- On voit qu'il existe une corrélation entre la tendance et l'efficacité des trades shorts, mais pas des trades longs.
- Il sera donc peut-être possible de filtrer les trades en fonction de la tendance, uniquement pour les shorts.
- Les signaux MACD shorts présentent donc une possibilité d'utilisation avantageuse.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Voyons maintenant un système sur le DJ en 15 mn

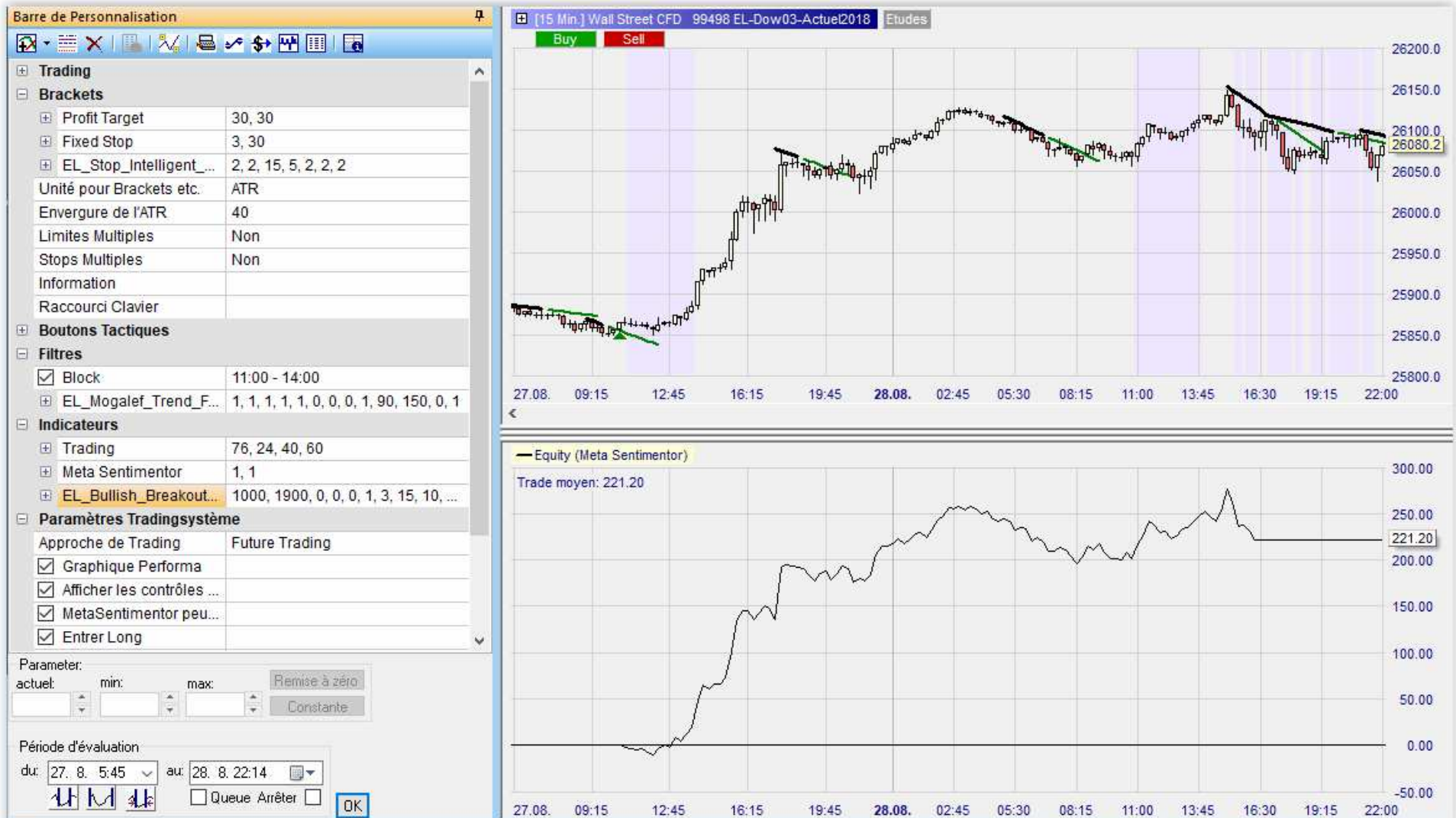


- Le principe est simple et classique : Prendre des positions acheteuses dans un marché foncièrement haussier, dans un trend haussier et en laissant les positions se développer pour e,granger un maximum de gros gains avec un risque faible.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Indicateurs et filtres utilisés



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Barre de Personnalisation

Trading

Brackets

Profit Target	30, 30
Target Long: *ATR	30
Target Short: *ATR	30
Fixed Stop	3, 30
Stop Long: *ATR	3
Stop Short: *ATR	30
EL_Stop_Intelligent...	2, 2, 15, 5, 2, 2, 2
Unité pour Brackets etc.	ATR
Envergure de l'ATR	40
Limites Multiples	Non
Stops Multiples	Non

Information

Raccourci Clavier

Boutons Tactiques

Filtres

<input checked="" type="checkbox"/> Block	11:00 - 14:00
<input type="checkbox"/> EL_Mogalef_Trend_F...	1, 1, 1, 1, 1, 0, 0, 0, 1, 90, 150, 0, 1

Indicateurs

<input type="checkbox"/> Trading	76, 24, 40, 60
<input type="checkbox"/> Meta Sentimentor	1, 1
<input type="checkbox"/> EL_Bullish_Breakout...	1000, 1900, 0, 0, 0, 1, 3, 15, 10, ...
StartTime	1000
EndTime	1900

Parameter:

actuel: min: max: Remise à zéro

Constante

Période d'évaluation

du: 27. 8. 5:45 au: 29. 8. 18:15

Queue Arrêter

OK



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Barre de Personnalisation

Trading

Brackets

Profit Target	30, 30
Target Long: *ATR	30
Target Short: *ATR	30
Fixed Stop	3, 30
Stop Long: *ATR	3
Stop Short: *ATR	30
EL_Stop_Intelligent...	2, 2, 15, 5, 2, 2, 2
Unité pour Brackets etc.	ATR
Envergure de l'ATR	40
Limites Multiples	Non
Stops Multiples	Non
Information	
Raccourci Clavier	

Boutons Tactiques

Filtres

<input checked="" type="checkbox"/> Block	11:00 - 14:00
<input checked="" type="checkbox"/> EL_Mogalef_Trend_F...	1, 1, 1, 1, 1, 0, 0, 0, 1, 90, 150, 0, 1

Indicateurs

<input checked="" type="checkbox"/> Trading	76, 24, 40, 60
<input checked="" type="checkbox"/> Meta Sentimentor	1, 1
<input checked="" type="checkbox"/> EL_Bullish_Breakout...	1000, 1900, 0, 0, 0, 1, 3, 15, 10, ...
StartTime	1000
EndTime	1900

Parameter:

actuel:    min:    max:    Remise à zéro

          Constante

Période d'évaluation

du: 27. 8. 5:45    au: 29. 8. 18:15

Queue Arrêter  OK



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Barre de Personnalisation

**Brackets**

Profit Target	30, 30
Fixed Stop	3, 30
EL_Stop_Intelligent_...	2, 2, 15, 5, 2, 2, 2
Quality	2
RecentVolat	2
RefVolat	15
CoefVolat	5
FirstLowOrMore	2
FirstHighOrMore	2
WaitForXtrem	2
Unité pour Brackets etc.	ATR
Envergure de l'ATR	40
Limites Multiples	Non
Stops Multiples	Non
Information	
Raccourci Clavier	

**Boutons Tactiques**

**Filtres**

<input checked="" type="checkbox"/> Block	11:00 - 14:00
<input type="checkbox"/> EL_Mogalef_Trend_F...	1, 1, 1, 1, 1, 0, 0, 0, 1, 90, 150, 0, 1

**Indicateurs**

<input type="checkbox"/> Trading	76, 24, 40, 60
<input type="checkbox"/> Meta Sentimentor	1, 1
<input type="checkbox"/> EL_Bullish_Breakout...	1000, 1900, 0, 0, 0, 1, 3, 15, 10, ...

Parameter:

actuel:  min:  max:

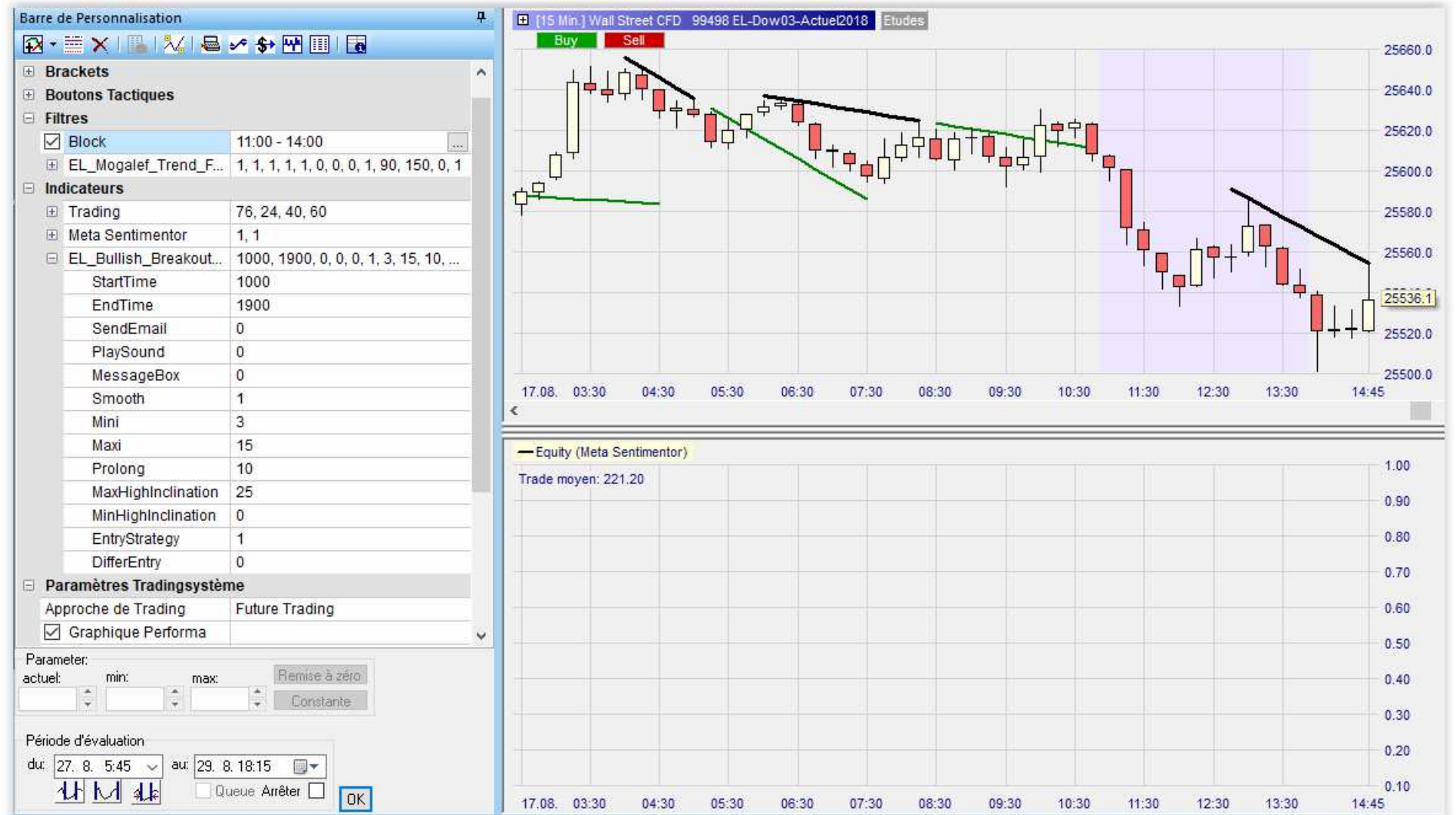
Période d'évaluation

du: 27. 8. 5:45 au: 29. 8. 18:15  Queue Arrêter



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities!"

Les performances avant production



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only op

En production  
début 2018



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

La  
performance  
actuelle



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Les problèmes détectés



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

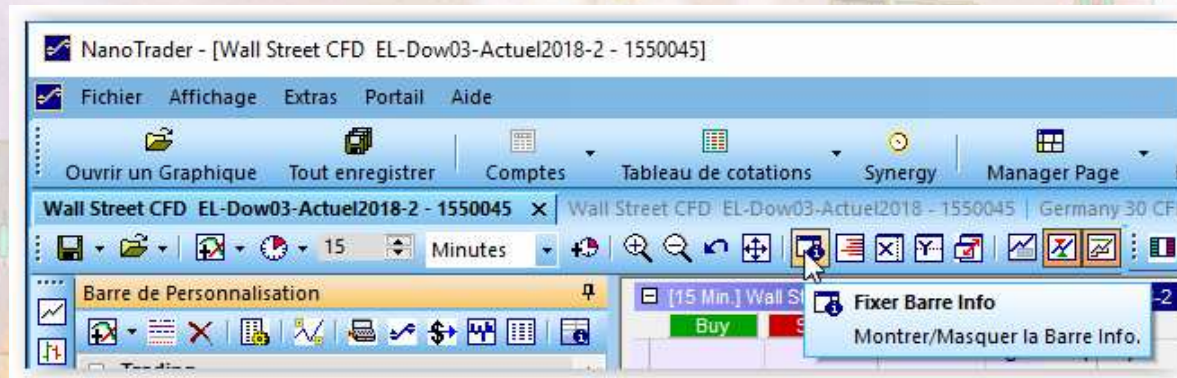
## Enchaînement de soubresauts



## Comment remédier à ces défauts ?

- Vérifier les paramètres généraux du système?
- Corriger le stop suiveur (stop intelligent) pour qu'il suive plus rapidement les cours?
- Introduire un nouveau stop prenant le relais en cas de brusque hausse des cours ?

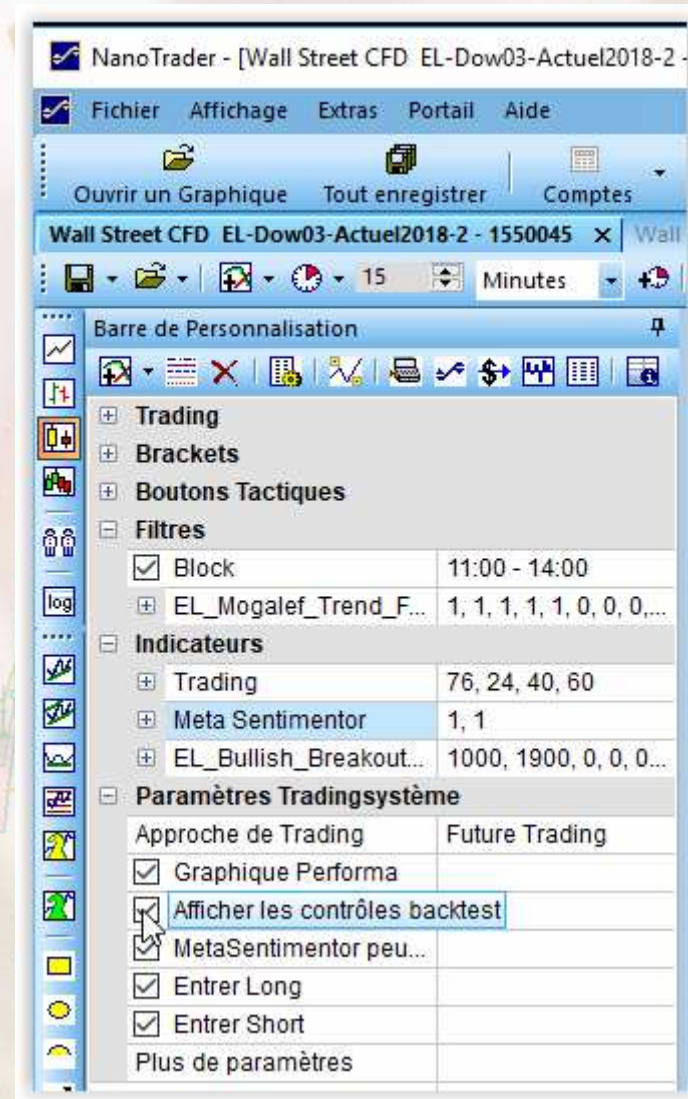
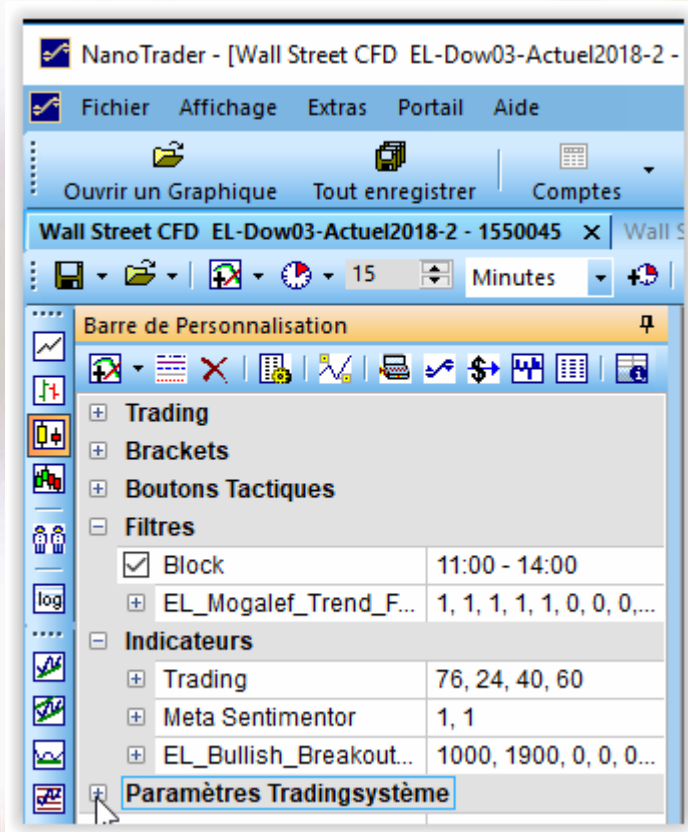
## Préparation de la NanoTrader pour l'étude des solutions



- Afficher la « barre de personnalisation ».
- Fixer la barre d'Info.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



- Déplier les paramètres trading système.
- Cocher le graphique performance et « afficher les contrôles backtest ».



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

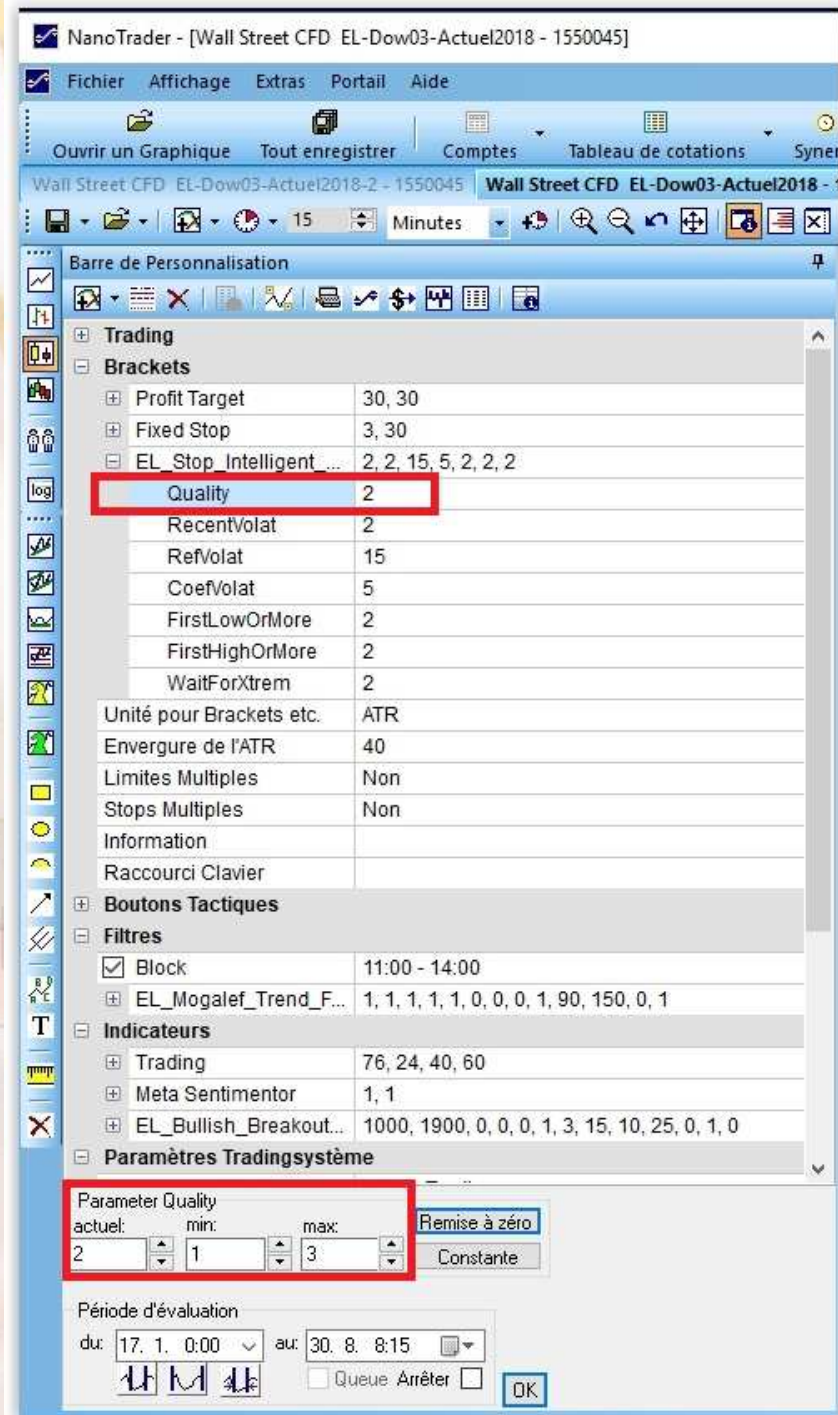
Vous devez bien  
sur reproduire le  
système si vous  
voulez refaire le  
travail d'analyse  
qui va suivre.

The screenshot displays the NanoTrader software interface, specifically the 'Barre de Personnalisation' (Customization Bar) window. The window title is 'NanoTrader - [Wall Street CFD EL-Dow03-Actuel2018 - 1550045]'. The main menu includes 'Fichier', 'Affichage', 'Extras', 'Portail', and 'Aide'. The toolbar contains various icons for charting and trading, with a time interval set to '15 Minutes'. The 'Barre de Personnalisation' window is open, showing a list of trading parameters and indicators. The parameters are organized into several sections: 'Trading', 'Brackets', 'Boutons Tactiques', 'Filtres', 'Indicateurs', and 'Paramètres Tradingsystème'. Each section contains a list of items with their respective values or settings.

Section	Item	Value
Trading	Profit Target	30, 30
	Fixed Stop	3, 30
	EL_Stop_Intelligent_...	2, 2, 15, 5, 2, 2, 2
	Unité pour Brackets etc.	ATR
	Envergure de l'ATR	40
	Limites Multiples	Non
Boutons Tactiques	Stops Multiples	Non
	Information	
Filtres	Raccourci Clavier	
	Block	11:00 - 14:00
Indicateurs	EL_Mogalef_Trend_F...	1, 1, 1, 1, 1, 0, 0, 0, 1, 90, 150, 0, 1
	Trading	76, 24, 40, 60
	Meta Sentimentor	1, 1
Paramètres Tradingsystème	EL_Bullish_Breakout...	1000, 1900, 0, 0, 0, 1, 3, 15, 10, 25, 0, 1, 0
	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 type="checkbox"/> Entrer Short		
Plus de paramètres		

## Hypothèse « Corriger le stop suiveur »

- Pour chaque paramètre nous allons demander sa **sensibilité entre des bornes mini et maxi** ce qui nous permettra d'examiner l'influence des changements envisagés.



NanoTrader - [Wall Street CFD EL-Dow03-Actuel2018 - 1550045]

Fichier Affichage Extras Portail Aide

Ouvrir un Graphique Tout enregistrer Comptes Tableau de cotations Syner

Wall Street CFD EL-Dow03-Actuel2018-2 - 1550045 Wall Street CFD EL-Dow03-Actuel2018 - 1

15 Minutes

Barre de Personnalisation

Trading

Brackets

Profit Target	30, 30
Fixed Stop	3, 30
EL_Stop Intelligent ...	2, 2, 15, 5, 2, 2, 2
Quality	2
RecentVolat	2
RefVolat	15
CoefVolat	5
FirstLowOrMore	2
FirstHighOrMore	2
WaitForXtrem	2
Unité pour Brackets etc.	ATR
Envergure de l'ATR	40
Limites Multiples	Non
Stops Multiples	Non
Information	
Raccourci Clavier	

Boutons Tactiques

Filtres

Block	11:00 - 14:00
EL_Mogalef_Trend_F...	1, 1, 1, 1, 1, 0, 0, 0, 1, 90, 150, 0, 1

Indicateurs

Trading	76, 24, 40, 60
Meta Sentimentor	1, 1
EL_Bullish_Breakout...	1000, 1900, 0, 0, 0, 1, 3, 15, 10, 25, 0, 1, 0

Paramètres Tradingystème

Parameter Quality

actuel: 2 min: 1 max: 3

Remise à zéro

Constante

Période d'évaluation

du: 17. 1. 0:00 au: 30. 8. 8:15

Queue Arrêter

OK

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- Après avoir déterminé les valeurs mini et maxi du paramètre, un clic droit sur celui-ci permet de demander la sensibilité de ce paramètre.

The screenshot shows the NanoTrader software interface. The main window displays a candlestick chart for 'Wall Street CFD EL-Dow03-Actuel2018 - 1550045'. The 'Brackets' section is expanded, showing a table of parameters:

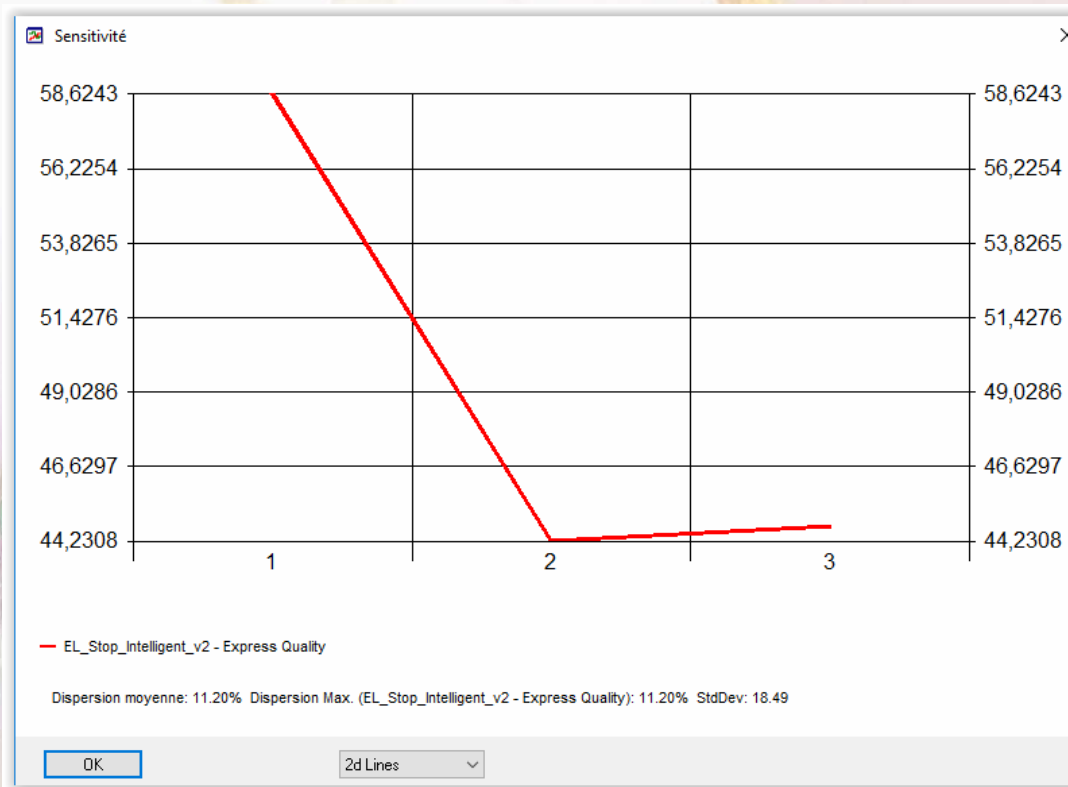
Parameter	Value
Profit Target	30, 30
Fixed Stop	3, 30
EL_Stop_Intelligent_...	2, 2, 15, 5, 2, 2, 2
Quality	2

A context menu is open over the 'Quality' parameter, listing various options. The option 'Sensibilité du Paramètre ...' is highlighted. Below the table, the 'Paramètres Tradingystème' section is visible, showing the 'Parameter Quality' settings:

Parameter Quality  
actuel: 2 min: 1 max: 3  
Buttons: Remise à zéro, Constante  
Période d'évaluation  
du: 17. 1. 0:00 au: 30. 8. 8:15  
Queue Arrêter  OK

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



- Ici apparaît la sensibilité du paramètre « Quality » du Stop Intelligent (stop suiveur).
- Le trade moyen est de 58 points pour une valeur de 1 du paramètre, de 44 points pour une valeur de 2 (la valeur actuelle de notre paramètre) et de 44 points pour une valeur de 3.
- Ce paramètre détermine combien de bougies à droite et à gauche de chaque creux sont nécessaires pour que le creux soit pris en considération par le stop suiveur.
- On voit que la valeur 1 est plus favorable que la valeur actuelle (2) car le trade moyen est plus élevé. Avec une valeur de 1 le stop détectera plus de bas et sera donc globalement plus serré.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- On demande ensuite la courbe de la valeur du trade moyen en fonction du paramètre suivant (RecentVolat) entre 1 et 12.
- On procédera toujours de la même manière pour l'analyse de chaque paramètre: déterminer entre quelles valeurs on veut l'analyse, puis demander l'affichage du graphe déterminant la valeur du Trade moyen en fonction de la valeur du paramètre examiné.

The screenshot shows the NanoTrader software interface. The main window displays a list of parameters under the 'Trading' section. The 'RecentVolat' parameter is highlighted with a red circle and a red arrow pointing to its context menu. The context menu is open, showing various options, with 'Sensibilité du Paramètre ...' selected. Below the parameter list, the 'Parameter RecentVolat' configuration window is visible, showing the current value (2) and the range (min: 1, max: 12) set in red boxes. The 'Remise à zéro' button is also visible.

NanoTrader - [Wall Street CFD EL-Dow03-Actuel2018 - 1550045]

Fichier Affichage Extras Portail Aide

Ouvrir un Graphique Tout enregistrer Comptes Tableau de cotations Syne

Wall Street CFD EL-Dow03-Actuel2018-2 - 1550045 Wall Street CFD EL-Dow03-Actuel2018 -

15 Minutes

Barre de Personnalisation

Trading

Brackets

Profit Target	30, 30
Fixed Stop	3, 30
EL_Stop_Intelligent_...	2, 2, 15, 5, 2, 2, 2
Quality	2
RecentVolat	
RefVolat	
CoefVolat	
FirstLowOrM	
FirstHighOrM	
WaitForXtr	

Unité pour Brackets

Envergure de l'ATR

Limites Multiples

Stops Multiples

Information

Raccourci Clavier

Boutons Tactiques

Filtres

- Block
- EL\_Mogalef\_Tre

Indicateurs

- Trading
- Meta Sentiment
- EL\_Bullish\_Bre

Paramètres Tradingystème

Parameter RecentVolat

actuel: 2 min: 1 max: 12 Remise à zéro

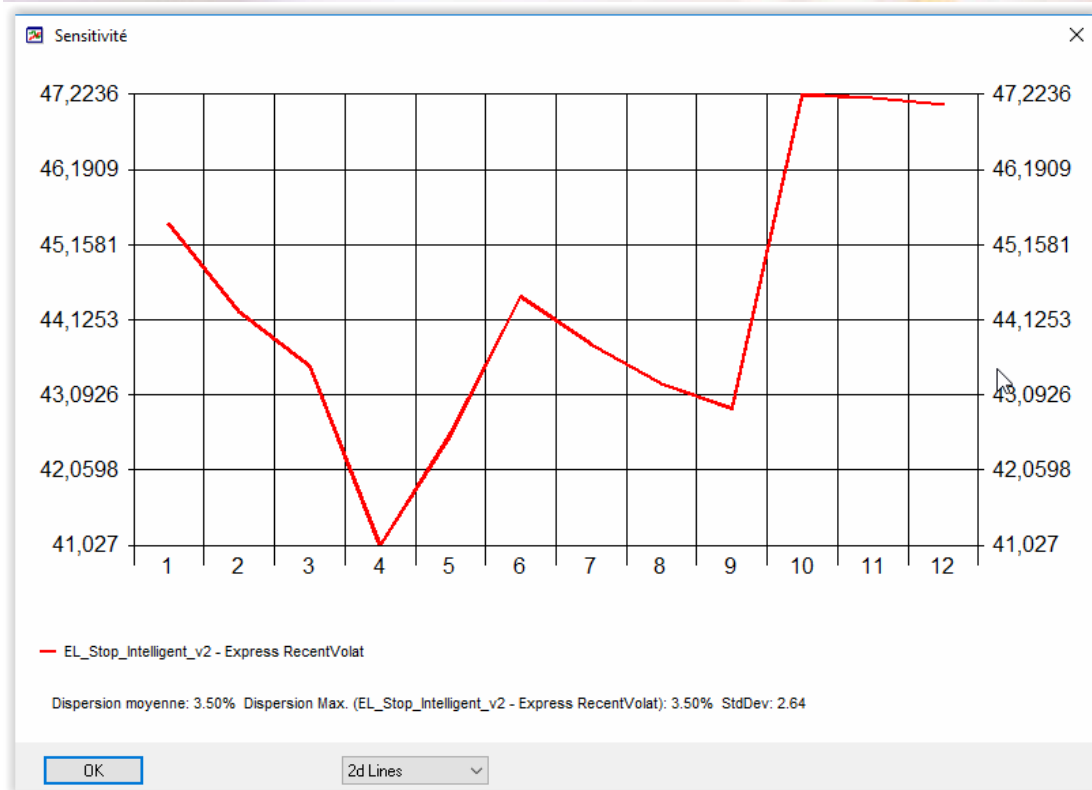
Constante

Période d'évaluation

du: 17. 1. 0:00 au: 30. 8. 8:30

Queue Arrêter OK

## Interprétation de la courbe de sensibilité



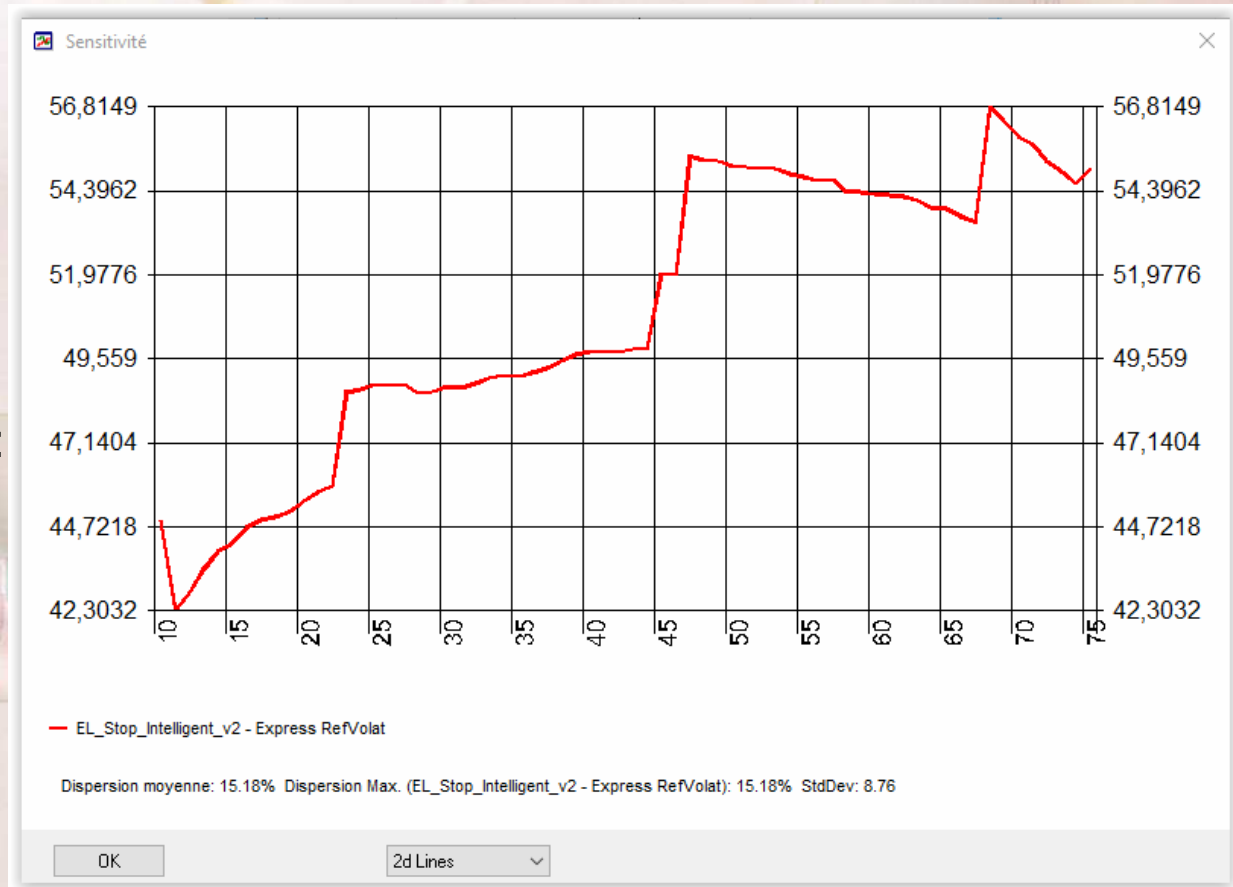
- Il n'y a pas une énorme différence de la valeur du trade moyen ni un corrélation manifeste entre la volatilité récente prise en compte par le stop et la valeur du trade moyen.
- On peut cependant observer qu'une valeur de « RecentVolat » de 1 ou supérieure à 10 donnera de meilleurs résultats que la valeur actuelle qui est de 2 bougies. Une valeur de 1 donne un stop plus réactif.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Examen du paramètre « Volatilité de référence ».

- Plus la volatilité de référence est élevée, meilleur est le trade moyen. La courbe de résultat est linéaire ce qui nous indique que la corrélation est réelle. C'est cela qui est important: la meilleure valeur du paramètre n'est pas déterminante. C'est la **corrélation entre la valeur de la performance** et la valeur du paramètre qui doit être régulière pour que l'interprétation du graphe soit valable.

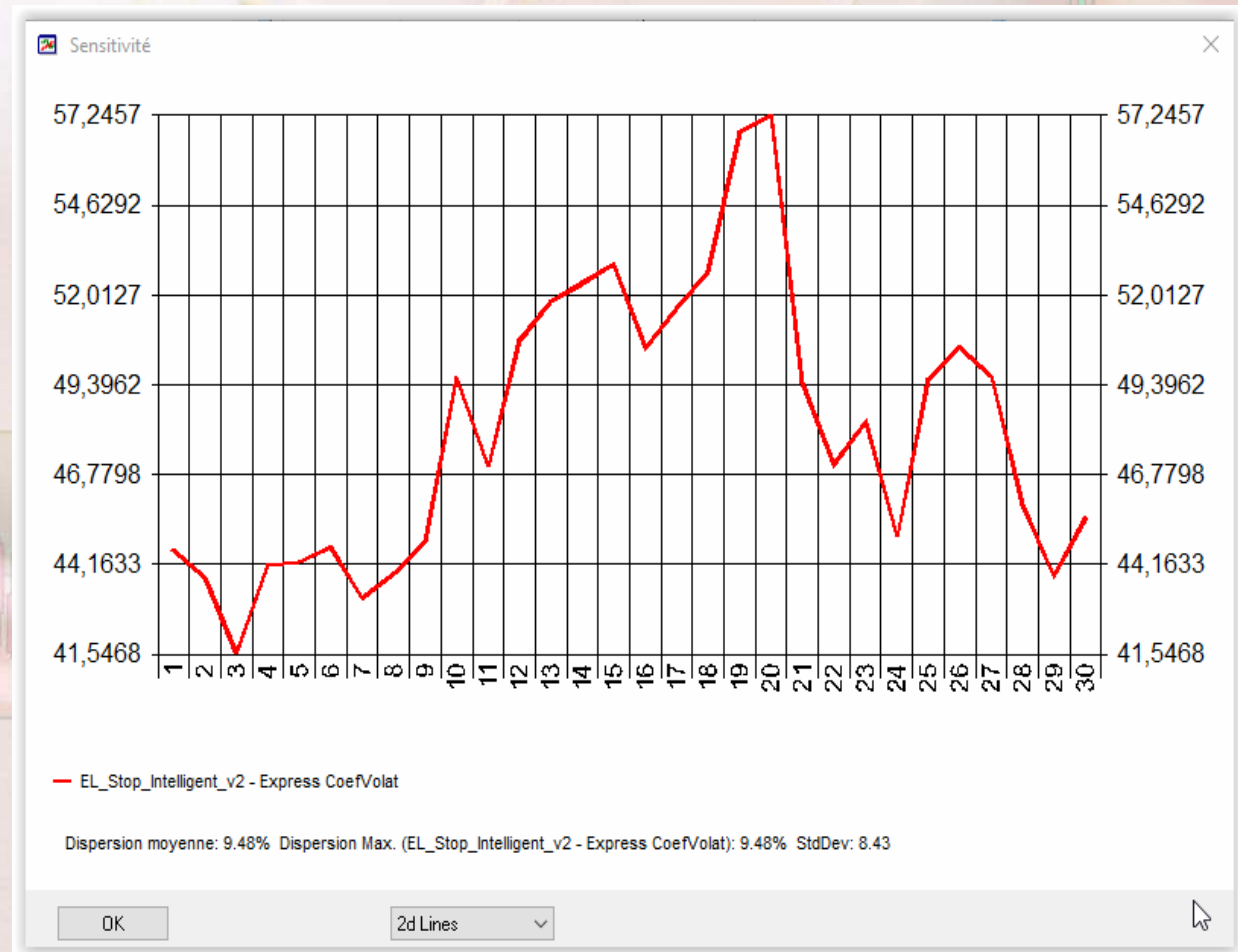


# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Examen du paramètre « CoefVolat ».

- Il s'agit de l'éloignement du stop en fonction d'un multiple de la volatilité.
- De 1 à 20 l'augmentation de la performance est manifeste.

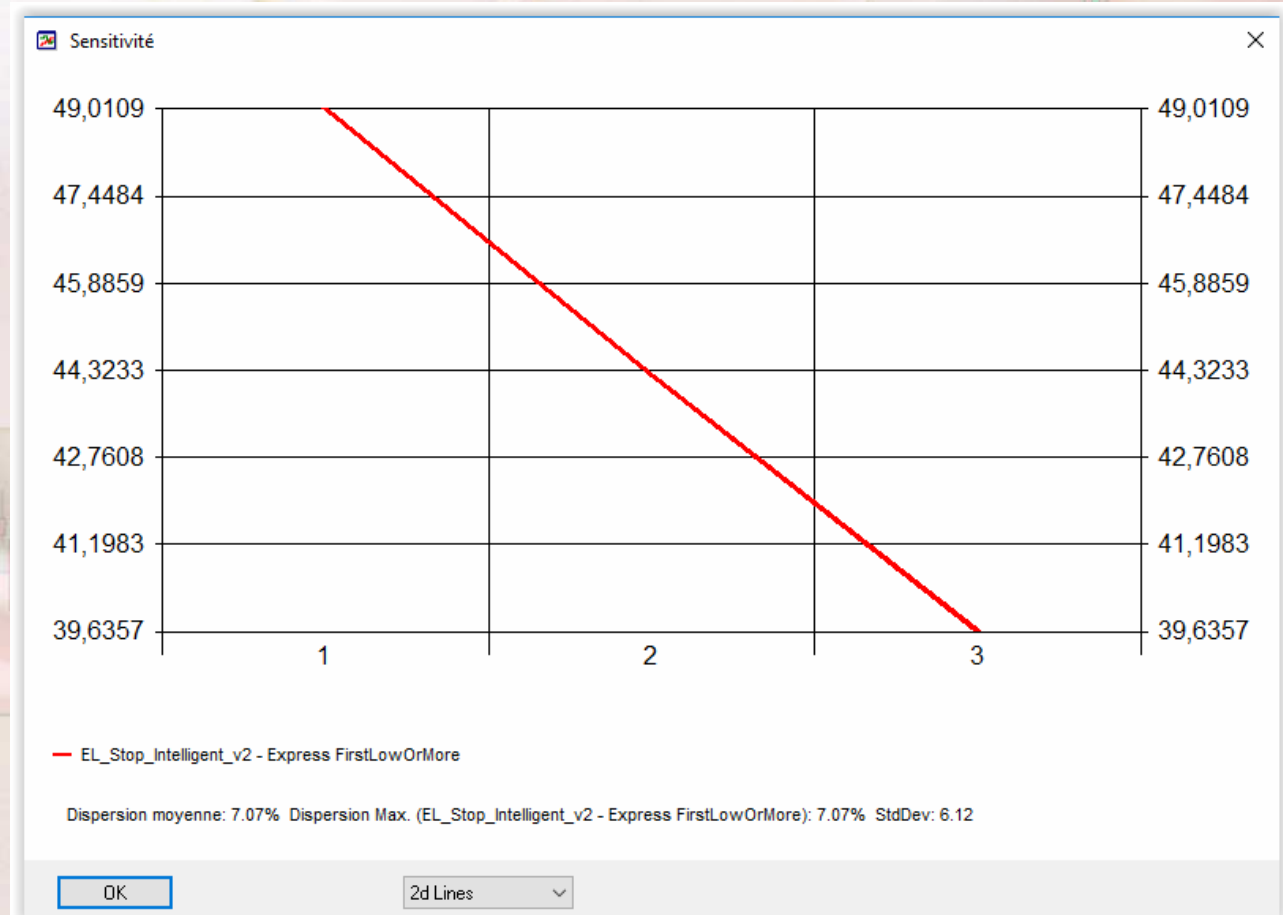


# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Examen du paramètre « First Low Or More ».

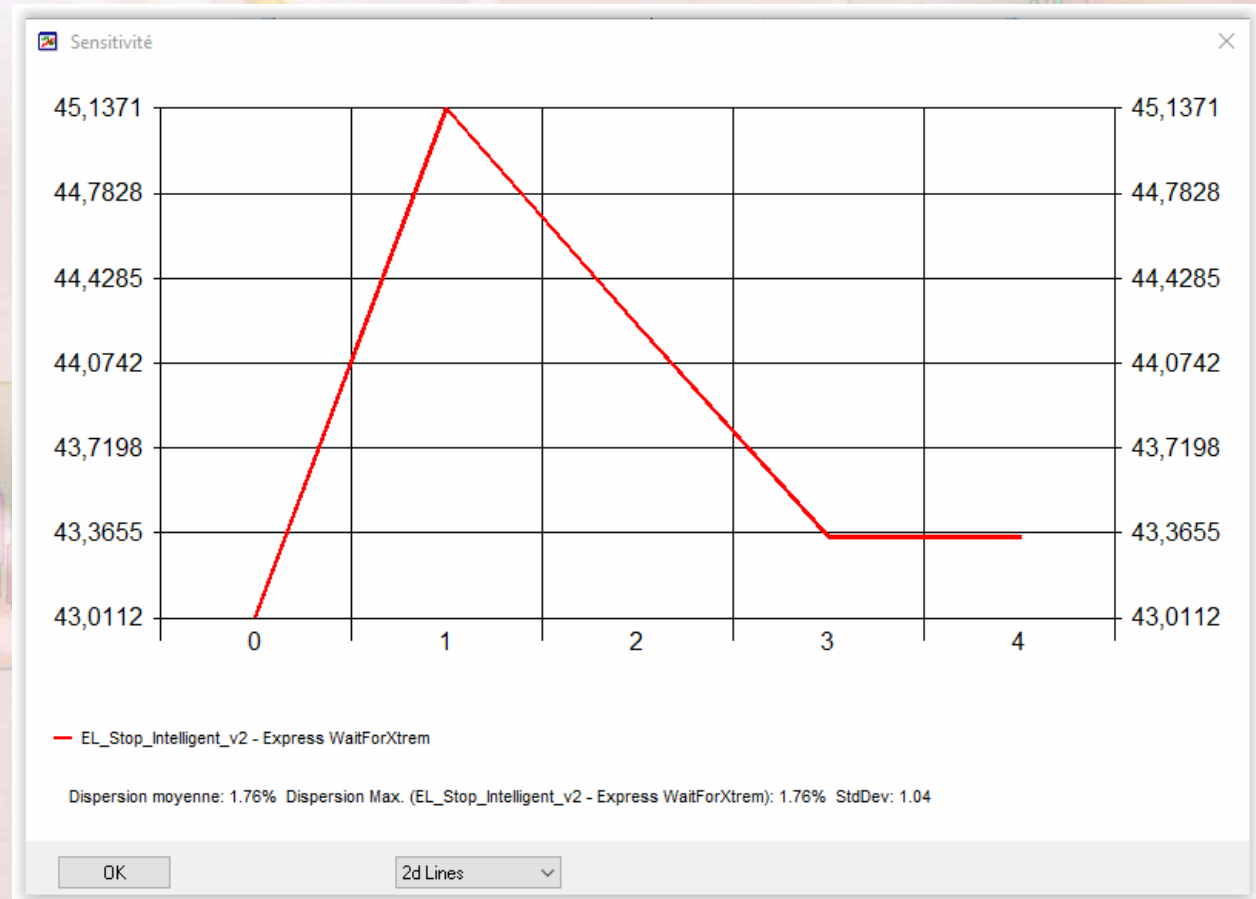
- Plus le stop regarde un nombre de bas précédents importants, moins bon est le trade moyen.



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- Examen du paramètre « Wait For Xtrem.  
(Le stop attend qu'un sommet soit dépassé pour s'ajuster)
- Pas de corrélation, cependant le paramètre fixé à 1 extrême ressort un petit peu.



## Nous avons donc pour les paramètres du Stop Intelligent :

- La « qualité » des retournements pris en compte est meilleure pour 1 bougie de chaque côté des extrêmes.
- La volatilité récente meilleure pour 1 bougie ou supérieure à 10 bougies.
- La volatilité de référence est meilleure pour une valeur élevée ( $>50$ ).
- Pour le paramètre « First Low or more », il est préférable de se limiter à un bas plutôt que d'en examiner plusieurs.
- Demander au stop de s'ajuster quand le dernier haut est dépassé est légèrement meilleur que notre paramétrage actuel de 2. Le stop sera ainsi plus réactif.

## Paramètres retenus pour changement :

Il faut surtout rester logique dans nos choix de changement de paramètres et ne pas oublier notre but: rendre le stop plus rapide pour diminuer les pertes sur de brusques mouvements du marché.

- Baisser la qualité de 2 à 1 permettra au stop de détecter plus de creux pour s'adapter au marché et donc serrera le stop. C'est ce que nous recherchons.
- Tenir compte uniquement de la volatilité de la dernière bougie (1 au lieu de 2) donnera plus de réactivité au stop intelligent.
- Prendre en compte juste le dernier bas (1) et non plus les deux derniers (2) permettra au stop de suivre plus rapidement le marché.
- Par contre, modifier la volatilité de référence ne paraît pas extrêmement logique : il faut se méfier, cela pourrait être une optimisation dangereuse.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- On change donc les trois paramètres logiques:

- Puis on vérifie l'apport du changement de « RefVolat »

EL_Stop_Intelligent_...	1, 1, 15, 5, 1, 2, 2
Quality	1
RecentVolat	1
RefVolat	15
CoefVolat	5
FirstLowOrMore	1
FirstHighOrMore	2
WaitForXtrem	2

EL\_Stop\_Intelligent\_... 1, 1, 15, 5, 1, 2, 2

Quality	1
RecentVolat	1
RefVolat	15
CoefVolat	5
FirstLowOr	1
FirstHighOr	2
WaitForXtre	2

Unité pour Bracke  
Envergure de l'ATF  
Limites Multiples  
Stops Multiples  
Information  
Raccourci Clavier

**Boutons Tactique**

**Filtres**

- Block
- EL\_Mogalef\_T

**Indicateurs**

- Trading
- Meta Sentimen
- EL\_Bullish\_Br

**Paramètres Tradi**

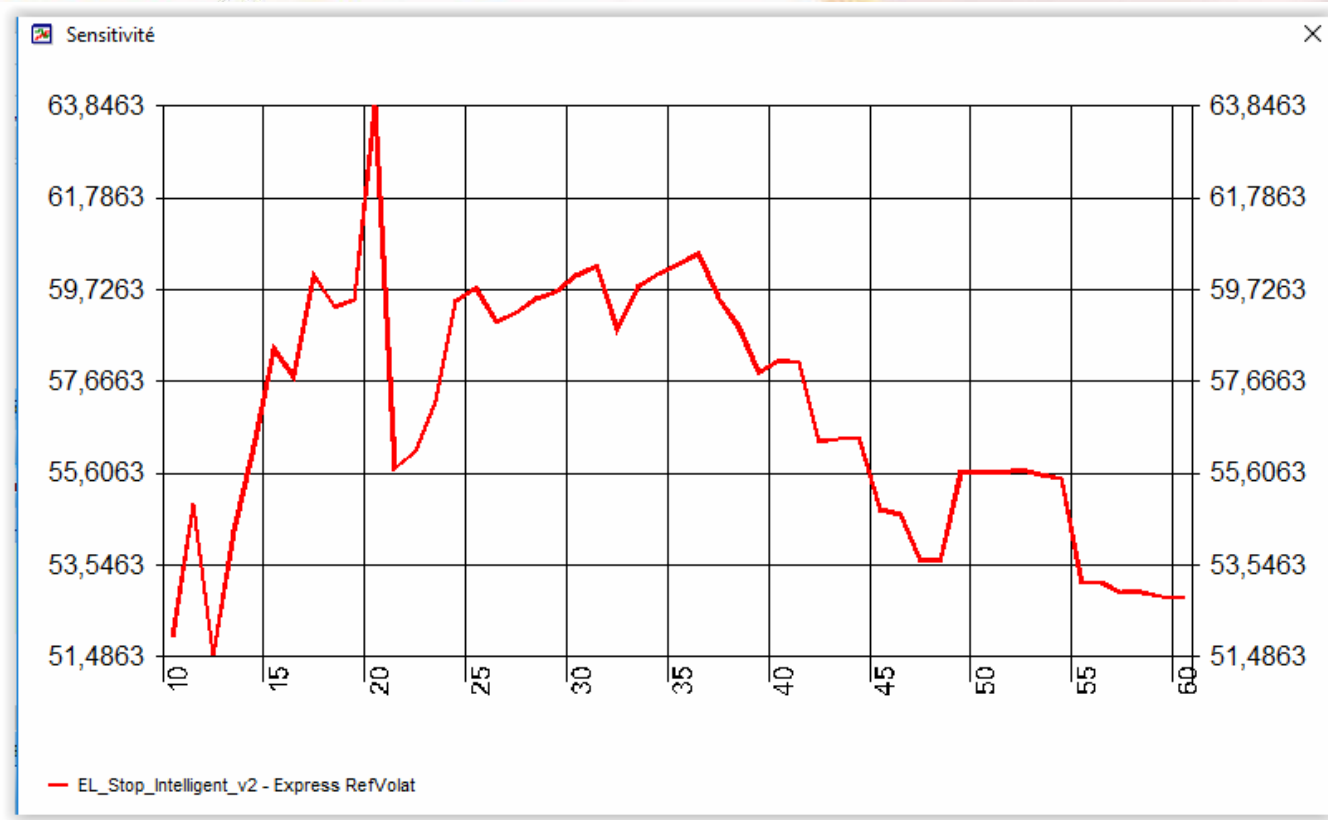
Parameter RefVolat

actuel:	min:	max:	Remise à zéro
15	10	60	Constante

Période d'évaluation

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

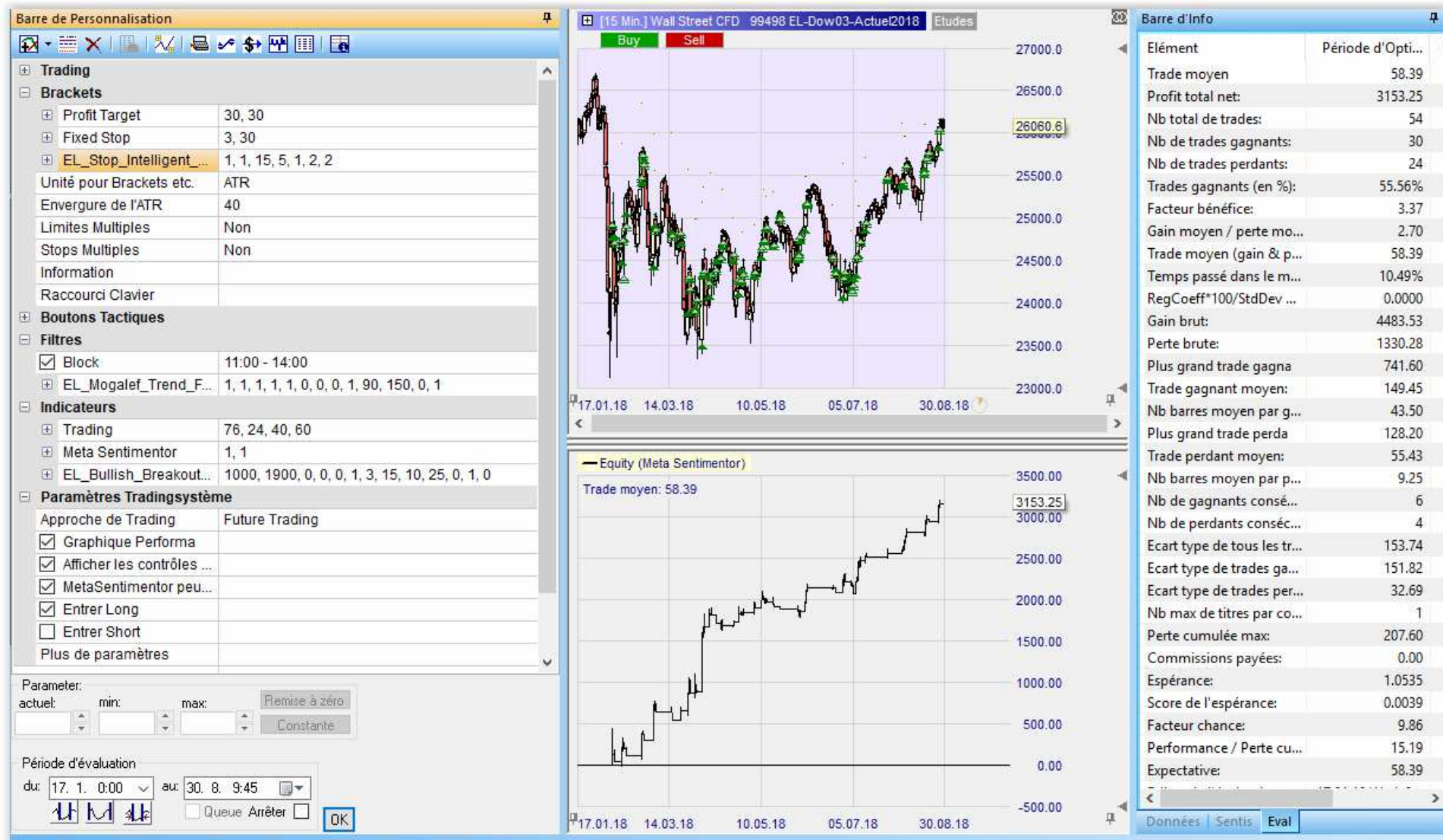


- L'augmentation de performance jusqu'à 50 a disparu. Elle a lieu uniquement entre 10 et 20.
- Mais adopter une valeur de 20 serait se situer sur un pic d'optimisation. **Il est donc préférable de ne pas toucher à ce paramètre** et de laisser le stop intelligent calculer la volatilité sur 15 périodes comme précédemment.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

En adaptant les paramètres du stop suiveur à nos observations nous obtenons le graphe de performance suivant :



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Que devient notre plus gros retournement de gain ?



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

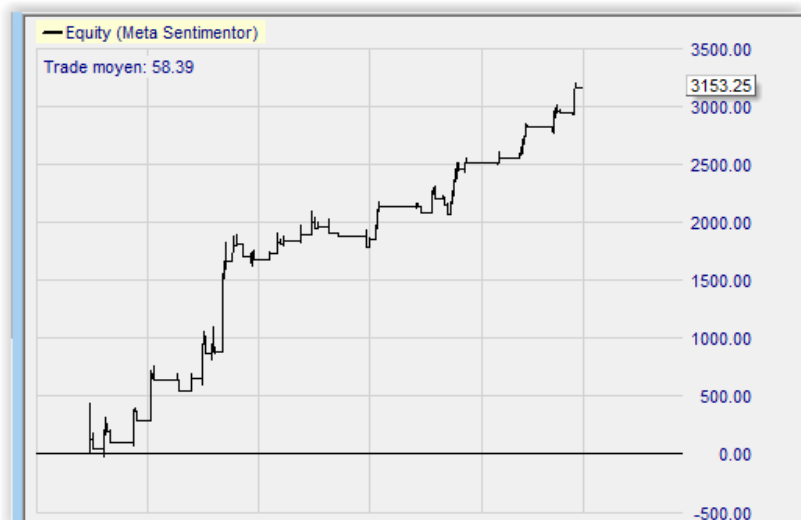
## Que devient notre plus grand enchaînement de pertes ?



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Comparaison sur 7 mois :



Elément	Période d'Opti...
Trade moyen	44.23
Profit total net:	2078.85
Nb total de trades:	47
Nb de trades gagnants:	20
Nb de trades perdants:	27
Trades gagnants (en %):	42.55%
Facteur bénéfique:	2.12
Gain moyen / perte mo...	2.86
Trade moyen (gain & p...	44.23
Temps passé dans le m...	15.49%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0002
Gain brut:	3933.72
Perte brute:	1854.88
Plus grand trade gagna	679.10
Trade gagnant moyen:	196.69
Nb barres moyen par g...	93.00
Plus grand trade perda	166.50
Trade perdant moyen:	68.70
Nb barres moyen par p...	14.74
Nb de gagnants consé...	5
Nb de perdants consé...	4
Ecart type de tous les tr...	171.23
Ecart type de trades ga...	161.21
Ecart type de trades per...	41.93
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	345.50
Commissions payées:	0.00
Espérance:	0.6438
Score de l'espérance:	0.0021
Facteur chance:	3.70
Performance / Perte cu...	6.02
Expectative:	44.23
Début de l'évaluation:	17.01.18 Wed 0...
Fin de l'évaluation:	30.08.18 Thu 15

Elément	Période d'Opti...
Trade moyen	58.39
Profit total net:	3153.25
Nb total de trades:	54
Nb de trades gagnants:	30
Nb de trades perdants:	24
Trades gagnants (en %):	55.56%
Facteur bénéfique:	3.37
Gain moyen / perte mo...	2.70
Trade moyen (gain & p...	58.39
Temps passé dans le m...	10.47%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0000
Gain brut:	4483.53
Perte brute:	1330.28
Plus grand trade gagna	741.60
Trade gagnant moyen:	149.45
Nb barres moyen par g...	43.50
Plus grand trade perda	128.20
Trade perdant moyen:	55.43
Nb barres moyen par p...	9.25
Nb de gagnants consé...	6
Nb de perdants consé...	4
Ecart type de tous les tr...	153.74
Ecart type de trades ga...	151.82
Ecart type de trades per...	32.69
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	207.60
Commissions payées:	0.00
Espérance:	1.0535
Score de l'espérance:	0.0039
Facteur chance:	9.86
Performance / Perte cu...	15.19
Expectative:	58.39
Début de l'évaluation:	17.01.18 Wed 0...
Fin de l'évaluation:	30.08.18 Thu 15

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities"

## Et si l'on mettait un objectif plus près ?

Barre de Personnalisation

Trading

Brackets

Profit Target	30, 30
Target Long: *ATR	30
Target Short: *ATR	30
Fixed Stop	3, 30
EL_Stop_Intelligent_...	1, 1, 15, 5, 1, 2, 2
Quality	1
RecentVolat	1
RefVolat	15
CoefVolat	5
FirstLowOrMore	1
FirstHighOrMore	2
WaitForXtrem	2

Unité pour Brackets etc. ATR

Envergure de l'ATR 40

Limites Multiples Non

Stops Multiples Non

Information

Raccourci Clavier

Boutons Tactiques

Filtres

Block 11:00 - 14:00

EL\_Mogalef\_Trend\_F... 1, 1, 1, 1, 1, 0, 0, 1, 90, 15

Indicateurs

Trading 76, 24, 40, 60

Meta Sentimentor 1, 1

EL\_Bullish\_Breakout... 1000, 1900, 0, 0, 0, 1, 3, 15,

Paramètres Tradingsystème

Parameter Target Long: \*ATR:

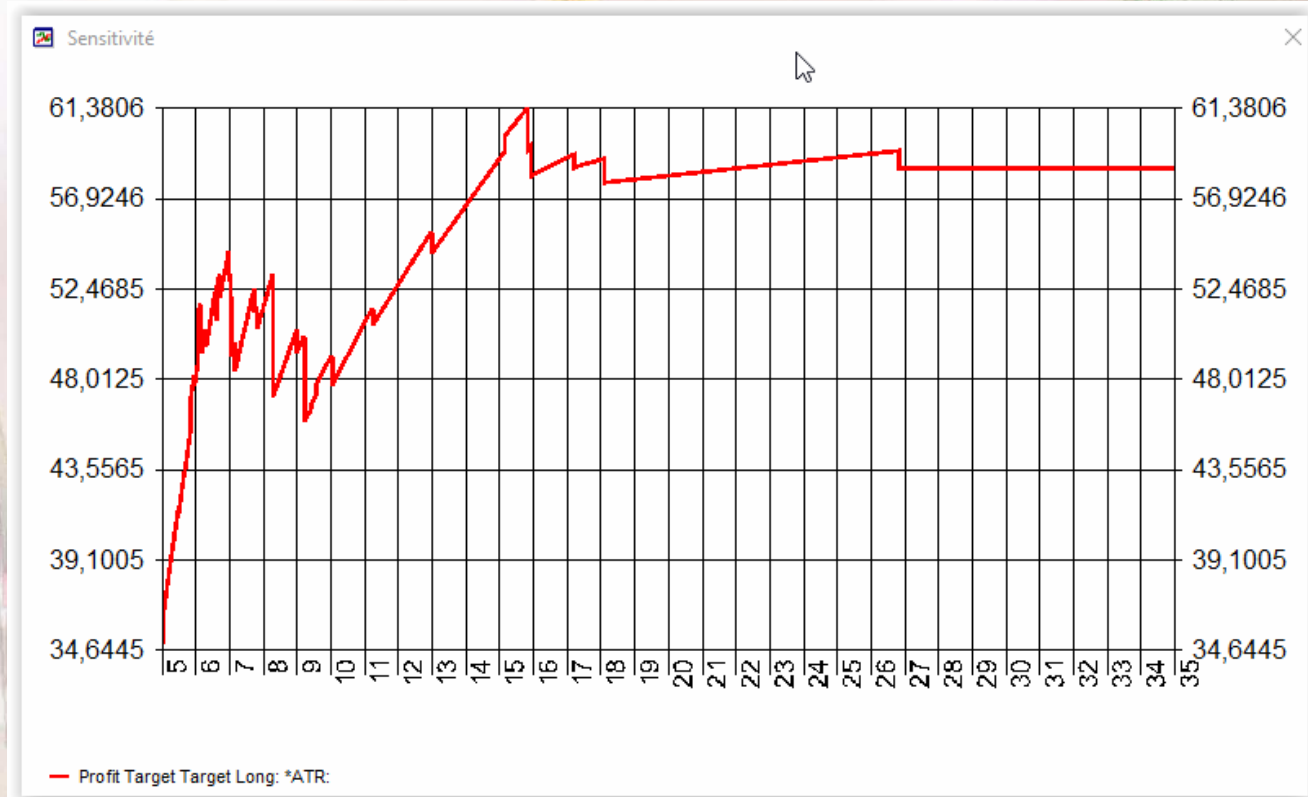
actuel: 30.00 min: 5.00 max: 35.00 Remise à zéro

Constante

Période d'évaluation

du: 17. 1. 0:00 au: 30. 8. 16:00

Queue Arrêter  OK



Globalement, on observe une augmentation de la performance jusqu'à 15 ATR puis une stagnation. Baisser l'objectif à 15ATR pourrait cependant augmenter un peu le nombre de trades, et donc le gain global.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Ceci semble satisfaisant.

- Cependant il est également possible d'envisager de nouvelles pistes, comme l'adjonction d'un nouveau stop particulièrement adapté à corriger les défauts constatés sur notre système de base.
- Car la plus simple des solutions pourrait être la meilleure !

## Adjonction d'un stop complémentaire



- Par exemple, le Trailing Stop EOP paraît bien adapté pour suivre un brusque décalage du marché et garantir les gains.
- Ajoutons le **au système de base** qui comptera alors 3 stops: 1 fixe à 3ATR, le stop suiveur intelligent et le trailing stop EOP.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- Nous avons un seul paramètre à examiner pour ce stop: il s'agit de l'écartement (en nombre d'ATR) du stop par rapport aux cours.

The screenshot displays the 'Brackets' configuration window in a trading application. The 'Stop Long: \*ATR' parameter is highlighted in a red box. A context menu is open over it, with 'Sensibilité du Paramètre ...' selected. Below the window, a control panel for 'Parameter Stop Long: \*ATR' shows 'actuel: 10.00', 'min: 1.00', and 'max: 10.00' with 'Remise à zéro' and 'Constante' buttons.

Parameter	Value
Profit Target	30.00, 30
Target Long: *ATR	30.00
Target Short: *ATR	30
Fixed Stop	3, 30
EL_Stop_Intelligent_...	2, 2, 15, 5, 2, 2, 2
Trailing Stop EoP	10, 30
Stop Long: *ATR	10.00
Stop Short: *ATR	30

Parameter Stop Long: \*ATR:  
actuel: 10.00 min: 1.00 max: 10.00  
Remise à zéro  
Constante

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

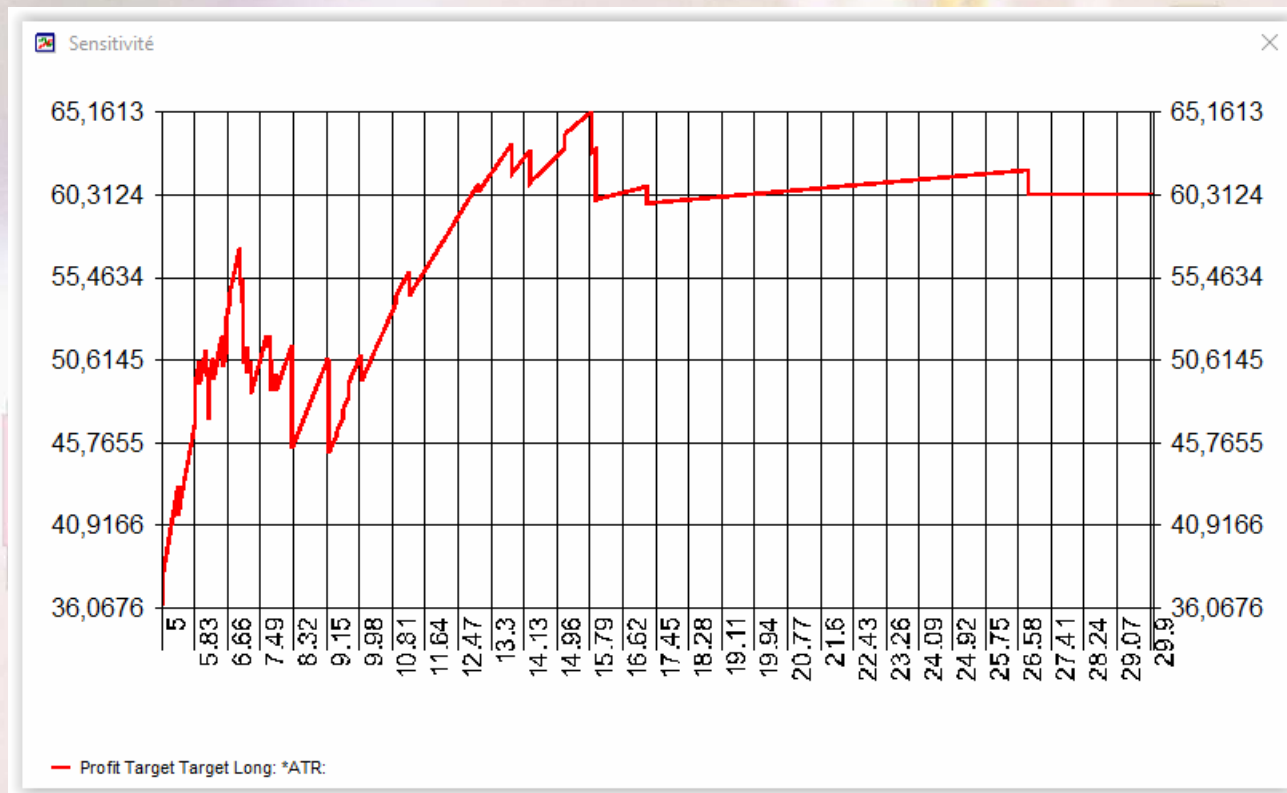


- Un stop trop serré diminue la performance.
- La performance augmente jusqu'à 4.7 environ puis décroît doucement jusqu'à ce que le stop n'ait plus aucune influence sur le résultat (il n'est jamais touché, seuls les autres stops interviennent).
- **Adopter une valeur de 4ATR semble correct.**

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- Une fois ce trailing stop à 4 ATR intégré au système, il serait intéressant de vérifier si tous les autres paramètres sont corrects.
- Pour l'exemple nous n'en examinerons qu'un seul : l'objectif.
- Voici l'étude du **gain moyen** par trade en fonction de la **distance de l'objectif** (en nombre d'ATR):



A partir d'un objectif à 13 ATR le gain moyen reste à peu près constant.

Mais n'oublions pas que plus on rapproche l'objectif, plus le nombre de trades augmente.

Il serait intéressant de visualiser l'influence de la distance de l'objectif sur la gain total.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Il nous faut demander au logiciel d'examiner en priorité le gain total :

The screenshot displays the Mogalef Trading software interface. The main window shows a candlestick chart for 'Wall Street CFD EL-Dow03-Actuel2018-2 - 1550045'. A 'Paramètres Evalueur' dialog box is open, showing the 'Contraintes de Trading' tab. The 'Objectif d'Optimisation' is set to 'Performance Totale'. The 'Période de Contrôle' is set to '0'.

Key elements in the dialog box:

- 1**: A red circle highlights the 'Plus de paramètres' button at the bottom of the left sidebar.
- 2**: A red box highlights the 'Contraintes de Trading' tab in the dialog box.
- 3**: A red box highlights the 'Performance Totale' option in the 'Objectif d'Optimisation' dropdown menu.
- 4**: A red box highlights the 'OK' button at the bottom right of the dialog box.

Other visible parameters in the dialog box include:

- Trade moyen: Performance Totale
- pourcentage profitable: 10000 %
- Score espérance:  $[(PG \times GM - PP \times PM) / PM]$
- Score espérance:  $[(PG \times MG - PP \times MP) / MP] \times \text{Opportunité}$
- gagnants consécutifs max - perdants consécutifs max: 10000
- Facteur Profit: 10000
- performance totale / Seuil de perte: 10000
- Facteur Chance: 10000
- Trade moyen: 10000
- RegCoeff \* 100 / Valeur de StdDev: 10000
- seuil de pertes max. relatif: 10000 %
- trades perdants consécutifs max.: 10000
- 0 % <= nombre de trades gagnants \* 100% / nombre total de trades
- 0 <= facteur profit
- 10000 <= Profit net
- Paramètre dispersion max.: 10000 %
- Paramètre dispersion moyen: 10000 %
- sur 10 Etapes
- Périodes de Contrôle: 0 % de Période d'Évaluation
- Pas de Contrainte

At the bottom of the software window, the status bar shows: 17.01.18 Wed 00:00 | O: 25847.5 C: 25824.5 H: 25855.5 L: 25810.5 V:0 Span: 0.17% 450 Ticks

# Mogalef 7

"There's no certitud

Barre de Personnalisation

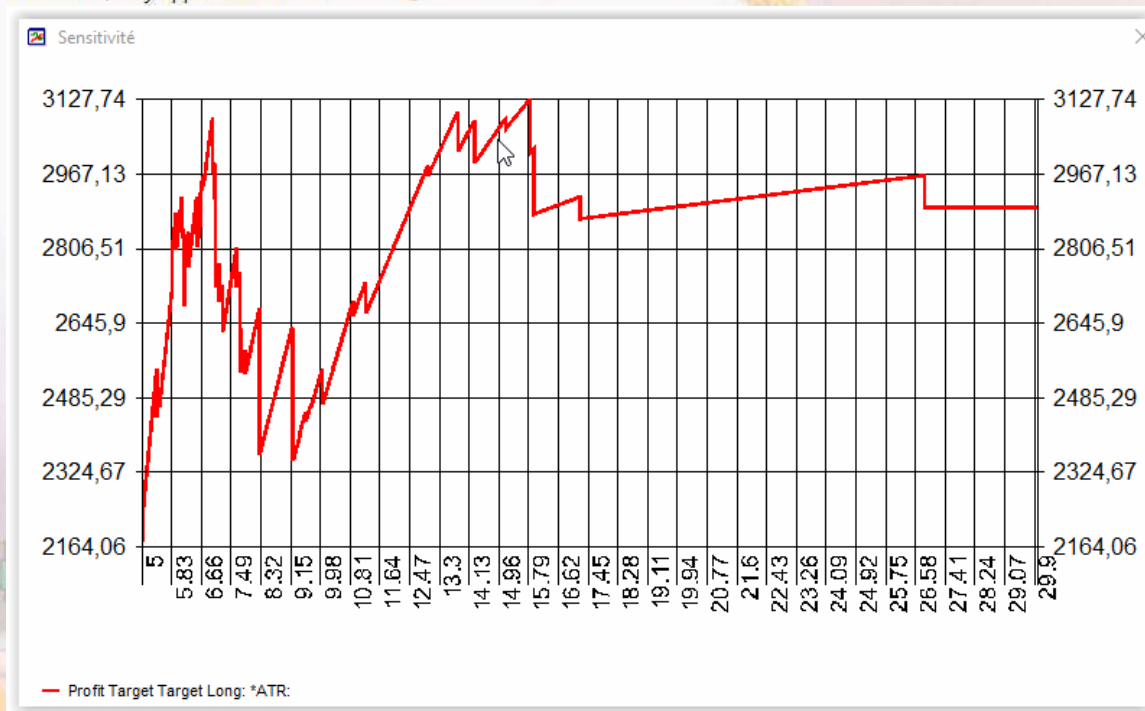
The screenshot displays the 'Barre de Personnalisation' (Customization Bar) of the Mogalef 7 software. The bar is organized into several sections:

- Trading**
  - Brackets**
    - Profit Target: 30.00, 30
    - Target Long: \*ATR** (highlighted in the context menu)
    - Target Short: \*ATR
  - Fixed Stop
  - EL\_Stop\_Intelligent\_...
  - Trailing Stop EoP**
    - Stop Long: \*ATR
    - Stop Short: \*ATR
  - Unité pour Brackets etc.
  - Envergure de l'ATR
  - Limites Multiples
  - Stops Multiples
  - Information
  - Raccourci Clavier
- Boutons Tactiques**
- Filtres**
  - Block
  - EL\_Mogalef\_Trend\_F...
- Indicateurs**
  - Trading
  - Meta Sentimentor
  - EL\_Bullish\_Breakout...: 1000, 1900, 0, 0, 0, 1, 3, 15, 10, 25, 0, 1, 0
- Paramètres Tradingsystème**
  - Approche de Trading: Future Trading
  - Graphique Performa
  - Afficher les contrôles ...
  - MetaSentimentor peu...

At the bottom, the 'Parameter Target Long: \*ATR:' section shows the current value (actuel: 30.00) and a range (min: 5.00, max: 30.00). A red box highlights the 'min' and 'max' input fields. To the right of these fields are buttons for 'Remise à zéro' (Reset to zero) and 'Constante'.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



- Nous avons cette fois le **gain total du système** en fonction de la **distance de l'objectif** (et non plus le gain moyen en fonction de la distance de l'objectif).
- La partie gauche de la courbe est heurtée : diminuer trop la distance de l'objectif rendrait le gain (et le système) aléatoire et irait contre le PRINCIPLE du système (prendre les grands mouvements).
- A partir de 12ATR le gain devient stable avec un plateau de gain maximum autour de 14-15.
- En mettant l'objectif à 15ATR on augmente un peu le gain car on augmente le nombre de trades et le trade moyen.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Les performances :



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

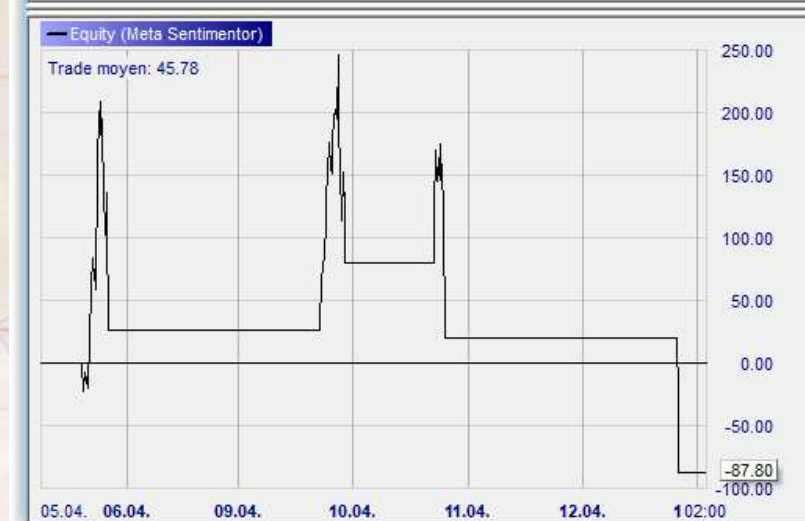
## + gros retournement



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## + gros enchaînement



# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- La diapositive suivante vous montrera les performances comparées :
- Système d'origine
- Système avec Traling stop EOP
- Système avec Trailing stop EOP et objectif à 15 ATR

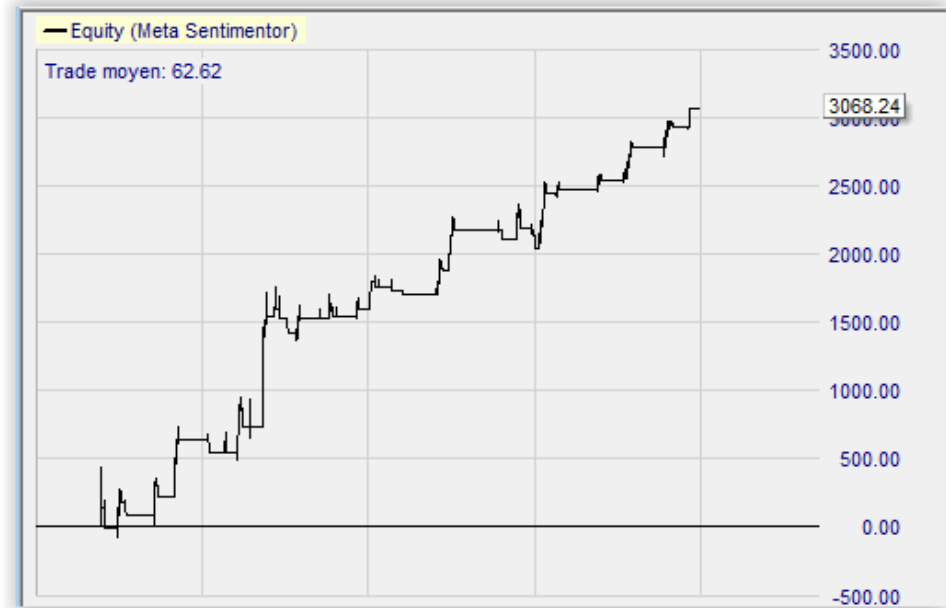
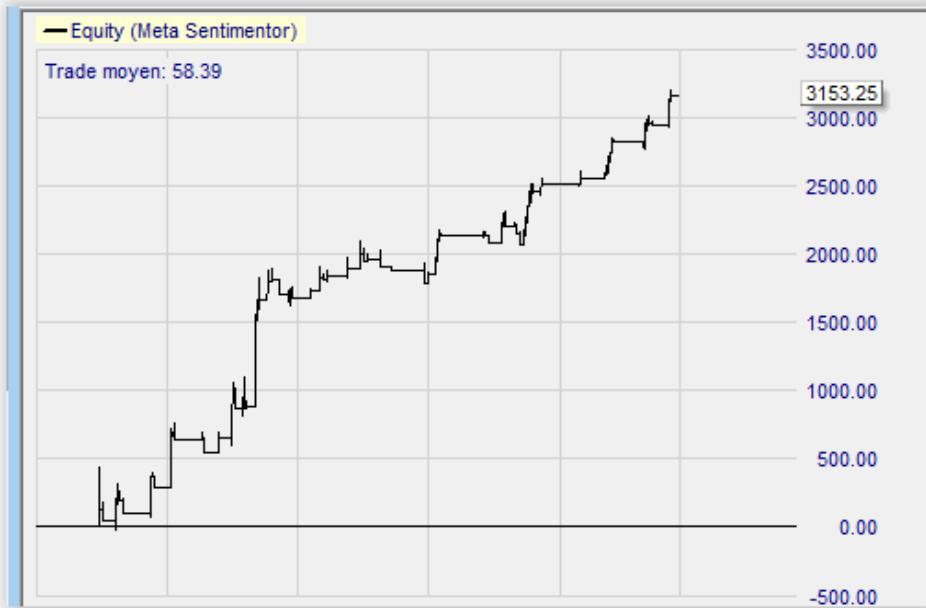
# Mo

Barre d'Info	
Élément	Période d'Opti...
Trade moyen	44.23
Profit total net:	2078.85
Nb total de trades:	47
Nb de trades gagnants:	20
Nb de trades perdants:	27
Trades gagnants (en %):	42.55%
Facteur bénéfice:	2.12
Gain moyen / perte mo...	2.86
Trade moyen (gain & p...	44.23
Temps passé dans le m...	15.49%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0002
Gain brut:	3933.72
Perte brute:	1854.88
Plus grand trade gagna	679.10
Trade gagnant moyen:	196.69
Nb barres moyen par g...	93.00
Plus grand trade perda	166.50
Trade perdant moyen:	68.70
Nb barres moyen par p...	14.74
Nb de gagnants consé...	5
Nb de perdants consé...	4
Ecart type de tous les tr...	171.23
Ecart type de trades ga...	161.21
Ecart type de trades per...	41.93
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	345.50
Commissions payées:	0.00
Espérance:	0.6438
Score de l'espérance:	0.0021
Facteur chance:	3.70
Performance / Perte cu...	6.02
Expectative:	44.23
Début de l'évaluation:	17.01.18 Wed 0...
Fin de l'évaluation:	30.08.18 Thu 15

Barre d'Info	
Élément	Période d'Opti...
Trade moyen	60.31
Profit total net:	2894.64
Nb total de trades:	48
Nb de trades gagnants:	26
Nb de trades perdants:	22
Trades gagnants (en %):	54.17%
Facteur bénéfice:	3.14
Gain moyen / perte mo...	2.66
Trade moyen (gain & p...	60.31
Temps passé dans le m...	13.05%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0001
Gain brut:	4246.42
Perte brute:	1351.78
Plus grand trade gagna	679.10
Trade gagnant moyen:	163.32
Nb barres moyen par g...	64.12
Plus grand trade perda	151.80
Trade perdant moyen:	61.44
Nb barres moyen par p...	10.68
Nb de gagnants consé...	5
Nb de perdants consé...	4
Ecart type de tous les tr...	164.01
Ecart type de trades ga...	158.63
Ecart type de trades per...	39.75
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	225.10
Commissions payées:	0.00
Espérance:	0.9815
Score de l'espérance:	0.0032
Facteur chance:	8.61
Performance / Perte cu...	12.86
Expectative:	60.31
Début de l'évaluation:	17.01.18 Wed 0...
Fin de l'évaluation:	30.08.18 Thu 15

Barre d'Info	
Élément	Période d'Opti...
Trade moyen	62.62
Profit total net:	3068.24
Nb total de trades:	49
Nb de trades gagnants:	26
Nb de trades perdants:	23
Trades gagnants (en %):	53.06%
Facteur bénéfice:	3.20
Gain moyen / perte mo...	2.83
Trade moyen (gain & p...	62.62
Temps passé dans le m...	12.23%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0000
Gain brut:	4465.32
Perte brute:	1397.08
Plus grand trade gagna	774.40
Trade gagnant moyen:	171.74
Nb barres moyen par g...	59.19
Plus grand trade perda	151.80
Trade perdant moyen:	60.74
Nb barres moyen par p...	10.70
Nb de gagnants consé...	5
Nb de perdants consé...	4
Ecart type de tous les tr...	172.98
Ecart type de trades ga...	172.41
Ecart type de trades per...	38.98
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	225.10
Commissions payées:	0.00
Espérance:	1.0309
Score de l'espérance:	0.0035
Facteur chance:	8.52
Performance / Perte cu...	13.63
Expectative:	62.62
Début de l'évaluation:	17.01.18 Wed 0...
Fin de l'évaluation:	30.08.18 Thu 18

## Courbes comparées (avec modifications)



Stop intelligent modifié

Ajout Trailing Stop EOP  
et objectif à 15 ATR

## Principes à retenir

- **Examiner** les trades qui « plombent » la performance.
- **Envisager** quelles solutions, quels remèdes on pourrait apporter.
- **Mesurer** les modifications pour n'opérer que des changements logiques sans chercher la performance optimale.
- Changer **le moins** de paramètres possibles de manière à éviter une sur optimisation.

# Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

## Reproduisez ces études sur votre PC

- Téléchargez cette présentation.
- Téléchargez les indicateurs Stop Intelligent et Mogalef Trend Filter et placez-les dans le répertoire EXPRESS.  
Ils seront alors disponibles sur votre NanoTrader pour trois mois.
- Entraînez-vous à refaire les tests décrits.
- Appliquez ensuite ce type d'étude à votre façon d'intervenir, à vos systèmes ou à votre méthode.