

Comment passer au trading automatique

Elaboration et sécurisation

Conférence conçue et présentée par Eric LEFORT
Mogalef-Trading.com

Mettre au point un système automatique de trading

Choisir le support

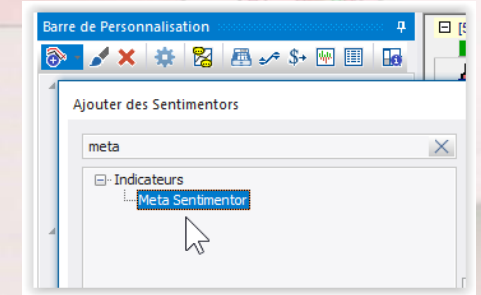
- Indice
 - DAX
 - DOW ...
- Monnaie
- Matière première
 - Or
 - Café ...
- Taux

[Où trouver le PDF de la conférence](#)

The screenshot shows the Mogalef Trading website. At the top, there is a navigation menu with links: FR-HOME, SYSTEMS NEWS, INDICATORS, TOOLS, PRIVATES CLUBS, PRACTICE WITH MOGALEF, FORMATIONS, Forums Mogalef, and Membres. Below the menu, there is a list of conferences: Conférences WHSelfinvest 2023, Conférences WHSelfinvest 2022-2023, Conférences WHSelfinvest 2021, Conférences WHSelfinvest 2019, Conférences WHSelfinvest 2018, Conférences WHSelfinvest 2017, Conférences WHSelfinvest 2016, Conférence Salon du Trading 2017, Conférence Salon AT 2016, Conférences WHSelfinvest 2015, Conférences SALON AT 2015, Conférences SALON DU TRADING 2014, and Stage formation 2017. The main content area features the title 'Conférences WHS 2023' and a section titled 'Comment passer au Trading Automatique' with the subtitle 'Conception et sécurisation'. There are buttons for 'Accès au PDF de la formation', 'Vidéo à venir', and 'Télécharger le fichier EXCEL'. A small video player icon is also visible.

Quels éléments intégrer ?

- **Le cerveau : tout d'abord le Metasentimentor**
- **Signal d'entrée**
Signal graphique, signal technique, signal de contexte ...
- **Sorties**
Objectif de gain, objectif de temps, structures des cours ...
- **Stops**
Stop loss, stop suiveur, stop temps
- **Filtres, contexte**
Tendance, structure des cours, indicateur ...
- **Money management**



Par quoi commencer, signal, sorties, stops, filtres ?

En fait, deux possibilités :

- **Signal d'entrée**

C'est le choix le plus souvent fait. De toute façon il vient au moins en deuxième.

- **Contexte**

On peut ne chercher à mettre au point un système que dans le cadre d'un contexte particulier.

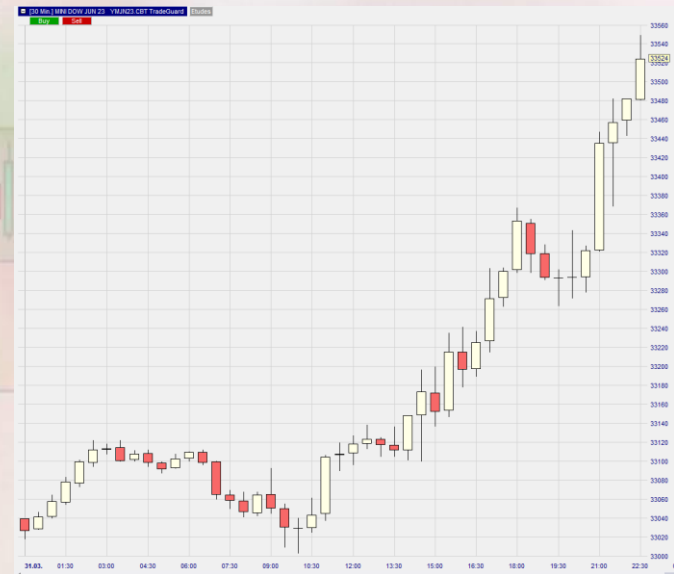
- Tendances, horaire, jour, volatilité, squeeze ...

Dans ce cas le travail sera plus long car la recherche du signal adapté au contexte complique la tâche.

Exemple avec le DOW JONES

Cet indice présente des caractéristiques très intéressantes :

- **Une valeur élevée** produisant des déplacements de cours de grande amplitude.
- **Un spread** (écart entre l'offre et la demande) très petit par rapport à la valeur de l'indice, l'un des plus petits voire le plus petit. Les frais de courtage sont donc très faibles par rapport à d'autres indices.
- **Un slippage** (déplacement des cours entre l'ordre donné par le trader et l'exécution de l'ordre sur le marché) quasi négligeable.
- **Un biais directionnel** (haussier) permettant un léger avantage en trading unidirectionnel.

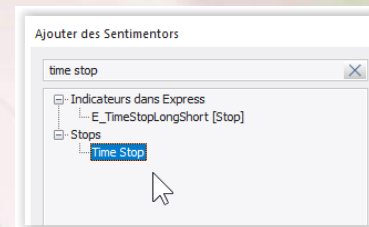
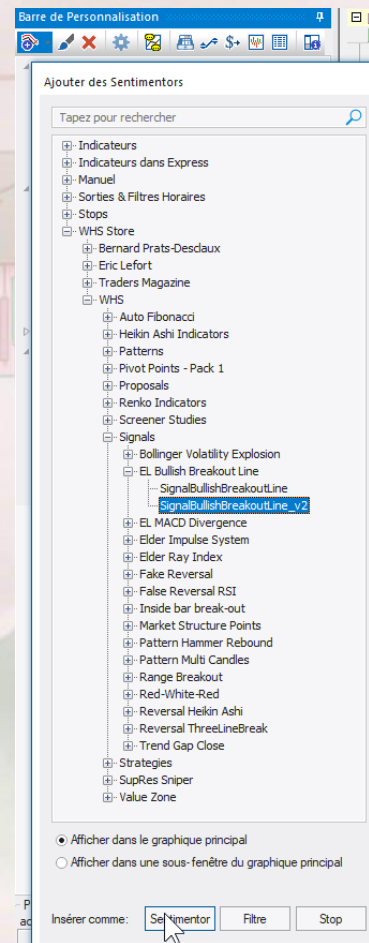


Signal d'entrée

On utilisera un signal haussier pour profiter du côté favori du DOW :
La cassure haussière.

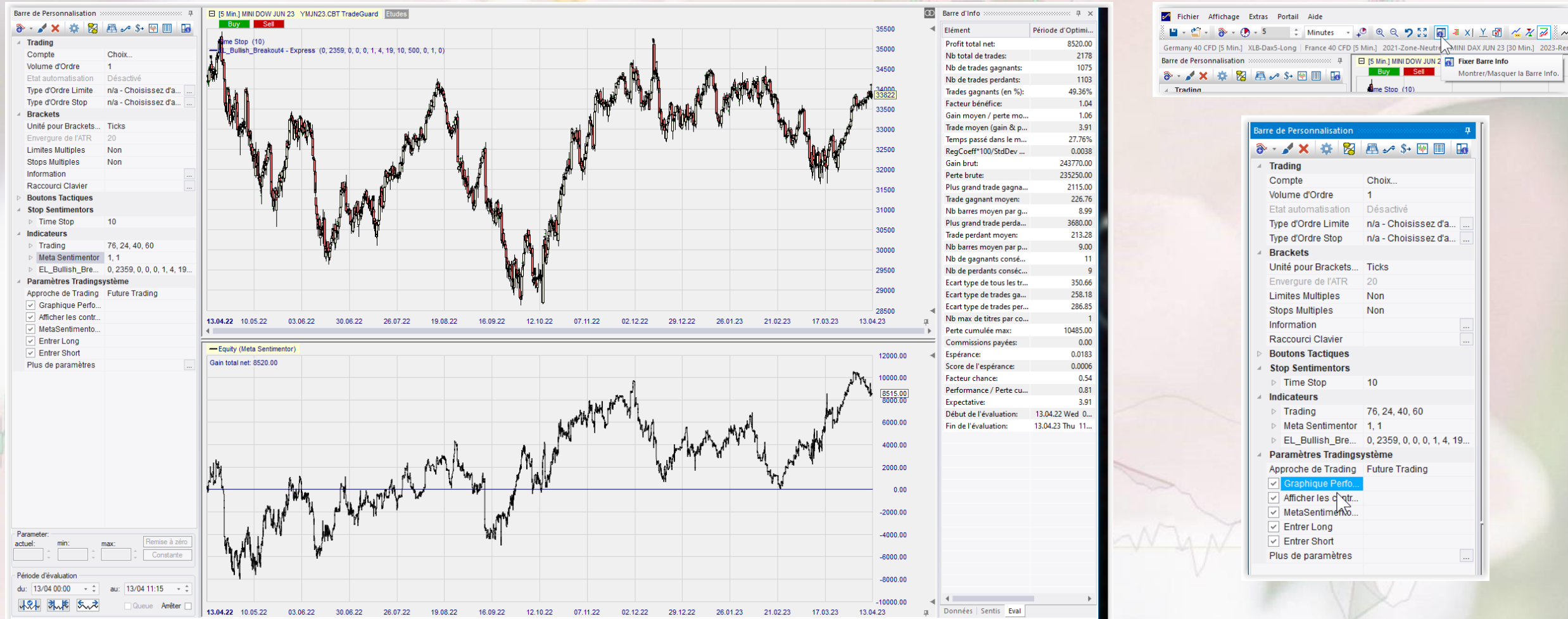
Nous testerons plusieurs cas :

- Les cassures « à plat » et quasi « à plat »
- Les cassures assez fortement inclinées
- Les cassures dans leur ensemble.
- Pour juger de la qualité d'un signal et de sa régularité l'idéal est d'utiliser un objectif temps aussi appelé « Time Stop ».



Signal Cassure haussière seul

- Ici la courbe de gain en 5mn avec un TimeStop à 10 bougies.



Cassures haussières proches de l'horizontal

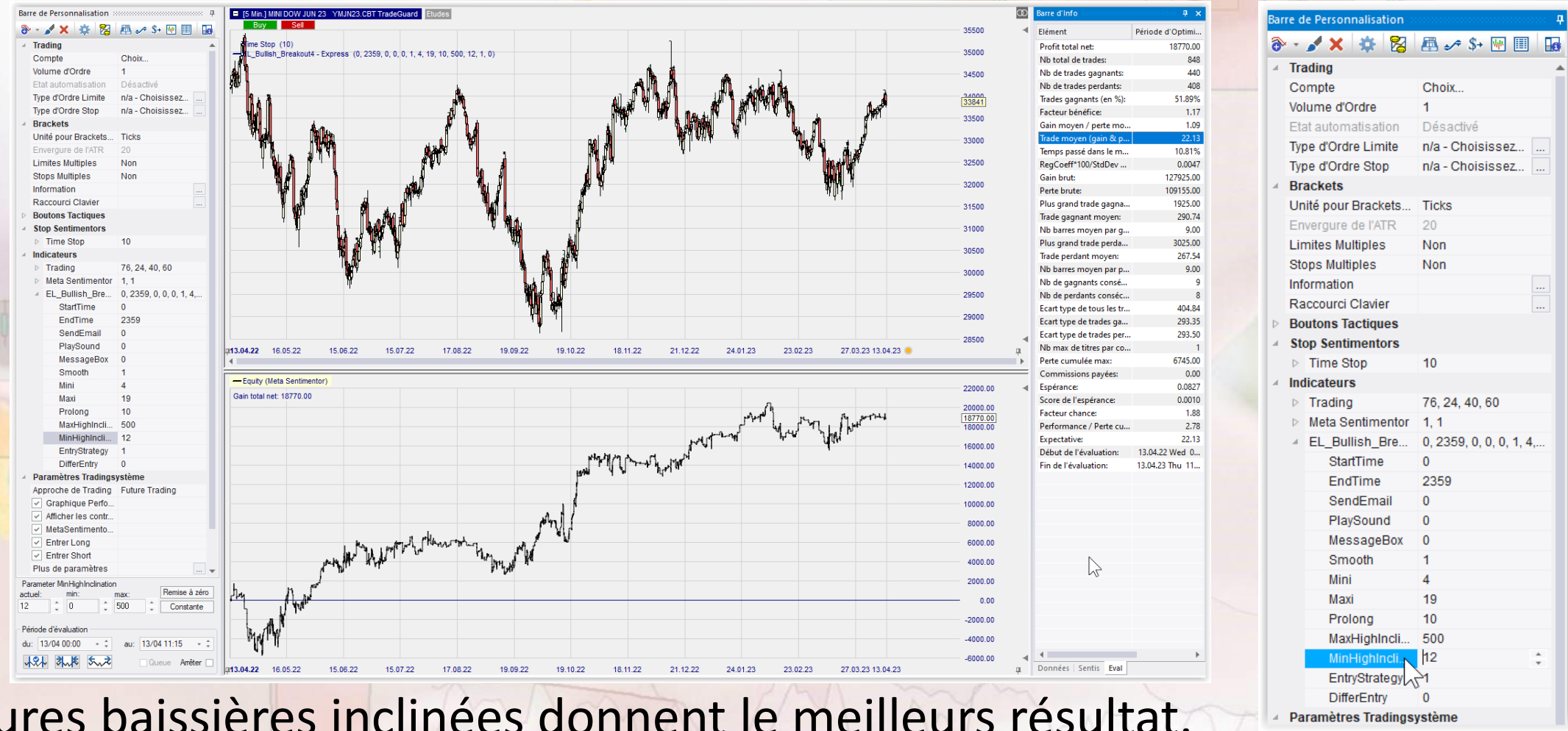
The screenshot displays a trading software interface with the following components:

- Top Chart:** A candlestick chart for the instrument 'MINI DOW JUN 23'. A horizontal line is drawn at approximately 33841, labeled 'EL_Bullish_Breakout4 - Express (0, 2359, 0, 0, 0, 1, 4, 19, 10, 2, 0, 1, 0)'. The price shows a series of upward breaks near this horizontal level.
- Bottom Chart:** A line chart for 'Equity (Meta Sentimentor)'. The y-axis ranges from -10000.00 to 2000.00. A horizontal line is drawn at -2930.00, labeled 'Gain total net: -2930.00'. The equity line fluctuates around this level.
- Performance Summary Table:**

Élément	Période d'Optimi...
Profit total net:	-2930.00
Nb total de trades:	710
Nb de trades gagnants:	348
Nb de trades perdants:	362
Trades gagnants (en %):	49.01%
Facteur bénéfique:	0,95
Gain moyen / perte mo...	0,99
Trade moyen (gain & p...	-4,13
Temps passé dans le m...	9,05%
RegCoeff*100/StdDev ...	-0,0006
Gain brut:	60270.00
Perte brute:	63200.00
Plus grand trade gagna...	2115.00
Trade gagnant moyen:	173.19
Nb barres moyen par g...	9,00
Plus grand trade perda...	3680.00
Trade perdant moyen:	174.59
Nb barres moyen par p...	9,00
Nb de gagnants consé...	7
Nb de perdants consé...	7
Ecart type de tous les tr...	300,93
Ecart type de trades ga...	211,97
Ecart type de trades per...	274,27
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	9770.00
Commissions payées:	0,00
Espérance:	-0,0236
Score de l'espérance:	-0,0002
Facteur chance:	-0,18
Performance / Perte cu...	-0,30
Expectative:	-4,13
Début de l'évaluation:	13.04.22 Wed 0...
Fin de l'évaluation:	13.04.23 Thu 11...
- Left Panel (Barre de Personnalisation):** Contains trading settings such as 'Compte', 'Volume d'Ordre', 'Type d'Ordre Limite', and 'Indicateurs'.
- Right Panel (Barre de Personnalisation):** Contains a detailed list of parameters for the 'EL_Bullish_Bre...' indicator, including 'StartTime', 'EndTime', 'SendEmail', and 'MaxHighIncl...'.

• Pas très engageant !

Cassures haussières plutôt inclinées



Les cassures baissières inclinées donnent le meilleur résultat.
Ce sera donc notre réglage de type de cassure.

Choix du type d'évolution des cours que l'on va travailler

- Tendance
- Impulsion

Si l'on met le TimeStop à 10 ou moins on s'oriente vers un travail d'impulsion.

Si on le met à 30 ou plus, vers le trading de tendance.



Dans un premier temps on laisse le TimeStop à 10 pour faire une présélection des trades qui «partent bien ».

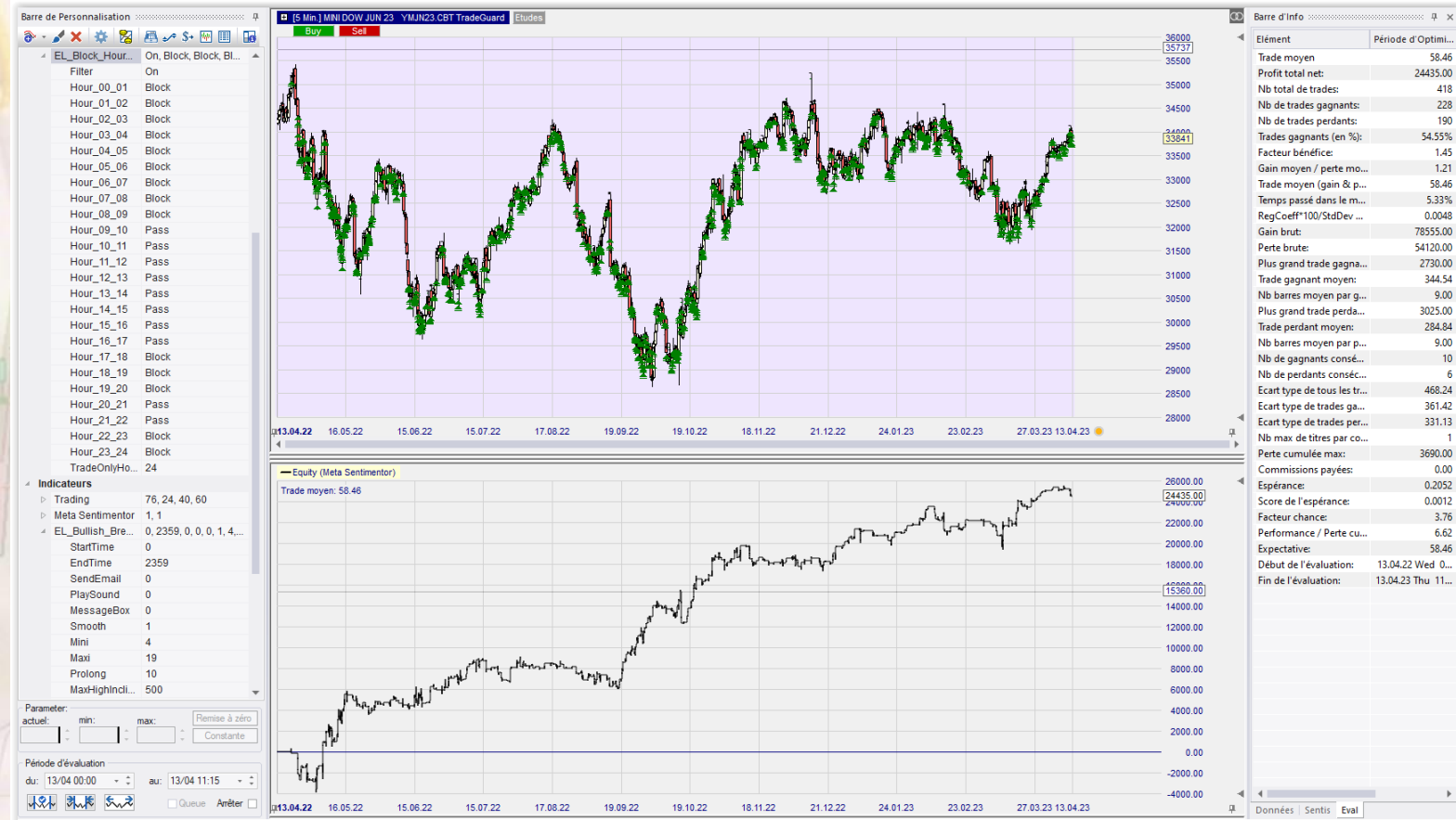
A partir de ceux-ci on examinera ensuite s'il faut choisir le travail de tendance ou d'impulsion.

Toutes les incorporations de filtres, stops ou objectifs doivent être traitée indépendamment et non pas cumulativement ! Sinon on tomberait fatalement dans la sur optimisation.

Ajout des filtres, du contexte : Filtre horaire

On améliore les performances en tradant seulement de 9h à 17h ainsi que de 20h à 22h.

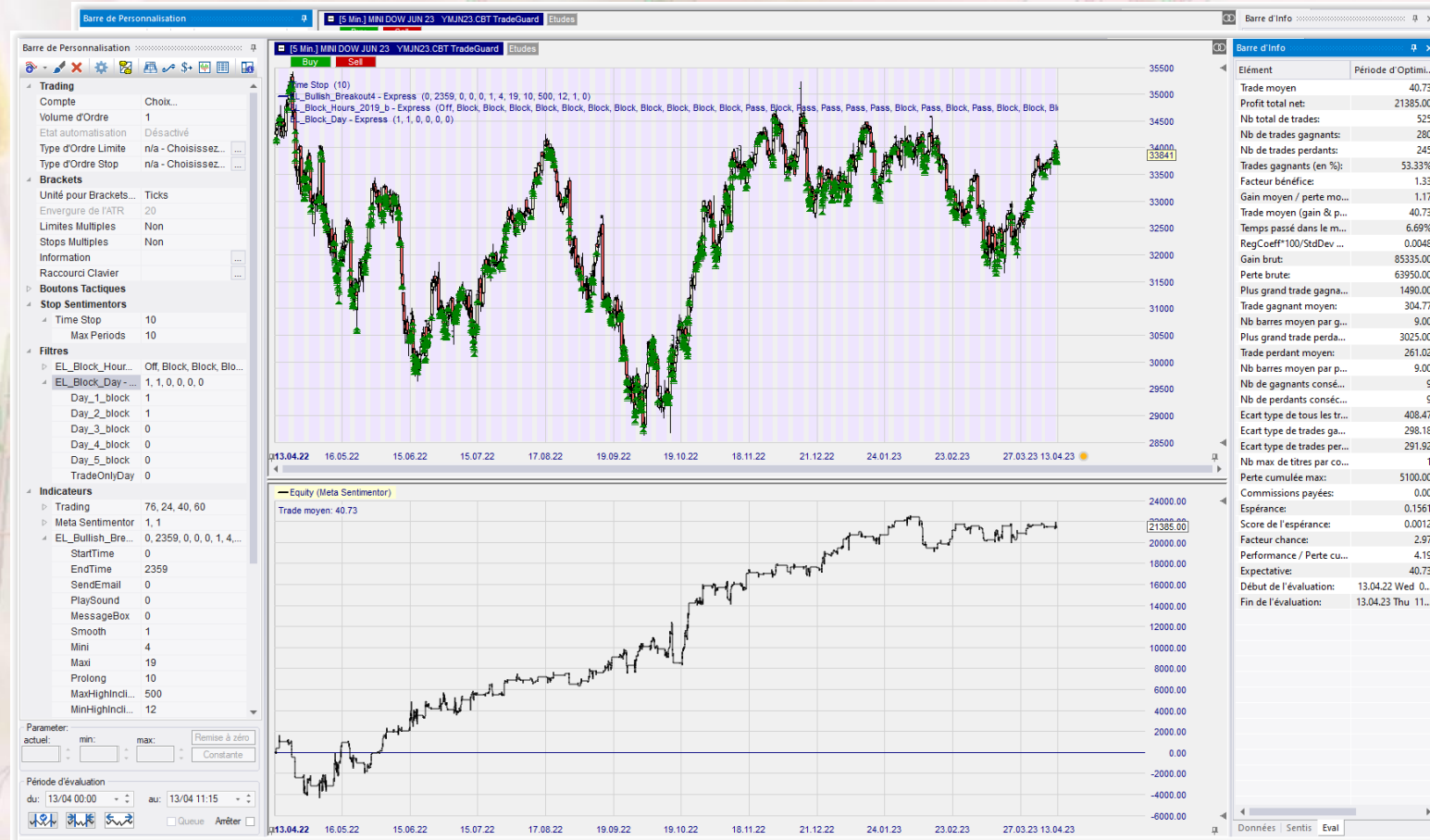
On n'utilise pas de suite ce filtre pour ne pas trop réduire le nombre de trades étudiés.



Ajout des filtres, du contexte : Filtre journalier

On améliore les performances en ne tradant **pas** le lundi et le mardi, surtout le mardi.

On n'utilise pas de suite ce filtre pour ne pas réduire le nombre de trades étudiés.

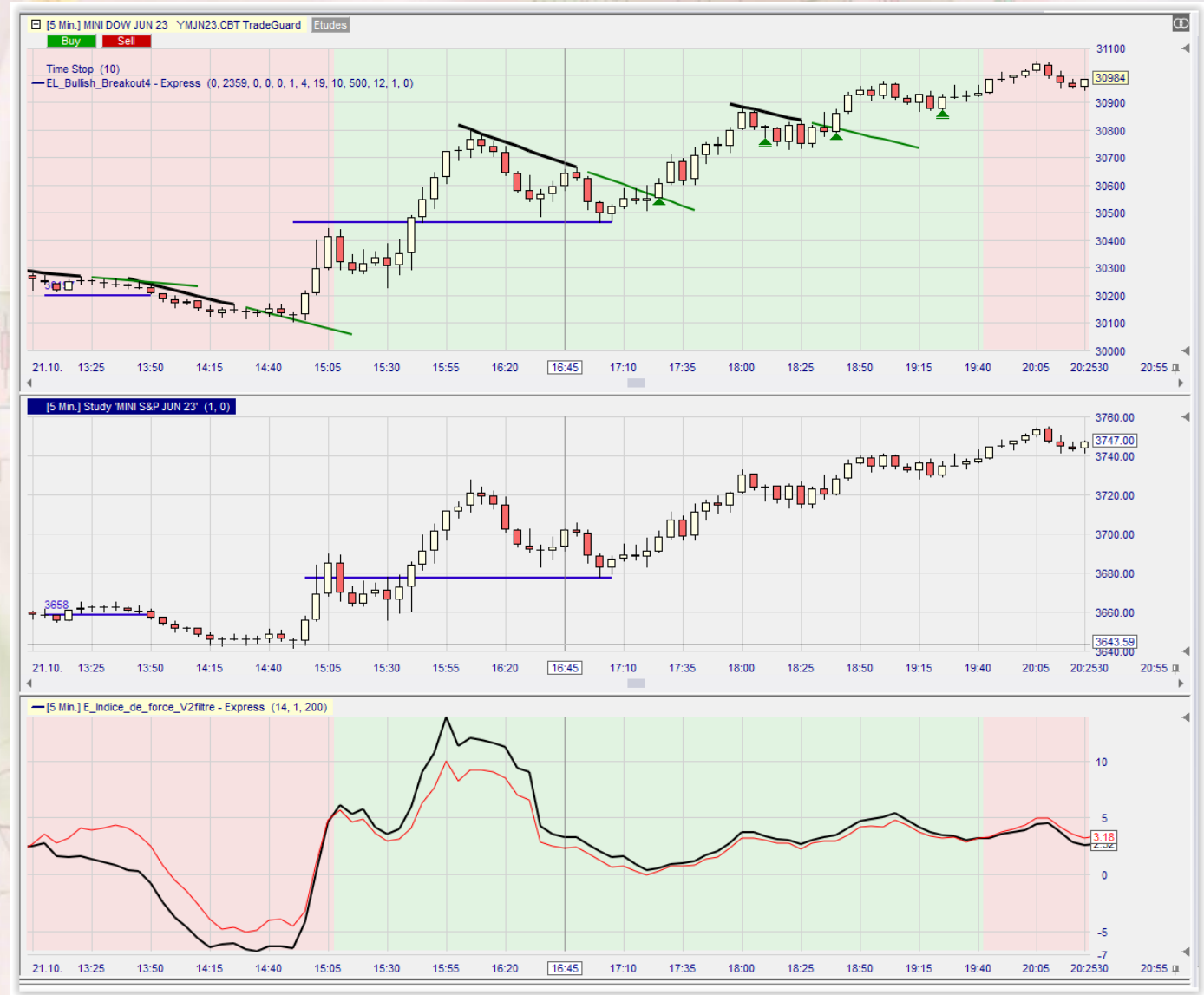


Ajout des filtres : la force relative

Force relative :

L'indicateur compare la puissance de l'évolution des cours des deux indices.

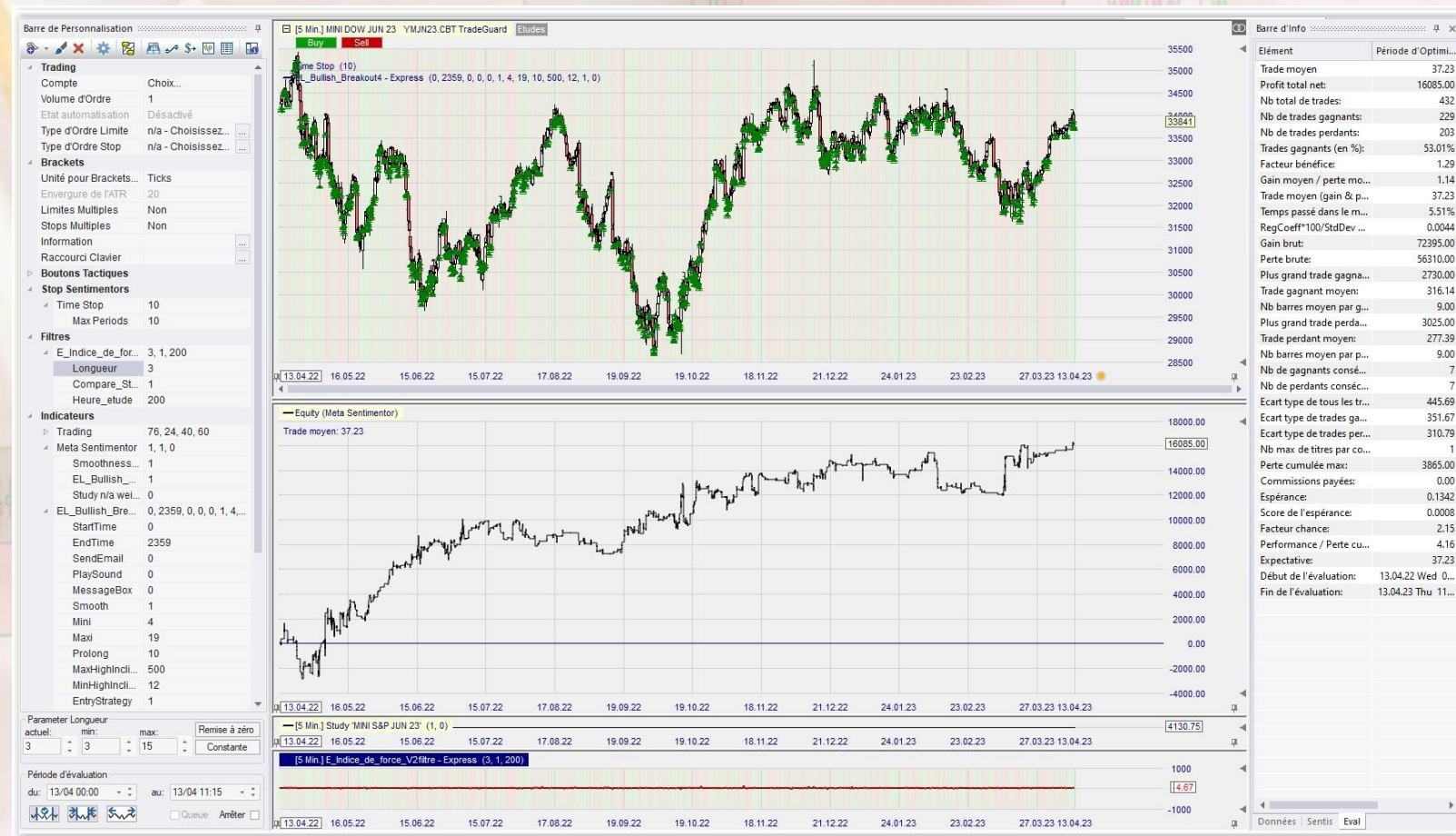
Ici, la ligne rouge est la force du SP500 et la ligne noire la force du DOW.



Ajout des filtres : la force relative

On améliore peu le gain moyen du système en comparant la force du Dow et celle du SP500.

Par contre, la réduction du nombre de trades par le filtre force relative ampute très fortement le gain global.



Ajout des filtres : la force relative

On n'améliore pas le système en comparant la force du Dow et celle du CAC.



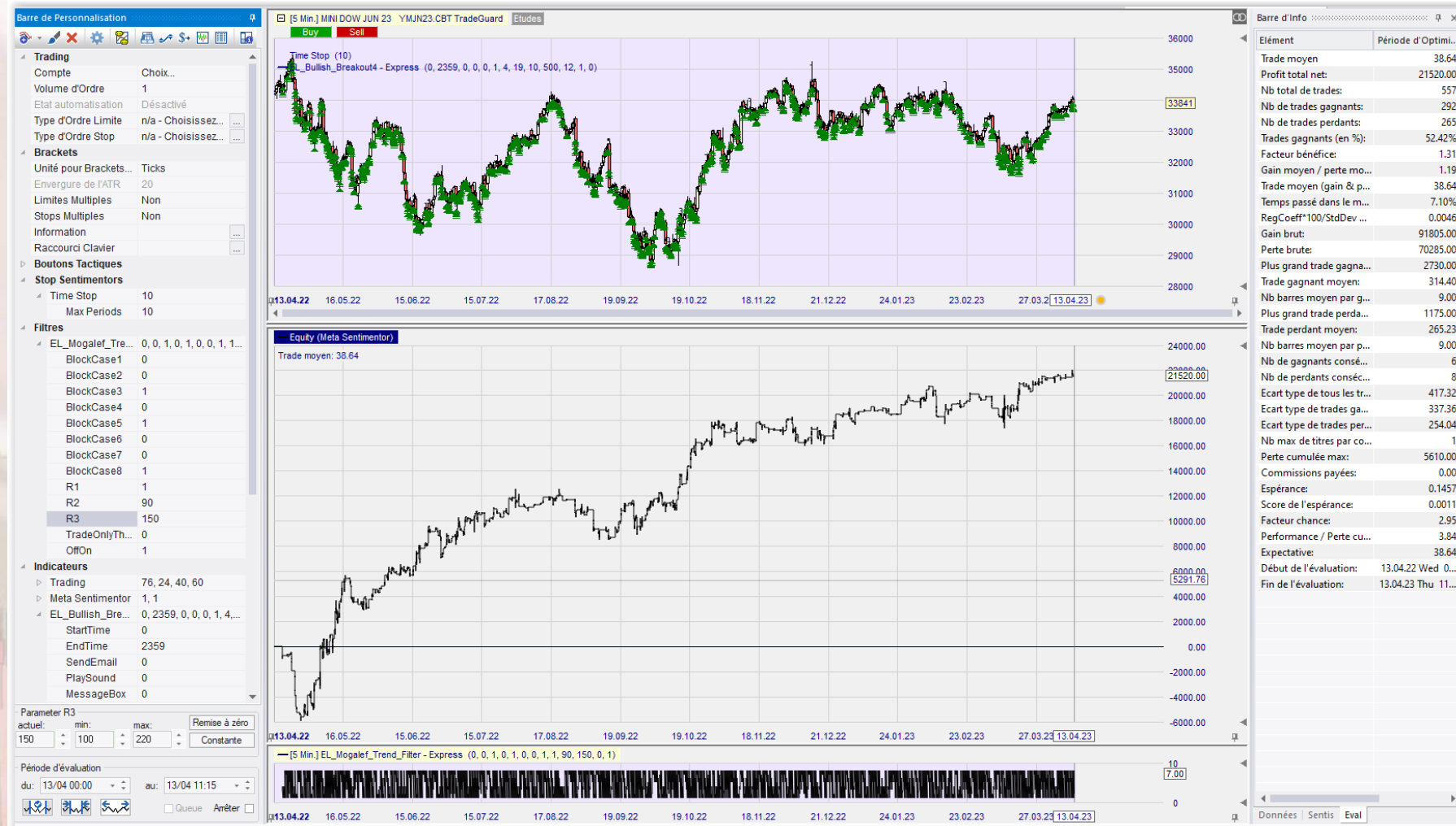
Ajout des filtres, du contexte : Filtre de tendance « Mogalef Trend Filter »

Le filtre MTF améliore bien le gain moyen par trade.

Il améliore aussi la performance totale malgré une réduction du nombre de trades.

Le réglage du MTF est logique, donc l'amélioration ne résulte pas d'une suroptimisation.

Il subsiste une période de perte sévère dans le premier mois du test. On peut espérer la réduire avec l'ajout des stops.



Filtre de volatilité



- On ne trade que lorsque l'ATR est compris entre une valeur basse et une valeur haute.
- Particulièrement efficace si l'on élimine les période de très faible et très forte volatilité.
- Augmente bien la régularité de la courbe de gain.
- Réduit de 25% le nombre de trades.
- Double le trade moyen.

Barre de Personnalisation

- Trading
- Brackets
- Boutons Tactiques
- Stop Sentiments
 - Time Stop: 10
 - Max Periods: 10
- Filtres
 - EL_ATR_Min_M...: 5, 200, 800, On
 - ATR_Long: 5
 - ATR_Min: 200
 - ATR_Max: 800
 - Filter: On
 - EL_Mogalef_Tre...: 0, 0, 1, 0, 1, 1, 0, 1, 1...
 - EL_Block_Hour...: Off, Block, Block, Blo...
 - Filter: Off
 - Hour_00_01: Block
 - Hour_01_02: Block
 - Hour_02_03: Block
 - Hour_03_04: Block
 - Hour_04_05: Block
 - Hour_05_06: Block
 - Hour_06_07: Block
 - Hour_07_08: Block
 - Hour_08_09: Block
 - Hour_09_10: Pass
 - Hour_10_11: Pass
 - Hour_11_12: Pass
 - Hour_12_13: Pass
 - Hour_13_14: Pass
 - Hour_14_15: Pass
 - Hour_15_16: Pass
 - Hour_16_17: Pass
 - Hour_17_18: Block
 - Hour_18_19: Block
 - Hour_19_20: Block
 - Hour_20_21: Pass
 - Hour_21_22: Pass
 - Hour_22_23: Block
 - Hour_23_24: Block
 - TradeOnlyHo...: 24
 - EL_Block_Day...: Off, 0, 1, 0, 0, 0, 0

Parameter Filter
 actuel: 1 min: 0 max: 1 Remise à zéro Constante

Période d'évaluation
 du: 14/04 00:00 au: 13/04 11:15

[5 Min] MNI DOW JUN 23 YMJN23.CBT TradeGuard [Etudes]

Buy Sell

[5 Min] EL_ATR_Min_Max_v2 - Express (5, 200, 800, On)

Equity (Meta Sentimor)

Trade moyen: 45.81

Barre d'Info

Élément	Période d'Optimi...
Trade moyen	45.81
Profit total net:	27670.00
Nb total de trades:	604
Nb de trades gagnants:	323
Nb de trades perdants:	281
Trades gagnants (en %):	53.48%
Facteur bénéfice:	1.36
Gain moyen / perte mo...	1.18
Trade moyen (gain & p...	45.81
Temps passé dans le m...	7.73%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0048
Gain brut:	105485.00
Perte brute:	77815.00
Plus grand trade gagna...	1680.00
Trade gagnant moyen:	326.58
Nb barres moyen par g...	9.00
Plus grand trade perda...	1650.00
Trade perdant moyen:	276.92
Nb barres moyen par p...	9.00
Nb de gagnants consé...	9
Nb de perdants consé...	6
Ecart type de tous les tr...	409.03
Ecart type de trades ga...	299.18
Ecart type de trades per...	248.80
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	4190.00
Commissions payées:	0.00
Espérance:	0.1654
Score de l'espérance:	0.0014
Facteur chance:	4.99
Performance / Perte cu...	6.60
Expectative:	45.81
Début de l'évaluation:	14.04.22 Thu 00...
Fin de l'évaluation:	13.04.23 Thu 11...

Résumé des filtres étudiés

- Filtre horaire : il élimine la nuit et une ou deux heures défavorables. A garder impérativement.
- Filtre journalier : Il n'élimine qu'une journée. A garder.
- **Force relative : n'apporte rien, à éliminer.**
- Filtre de tendance : bonne amélioration, sans plus. Il faudra peut-être l'inclure après avoir défini notre type de trading et nos stops.
- Filtre de volatilité : amélioration sérieuse et logique. Reste en suspend car il peut être utile de ne pas diminuer le nombre de trades.

Préparation pour le test des sorties

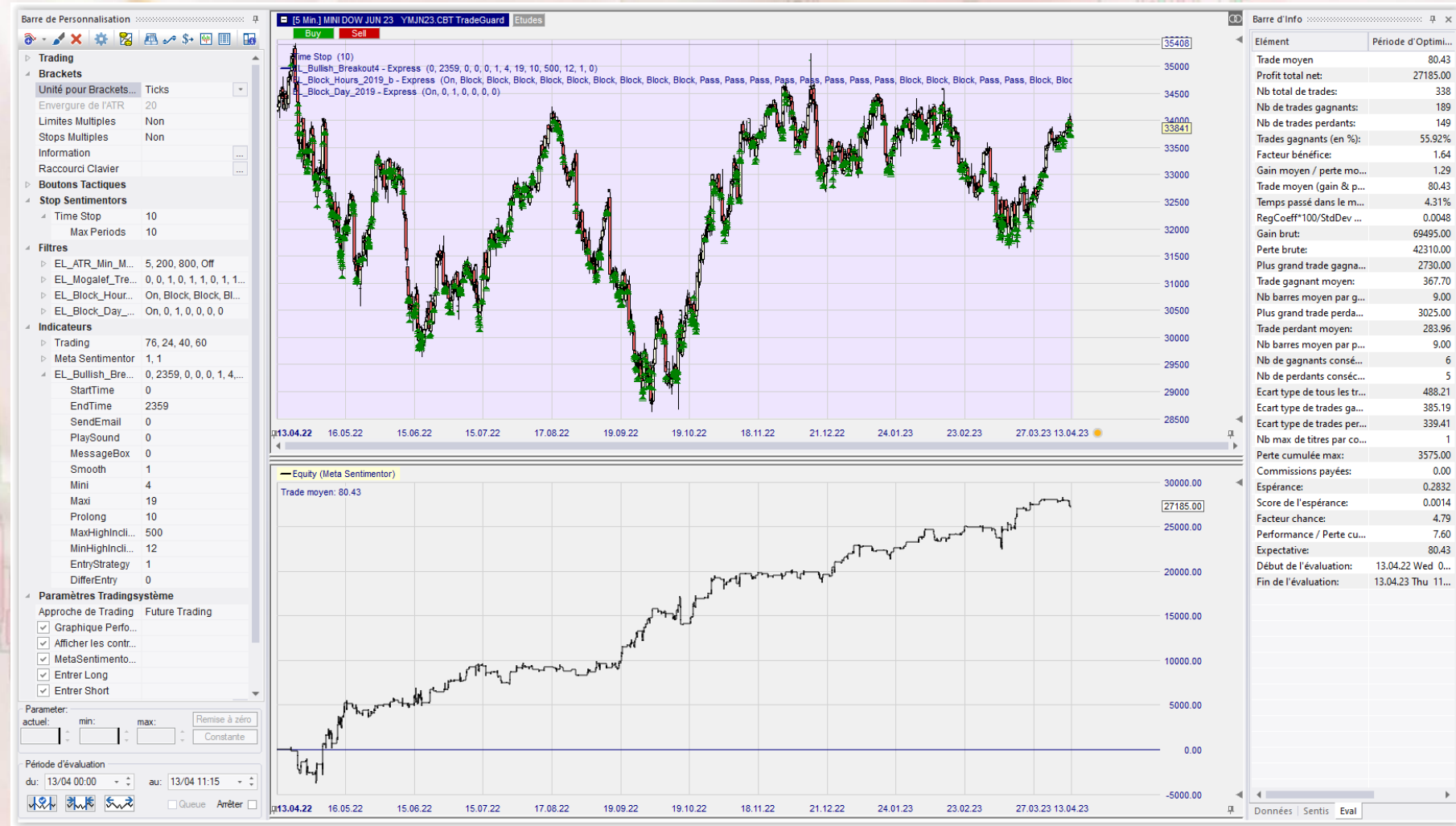
On porte le TimeStop à 36 pour ouvrir la possibilité de trades de plus grande durée.

On utilise le minimum de filtres pour garder un maximum de trades.

Ici on ne garde que :

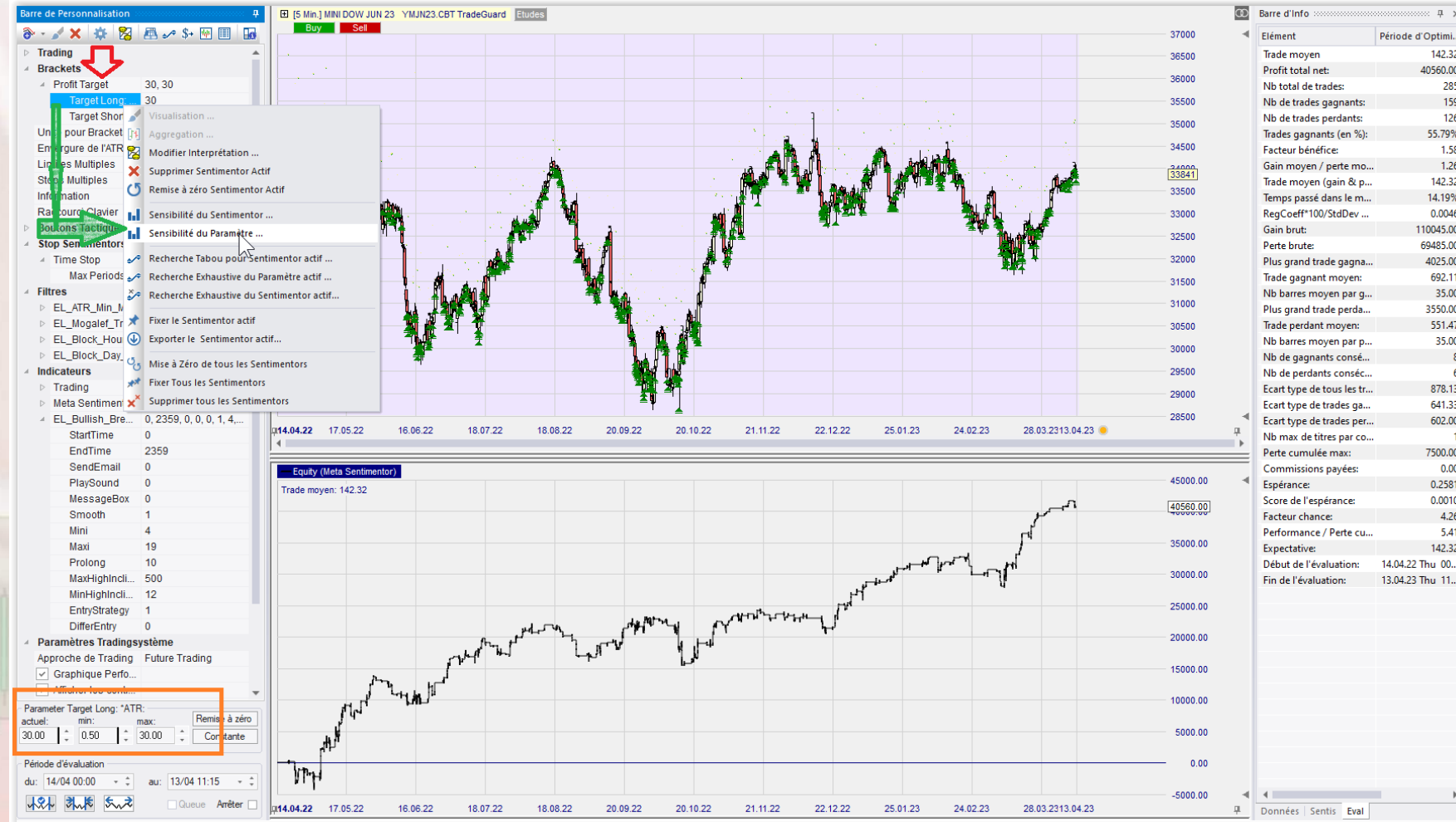
- Le filtre horaire (journée et soirée)
- Le filtre jour qui empêche de trader le mardi.

Ces deux filtres temporels ne font pas risquer une sur optimisation.



Signal de sortie :

Objectif déterminé en fonction de la volatilité



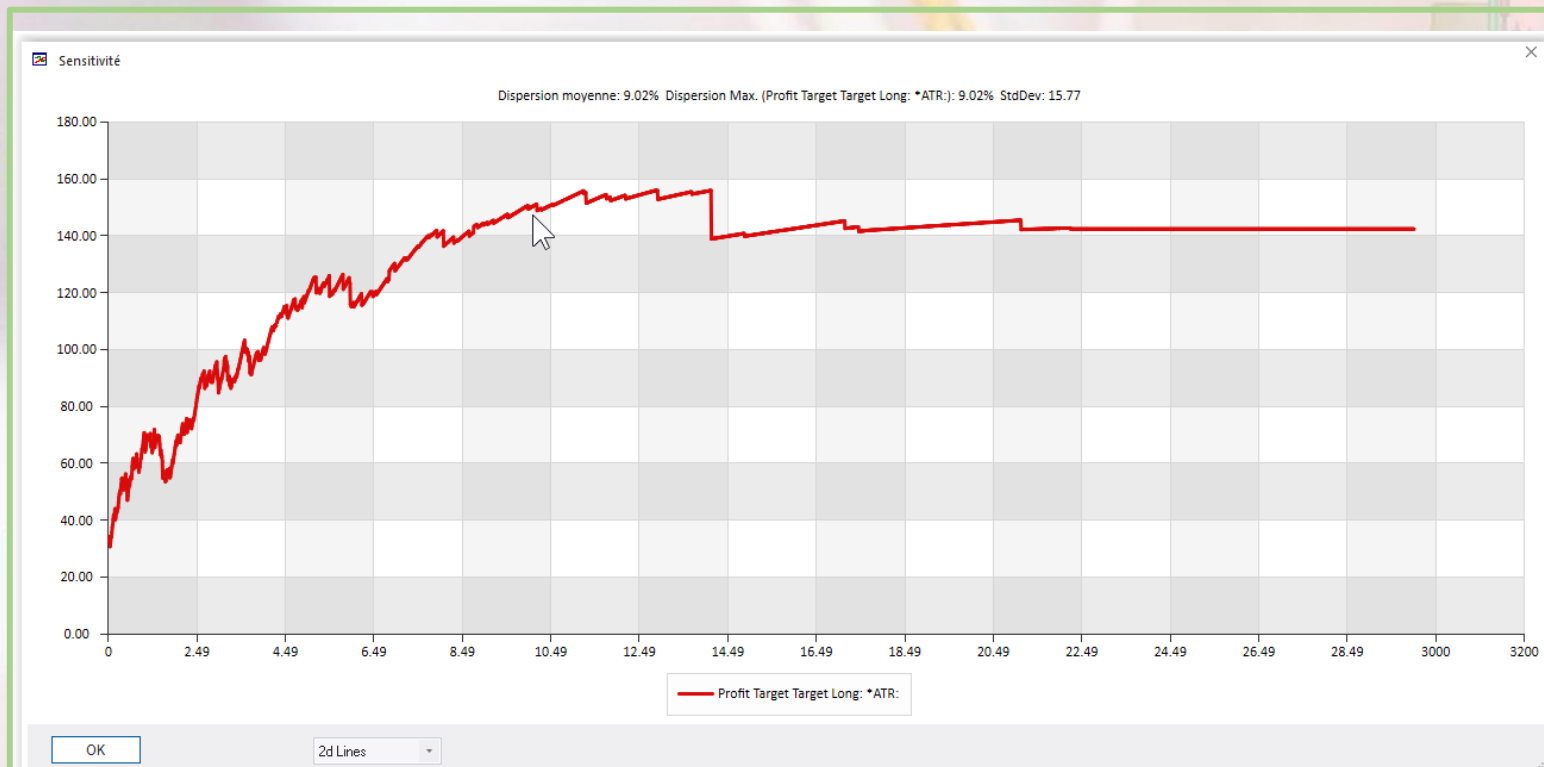
On éloigne le stop temps à 36 périodes pour les tests et on inclue le Profit Target calculé en fonction de l'ATR.

On demande une variation de l'objectif entre 0,5 ATR et 30 ATR

On fait un clic droit sur le paramètre TARGET LONG et on demande la sensibilité du paramètre.

On obtiendra ainsi un graphe qui nous donnera le gain (ici gain moyen) pour chaque distance de l'objectif (x ATR)

Trade moyen en fonction de la distance de l'objectif



Au fur et à mesure qu'on éloigne l'objectif le gain moyen par trade augmente.
La montée est régulière et le plafond est atteint vers **10 ATR**.



Élément	Période d'Optimi...
Trade moyen	149.60
Profit total net:	42635.00
Nb total de trades:	285
Nb de trades gagnants:	160
Nb de trades perdants:	125
Trades gagnants (en %):	56.14%
Facteur bénéfici:	1.65
Gain moyen / perte mo...	1.29
Trade moyen (gain & p...	149.60
Temps passé dans le m...	13.83%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0048
Gain brut:	108570.00
Perte brute:	65935.00
Plus grand trade gagna...	3605.00
Trade gagnant moyen:	678.56
Nb barres moyen par g...	33.45
Plus grand trade perda...	3355.00
Trade perdant moyen:	527.48
Nb barres moyen par p...	35.00
Nb de gagnants consé...	8
Nb de perdants consé...	6
Ecart type de tous les tr...	826.82
Ecart type de trades ga...	592.62
Ecart type de trades per...	540.59
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	5190.00
Commissions payées:	0.00
Espérance:	0.2836
Score de l'espérance:	0.0011
Facteur chance:	5.78
Performance / Perte cu...	8.21
Expectative:	149.60
Début de l'évaluation:	14.04.22 Thu 00...
Fin de l'évaluation:	13.04.23 Thu 11...

Avec un **objectif à 10 ATR**

- Gain moyen de 149€
- Profit 42 635€

Mais on n'augmente que très peu le gain moyen et le profit total.

Par contre la « performance/perte cumulée » est meilleure: régularité des résultats.

Signal de sortie : Divergence baissière de MACD



On voit que l'usage des divergences classiques en sortie n'apporte rien.

Par contre les **divergences inverses** permettent de se sortir de situations délicates : on diminue le trade perdant moyen. L'apport reste modéré, un peu efficace sur la performance totale et la régularité de la courbe de gain.

Equity (Meta Sentimentor)
 Trade moyen: 141.76

Élément	Période d'Optimi...
Trade moyen	141.76
Profit total net:	42245.00
Nb total de trades:	298
Nb de trades gagnants:	158
Nb de trades perdants:	140
Trades gagnants (en %):	53.02%
Facteur bénéfique:	1.65
Gain moyen / perte mo...	1.46
Trade moyen (gain & p...	141.76
Temps passé dans le m...	12.84%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0047
Gain brut:	107010.00
Perte brute:	64765.00
Plus grand trade gagna...	4025.00
Trade gagnant moyen:	677.28
Nb barres moyen par g...	32.54
Plus grand trade perda...	3550.00
Trade perdant moyen:	462.61
Nb barres moyen par p...	27.75
Nb de gagnants consé...	8
Nb de perdants consé...	9
Ecart type de tous les tr...	826.54
Ecart type de trades ga...	647.68
Ecart type de trades per...	540.43
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	6590.00
Commissions payées:	0.00
Espérance:	0.3064
Score de l'espérance:	0.0013
Facteur chance:	4.93
Performance / Perte cu...	6.41
Expectative:	141.76
Début de l'évaluation:	14.04.22 Thu 00...
Fin de l'évaluation:	13.04.23 Thu 11...

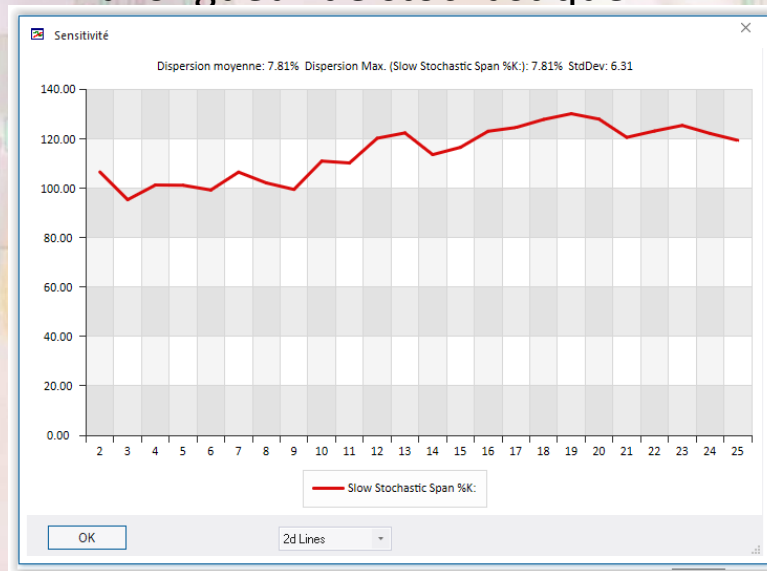
Barre de Personnalisation

- Time Stop: 36
- Max Periods: 36
- Filtres
- Indicateurs
 - Trading: 74, 24, 46, 60
 - Meta Sentimentor: 1, 2, 1
 - Smoothness...: 1
 - EL_Bullish...: 2
 - EL_MACD_D...: 1
 - EL_Bullish_Bre...: 0, 2359, 0, 0, 0, 1, 4, ...
 - StartTime: 0
 - EndTime: 2359
 - SendEmail: 0
 - PlaySound: 0
 - MessageBox: 0
 - Smooth: 1
 - Mini: 4
 - Maxi: 19
 - Prolong: 10
 - MaxHighIncl...: 500
 - MinHighIncl...: 12
 - EntryStrategy: 1
 - DifferEntry: 0
 - EL_MACD_DIV...: 0, 2359, 0, 0, 0, 12, ...
 - StartTime: 0
 - EndTime: 2359
 - PlaySound: 0
 - MessageBox: 0
 - SendEmail: 0
 - EMAFast: 12
 - EMASlow: 26
 - EMA: 9
 - smothH: 2
 - smothL: 2
 - ONone1Nor...: 2
 - DistanceMaxH: 200
 - DistanceMaxL: 200
 - DifferEntry: 0
 - StrengtRepul...: -100
 - Visualise: No

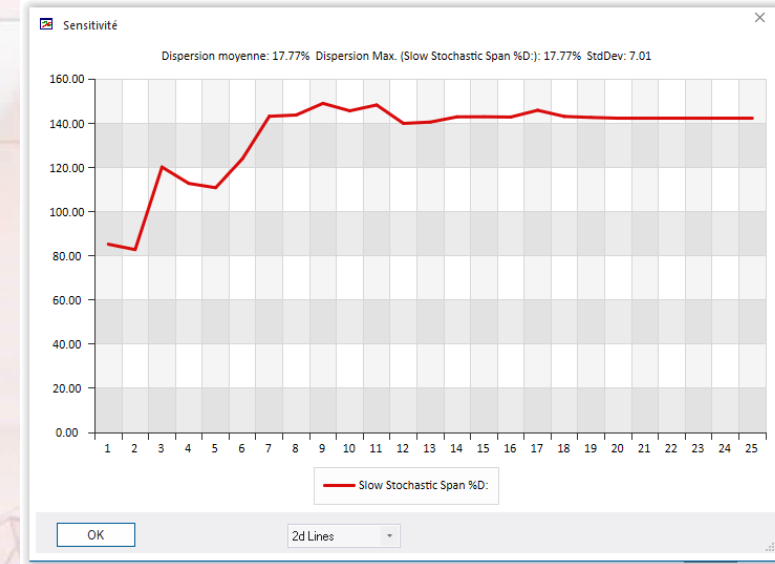
Paramètres Tradingystème

Signal de sortie: Sur achat De l'indicateur Stochastique

- On teste les valeurs possibles de
La longueur de stochastique



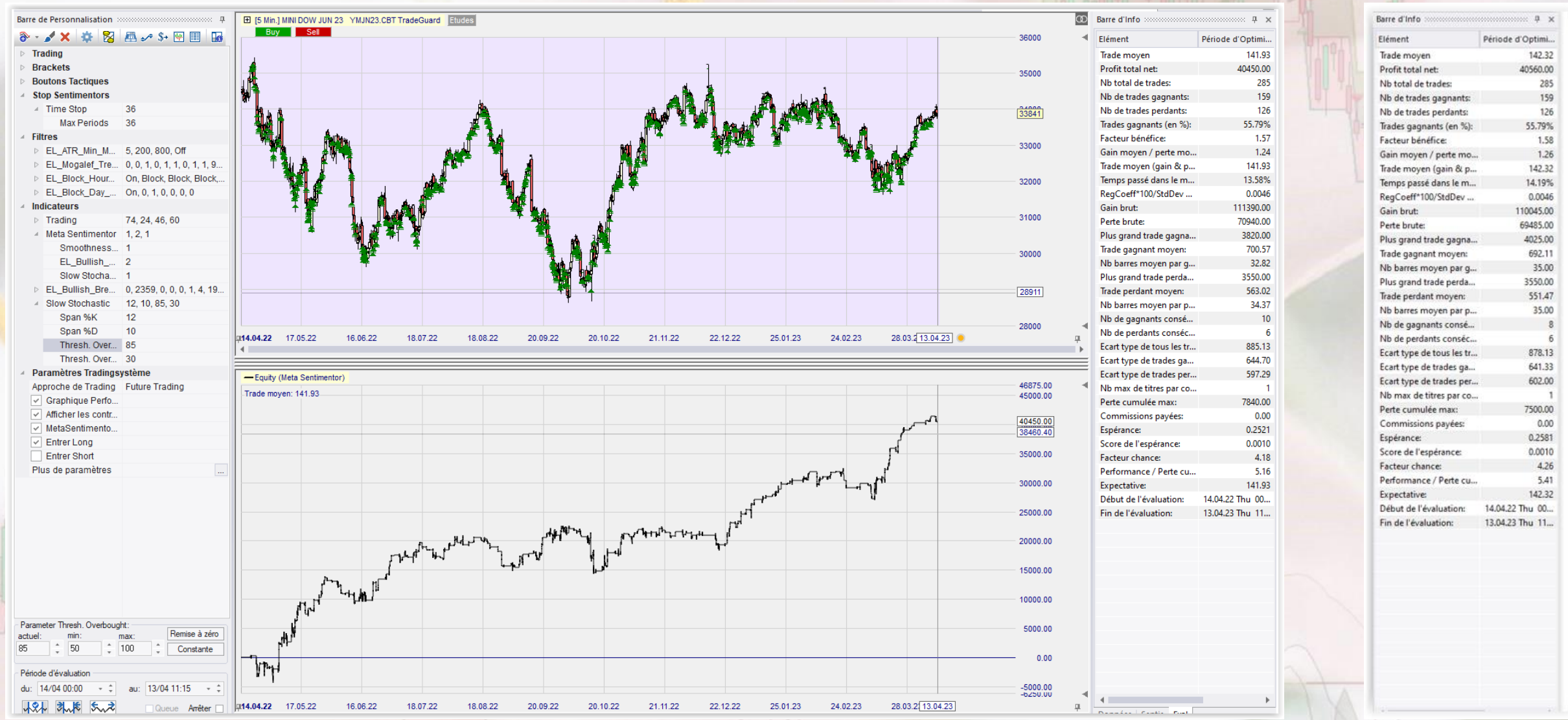
- Le lissage du stochastique (moyenne mobile)



Inutile de changer la longueur de la stochastique, par contre intéressant d'augmenter la longueur de la moyenne à 10



Objectif d'indicateur : Sur achat stochastique

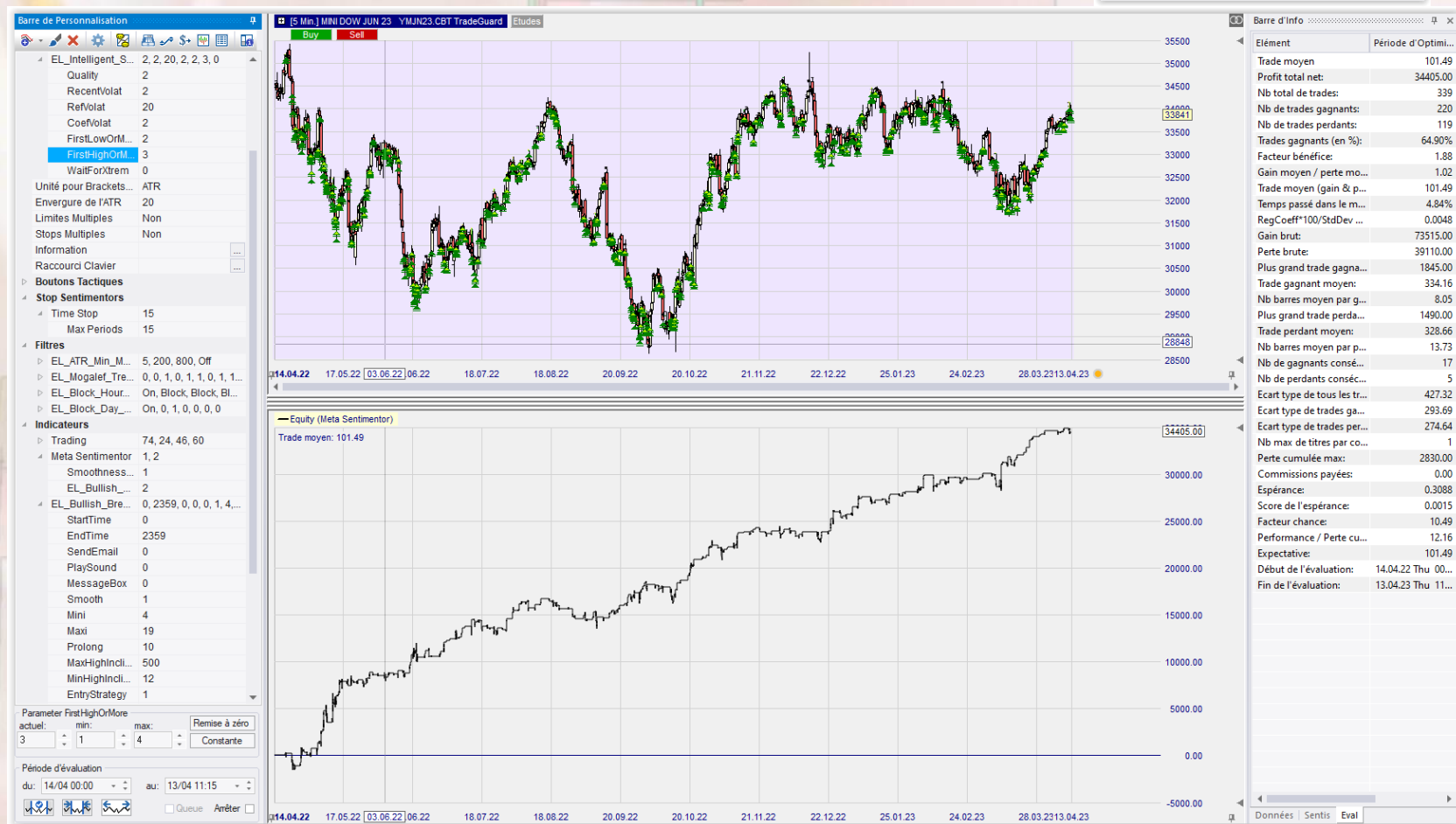


Régularité : l'apport de cette sortie est mauvais.

Objectif de sortie : Intelligent scalping target



- Cet objectif est conçu pour **des trades de courte durée, 7 à 20 bougies**. Il n'est pas adapté à un trading de tendance aussi ramenons-nous le TimeStop à 15 pour ce test.
- On observe :
 - Une diminution du trade moyen.
 - Une forte proportion de trades gagnants.
 - Une remarquable amélioration de la régularité de la courbe de gain.
- Cet objectif conviendrait uniquement si l'on optait pour un travail d'impulsion.

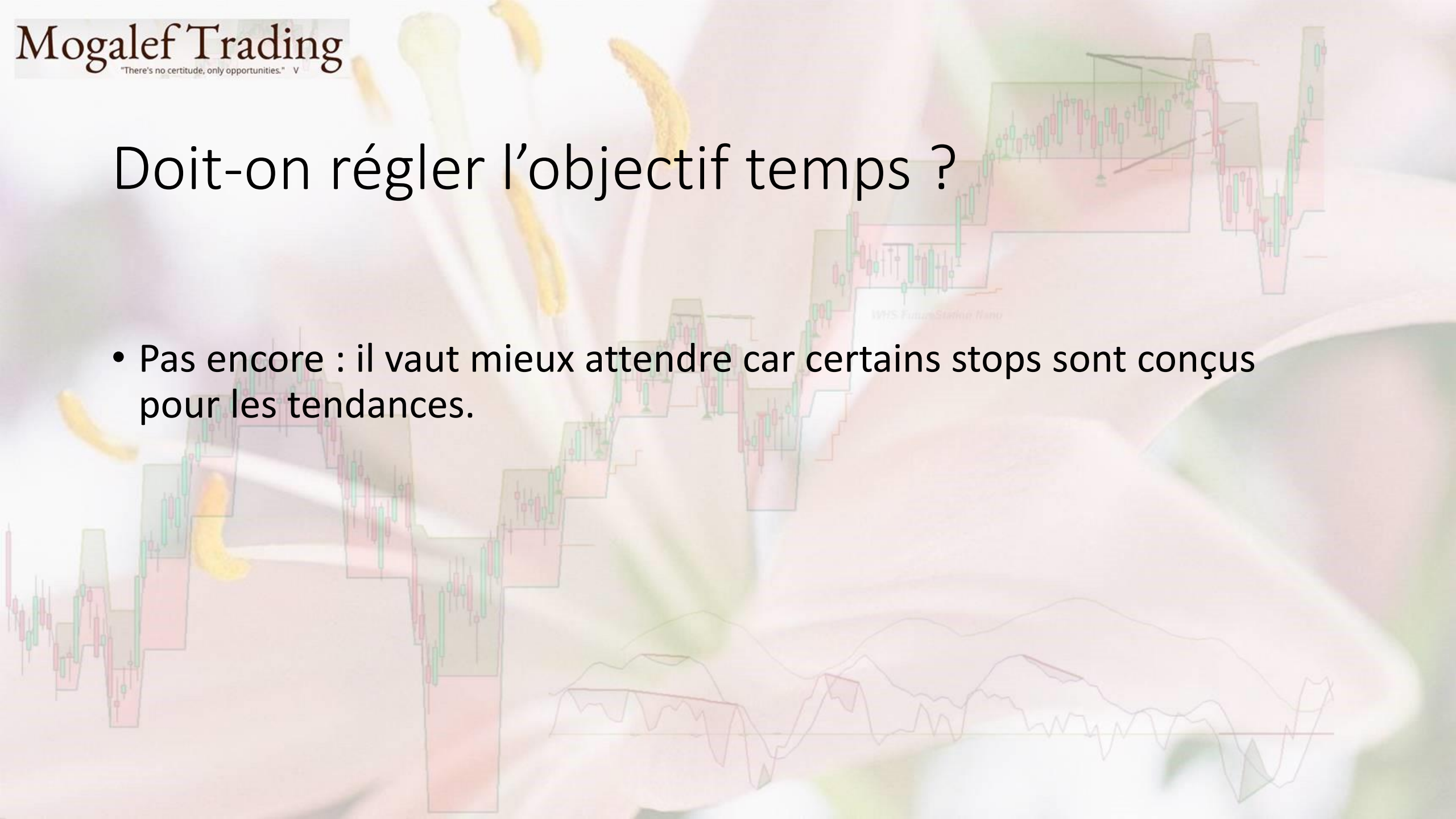


Résumé des signaux de sortie étudiés

- Objectif en fonction de la volatilité
Augmente la régularité des résultats
- Divergence baissière MACD
Apport modéré. Augmente la régularité.
- Sur achat de stochastique
Apport nul, à éviter.
- Intelligent scalping target
Uniquement intéressant sur un trading court terme. Augmente beaucoup la régularité : réduit les gains mais réduit beaucoup les pertes.

Doit-on régler l'objectif temps ?

- Pas encore : il vaut mieux attendre car certains stops sont conçus pour les tendances.

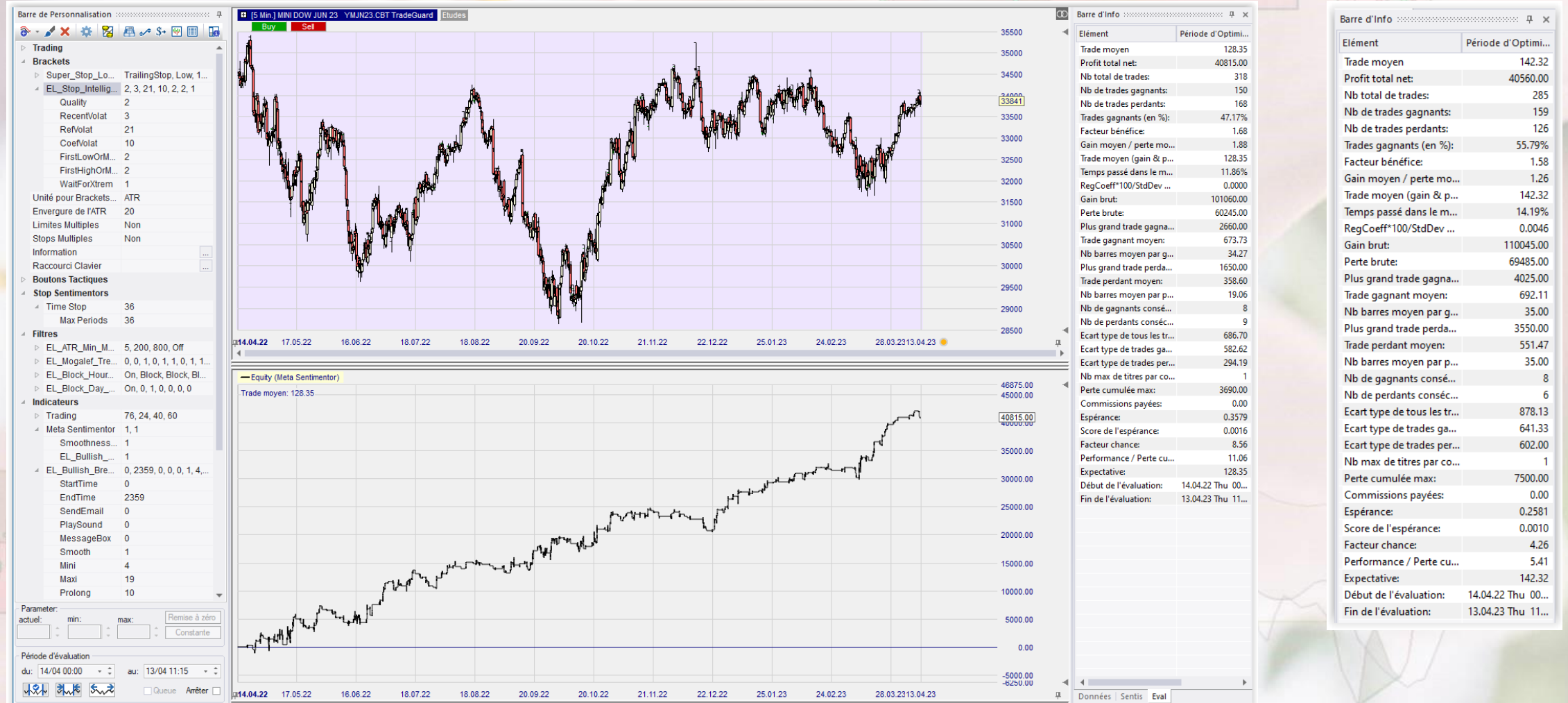


Stop loss et money management

- Après avoir cherché à maximiser le gain moyen par trade, le gain ainsi que la régularité de la courbe de gains, on s'attache à minimiser les pertes et à régulariser encore plus la courbe de gains.
- C'est le but des stops.
- On examine deux types de stop:
 - Stops pour impulsion
 - Stops pour tendance
- On fait attention à ne pas trop faire baisser les gains ni le gain par trade, ce qui aura forcément lieu avec l'ajout des stops.

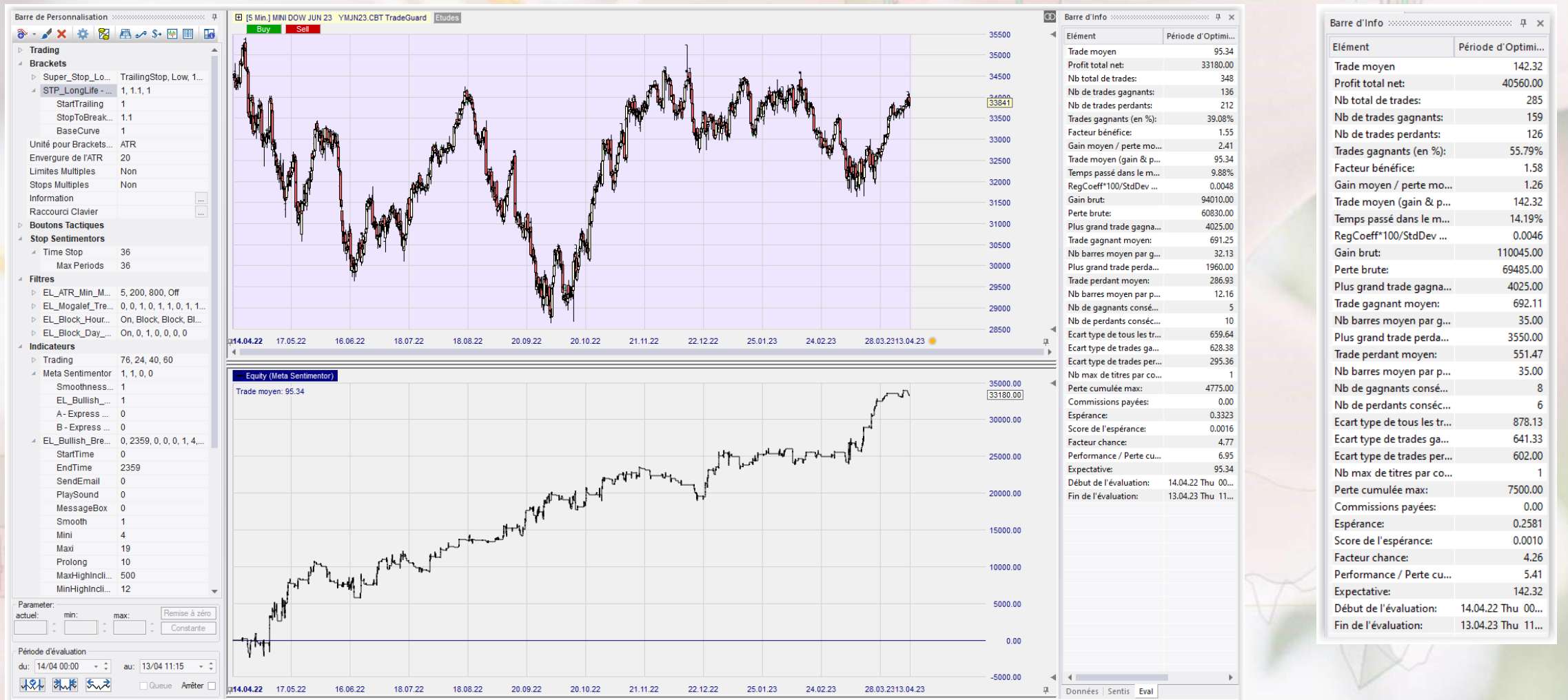
Stop suiveur : stop intelligent

- Ce stop convient au travail de tendance. Il réduit fortement le trade perdant moyen.
- Il augmente beaucoup la régularité du gain (performance/perse cumulée)



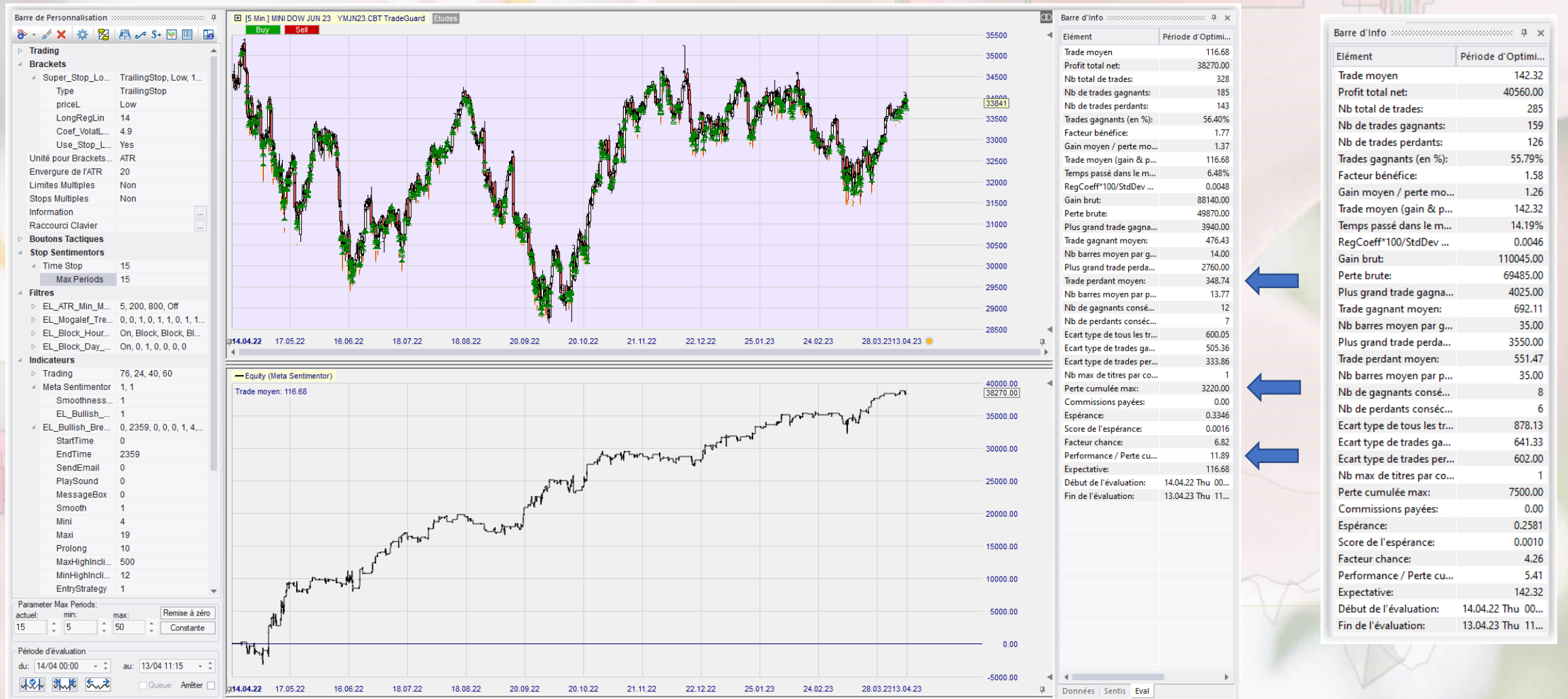
Stop suiveur : dernier bas (stop long life)

- Convient au trading de tendance.
- Il augmente fortement le « gain moyen/perte moyenne » mais n'augmente que peu la régularité du gain.



Stop suiveur : SuperStop

- Ce stop convient au trading d'impulsion. On baisse donc le TimeStop.
- Il augmente fortement la régularité (Performance/perde cumulée) et diminue le trade perdant moyen.



Résumé des stops étudiés

- Stop suiveur Stop intelligent
Convient au travail de tendances. Augmente la régularité en diminuant les pertes.
- Stop suiveur dernier haut dernier bas (stop long life de Pascal Hirtz)
Convient au trading de tendance.
Augmente fortement le « gain moyen/perte moyenne »
- Stop suiveur SuperStop
Convient au trading d'impulsion
Augmente fortement la régularité (Performance/perte cumulée)

Pour un trading de tendance on retient donc:

- Filtre de volatilité
- ~~Filtre de tendance ?~~
- Objectif de volatilité à 10 ATR
- Stop intelligent



Pour un trading d'impulsion on retient donc:

- Filtre de volatilité
- Profit Target à 10 ATR
- SuperStop Long
- Intelligent scalping target
- TimeStop à 15



Trading d'impulsion

- Les résultats sont très décevants. Ceci est probablement dû à une interférence entre deux ou plus indicateurs, filtres, objectifs, stops.
- En enlevant les critères un par un on s'aperçoit que :
 - Le MTF n'apporte rien
 - Le filtre de volatilité ampute gain et régularité
 - Le superStop est placé loin donc presque inefficace, sauf pour la perte maximum cumulée qu'il réduit sérieusement. On doit le garder.

Trading d'impulsion

On arrive alors à ceci :

Le trade moyen
diminue un peu.

Et on s'aperçoit qu'en
réalité l'Intelligent
Scalping Target fait
presque tout, tout seul.



La vérification sur des données non vues

- On peut vérifier la validité d'un système en voyant ce qu'il donne sur une partie de l'historique qui n'a pas servi à la mise au point du système.
- Mais attention : il faut tester sur un historique correspondant à la situation pendant la période de test, et surtout correspondant à la période à venir ! Je m'explique : de février 2022 à mai 2023 nous nous trouvons en présence d'une guerre en Europe. Cet environnement est nouveau. Il ne correspond pas à la période précédente qui était dominée par la lutte contre la COVID. Il ne correspond pas à la période qui précédait la COVID ».
- Ceci a pour corolaire de réduire la période de temps disponible pour un test fiable. Faire un test sur la période GUERRE et le vérifier sur la période COVID peut conduire à de sévères déconvenues, voire à l'abandon d'un système performant.

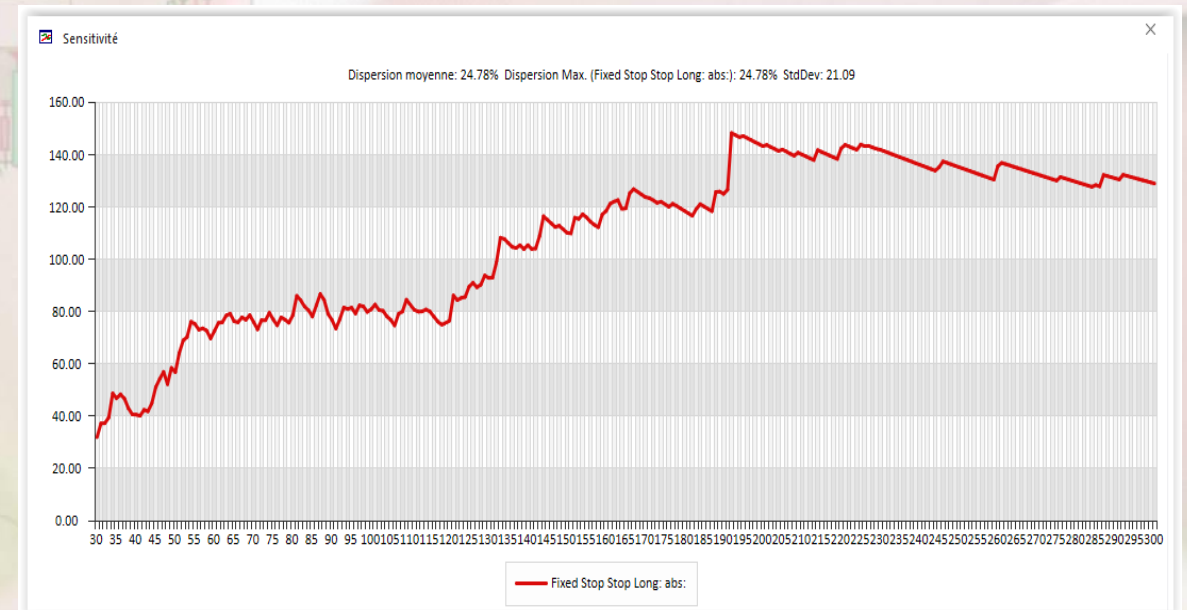
Qu'est-ce que je ne dois surtout pas faire ?

Ne surtout pas chercher à optimiser de nouveau
les paramètres de l'indicateur, des stops, objectifs, filtres ...

Ceci conduirait **sans aucun doute** à une « sur optimisation » fatale pour la validité du système.

Stop de sécurité et de money-management

- Ne doit pas ou très peu interférer avec les résultat du système.
- On doit donc attendre que le ou les systèmes soient complets avant d'éventuellement de le déterminer.
- Plus on rapproche ce stop, plus il dégrade le système.



Quel capital pour trader ce système seul ?

Si on considère que la perte maximale du test ne doit pas dépasser 10% du capital:

- Trading de tendance : $3400 (3350) \times 10 = 34000\text{€}$
- Trading d'impulsion : $2850 (2825) \times 10 = 28500\text{€}$

Si on considère que la perte maximum sur un trade ne doit pas dépasser 1% du capital:

- Trading de tendance : $1180 \times 100 = 118\ 000\text{€}$
- Trading d'impulsion : $1150 \times 100 = 115\ 000\text{€}$

Comment réduire le risque ?

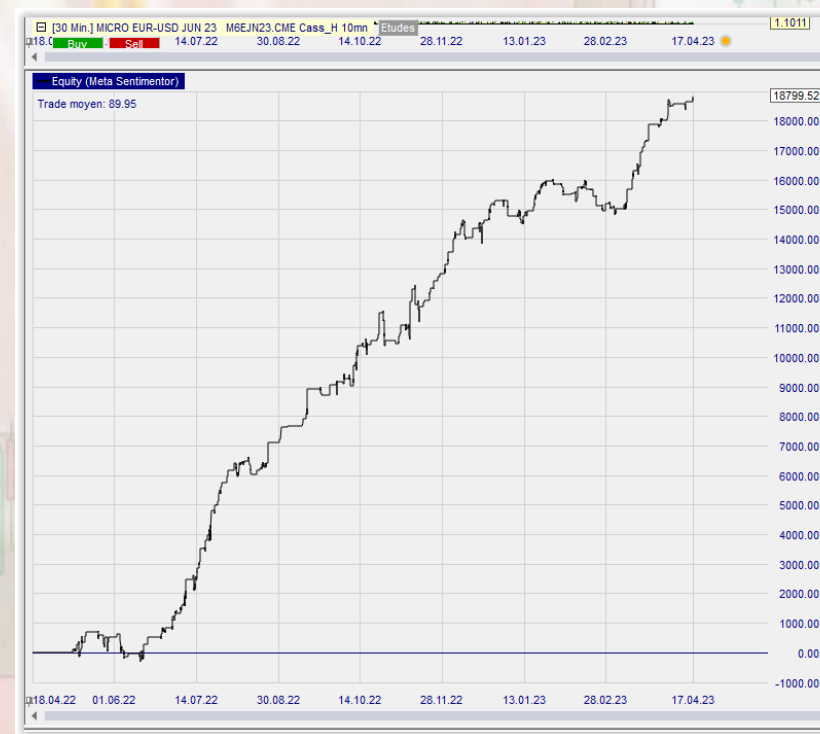
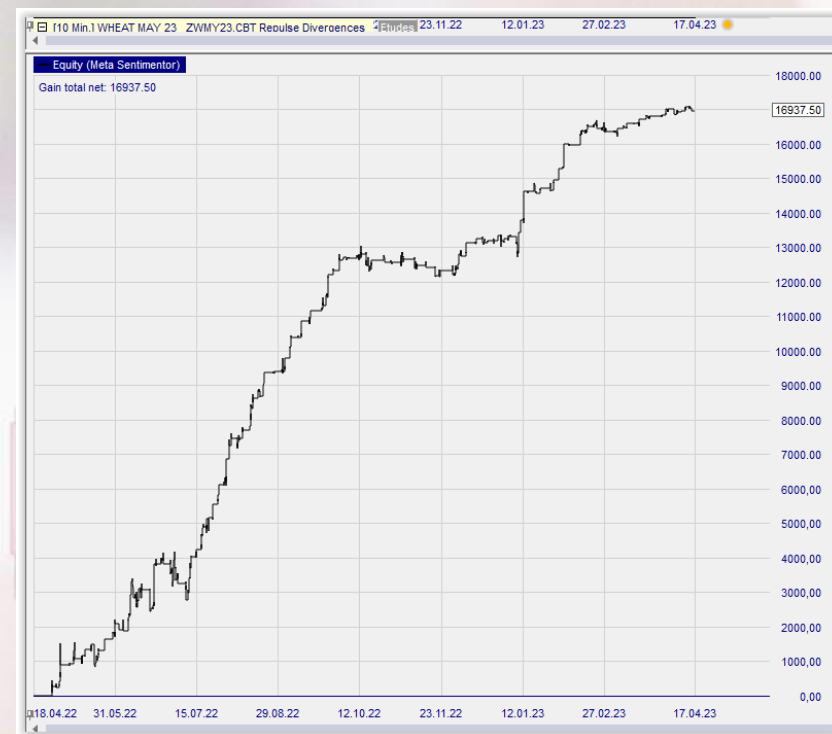
Le secret de la sécurité : Utiliser plusieurs systèmes

- Sur des supports différents.
(pas liés en cas d'utilisation du même type de système).
- Des systèmes de conception différente.
- Des systèmes sur des unités de temps différentes.

Combiner les résultats

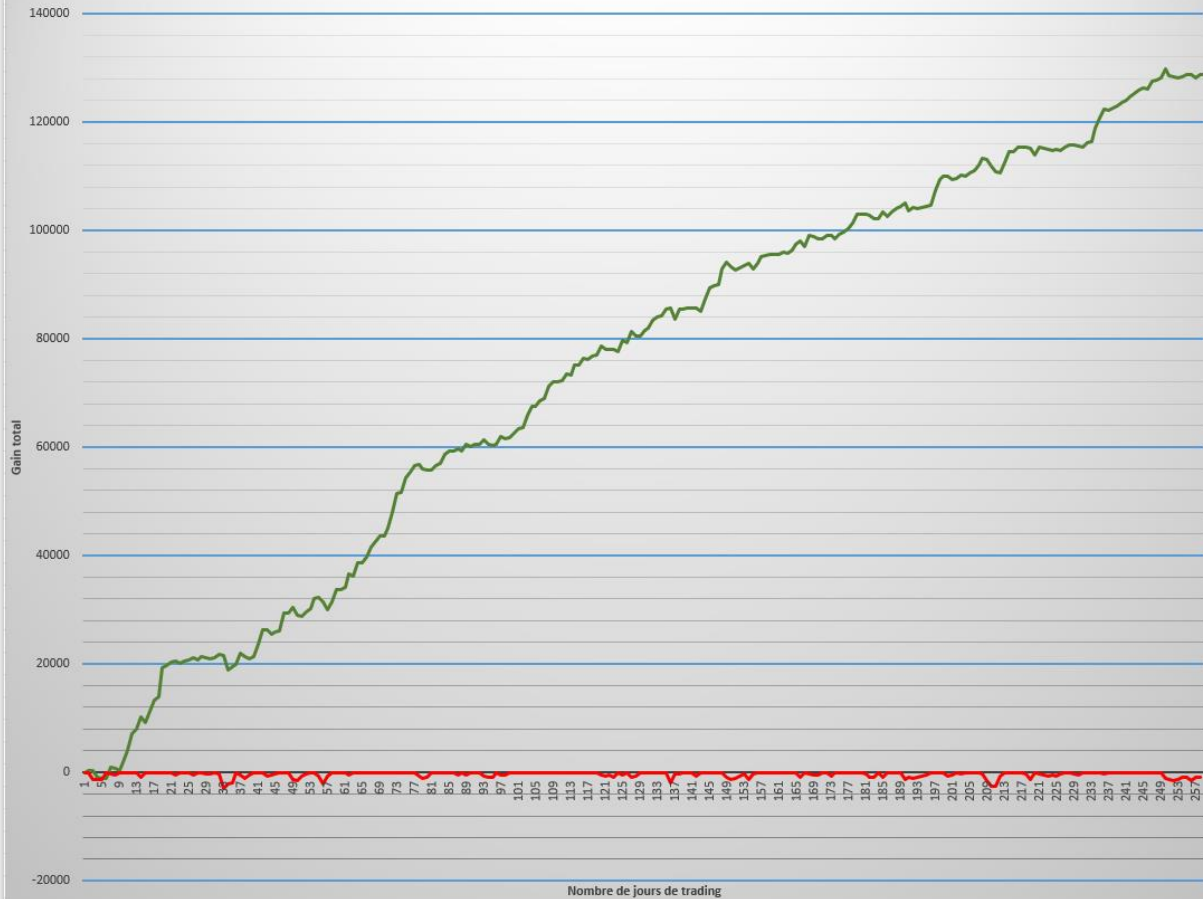
De manière à ce que les périodes perdantes de chaque système soient compensées par les périodes gagnantes des autres systèmes.

Trois autres systèmes utilisés lors de cet exemple:



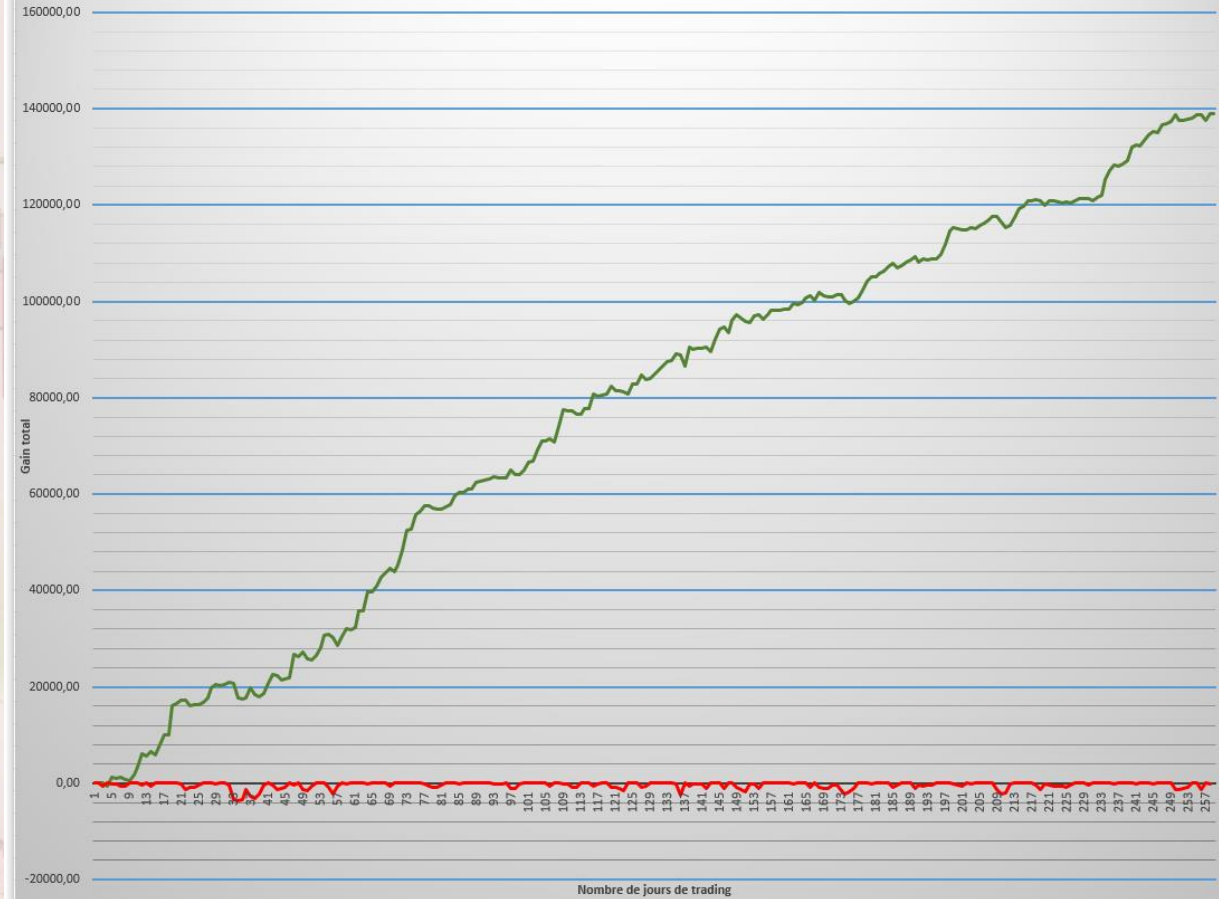
- En vert la courbe de gain
- En rouge le drawdown (perte cumulée)

Equity curve all systems



DOW Impulsions Perf/perte cumulée=55 Max DD=2600

Equity curve all systems



DOW Tendances Perf/perte cumulée=58 Max DD=2440

Quel capital pour trader ces ensembles de systèmes ?

Compte tenu de la **répartition des risques**, on peut ne considérer que la perte maximale. Elle ne doit pas dépasser 10% du capital:

- Trading de tendance : $2\,440 \times 10 = 24\,400\text{€}$
- Trading d'impulsion : $2\,600 \times 10 = 26\,000\text{€}$

En ajoutant encore d'autres systèmes aux 4 sélectionnés

- On réduira encore le risque global
- On augmentera le potentiel de gain
- On se protégera contre la perte de fiabilité d'un des systèmes.

Attention ! Aucun système n'étant éternel il vous faudra sans arrêt en chercher de nouveaux pour remplacer ceux qui faiblissent.

Conclusion

- Ne croyez pas avoir fait le tour de tout ce qu'il faut savoir, Je n'ai pas la prétention de vous avoir tout présenté. Mais vous avez maintenant accès à l'essentiel de la démarche à adopter, des pièges à éviter pour monter vos systèmes de trading.
- Ne croyez pas que ce soit facile. Monter un système nécessite des heures (jours, semaines) de travail. Vous serez souvent découragés par les échecs successifs. Ce n'est qu'en persévérant que vous pouvez espérer atteindre vos buts.
- Ne croyez pas que vous pourrez vous reposer éternellement sur votre travail. Il vous faudra régulièrement vérifier vos systèmes et en élaborer de nouveaux pour remplacer ceux qui déclineraient ou augmenter votre nombre de systèmes actifs.

Espérant vous avoir apporté, merci.

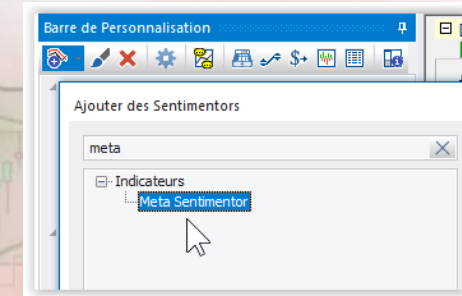
Compléments pratiques

- Principes de base du Metasentimentor
- Aide pour transférer les résultats journaliers d'un système vers le fichier excel

ANNEXES

The background of the slide is a soft-focus photograph of a flower, likely a lily, with several prominent yellow stamens. Overlaid on this image is a semi-transparent candlestick chart, which is a common tool in financial trading. The chart shows price movements with green and red bars, and some technical indicators like moving averages are visible. The overall aesthetic is clean and professional, combining natural imagery with financial data.

Aide pour Plateforme NanoTrader: Principes de base du Metasentimentor



Le MetaSentimentor est le « cerveau » de la plateforme pro « NanoTrader ».

- Lorsqu'il est mis à 100 par un indicateur (au-dessus de 76) il déclenche l'ordre d'achat.
- Lorsqu'il est mis à 40 ou moins par un indicateur il déclenche l'ordre de sortie de position.
- Inversement pour la vente : 0 (en dessous de 24) et 60.



On peut modifier les limites de déclenchement si l'on utilise plusieurs indicateurs.

Ex : On a deux indicateurs qui fournissent des signaux d'achat (ils envoient individuellement 100 au MetaSentimentor)

Si l'un envoie 100 et que l'autre reste à 50, la moyenne des deux sera de 75. Pour que le MetaSentimentor donne un ordre d'achat il faudra baisser la limite de 76 à 74.

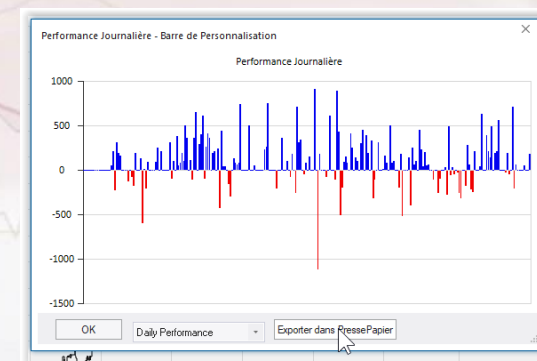
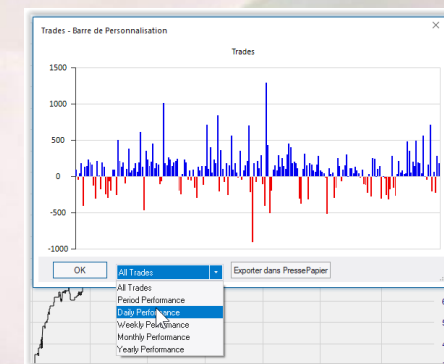
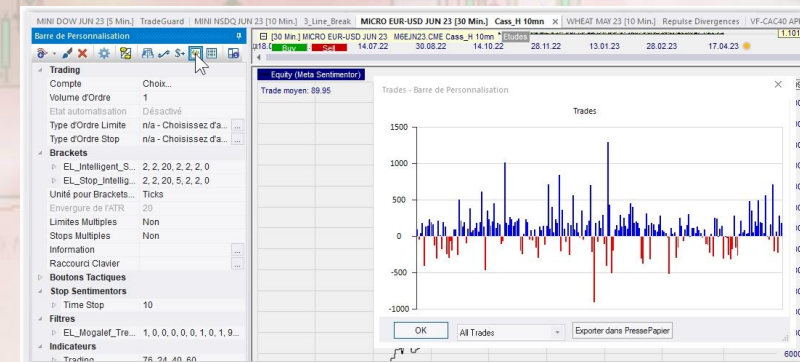


Aide pour transférer les résultats journaliers d'un système vers le fichier excel

1. Cliquer sur l'icone  de la NanoTrader dans le panneau de configuration.

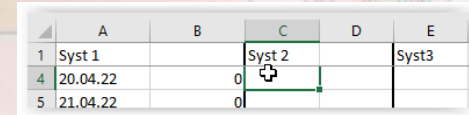
2. Sélectionnez « Daily Performance »

3. Cliquez sur « Exporter dans le Presse Papier »

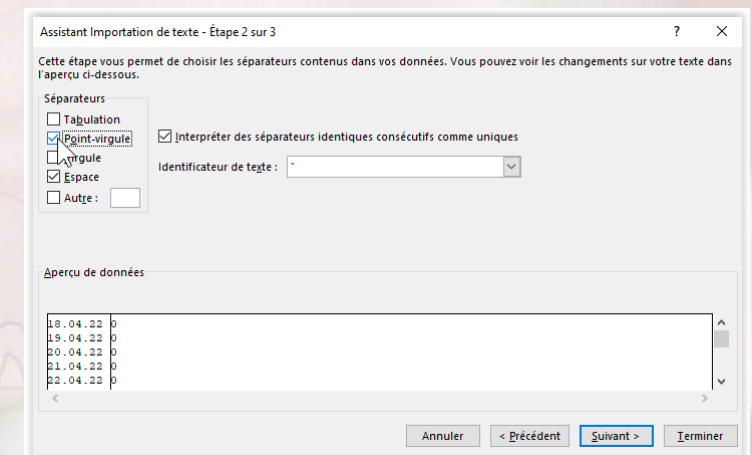
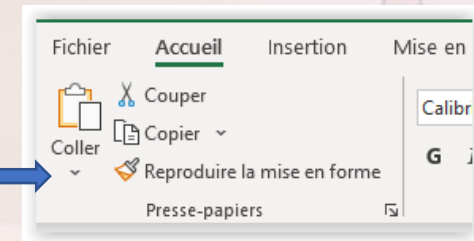


Dans le fichier Excel, si les résultats journaliers sont des nombres entiers:

- a) Clic là où vous voulez coller les résultats du test
- b) Clic **sur la flèche de l'icône Coller**
- c) Clic sur « Utiliser l'assistant importation de texte »
- d) Clic sur suivant
- e) Cocher la case « Point-virgule »
- f) Clic sur suivant
- g) Clic sur TERMINER

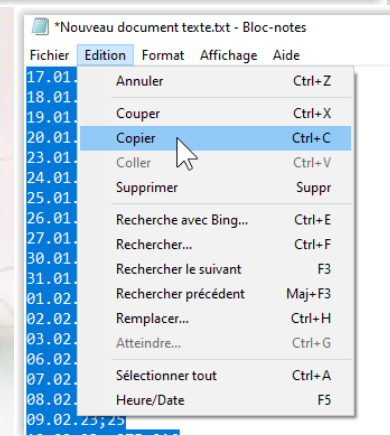
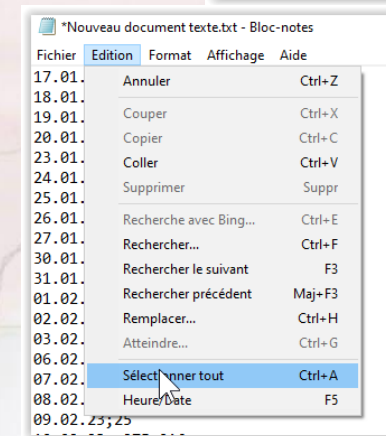
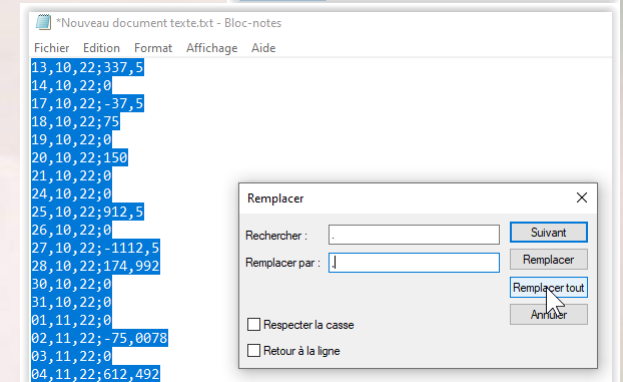
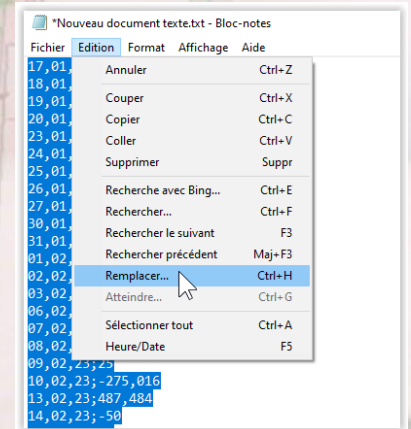


	A	B	C	D	E
1	Syst 1		Syst 2		Syst 3
4	20.04.22		0		
5	21.04.22		0		



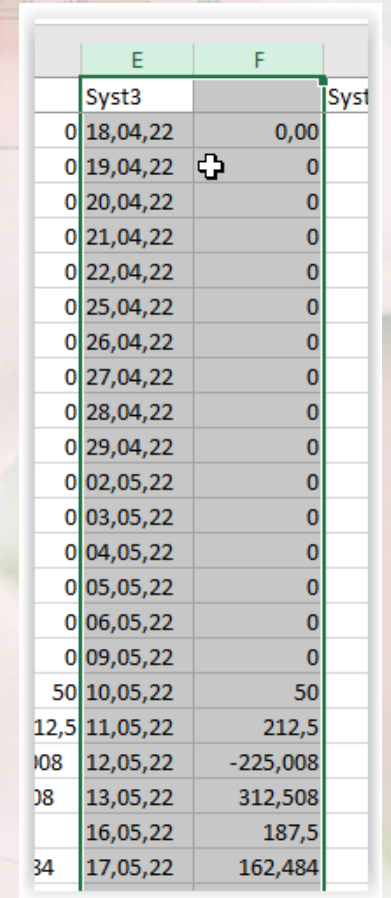
Si les résultats ne sont pas des nombres entiers

- Ouvrez un nouveau fichier TEXTE
- Collez-y ce que vous avez dans le presse papier.
- Clic sur Edition puis Remplacer
- Remplacer le point . Par la virgule ,
- Puis sélectionnez tout le contenu du fichier texte
- Copiez et **reprenez au point a)**



Pour enlever les colonnes d'un système du tableau :

- Sélectionner les deux colonnes (date et résultat)
- Clic droit sur la sélection
- Et choisir « **Effacer le contenu** »



	E	F	Syst
	Syst3		Syst
0	18,04,22	0,00	
0	19,04,22	0	
0	20,04,22	0	
0	21,04,22	0	
0	22,04,22	0	
0	25,04,22	0	
0	26,04,22	0	
0	27,04,22	0	
0	28,04,22	0	
0	29,04,22	0	
0	02,05,22	0	
0	03,05,22	0	
0	04,05,22	0	
0	05,05,22	0	
0	06,05,22	0	
0	09,05,22	0	
50	10,05,22	50	
12,5	11,05,22	212,5	
08	12,05,22	-225,008	
08	13,05,22	312,508	
	16,05,22	187,5	
34	17,05,22	162,484	