

Comment travailler ses systèmes de trading

Par **Eric LEFORT**

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

<https://www.youtube.com/@Eric-Lefort>

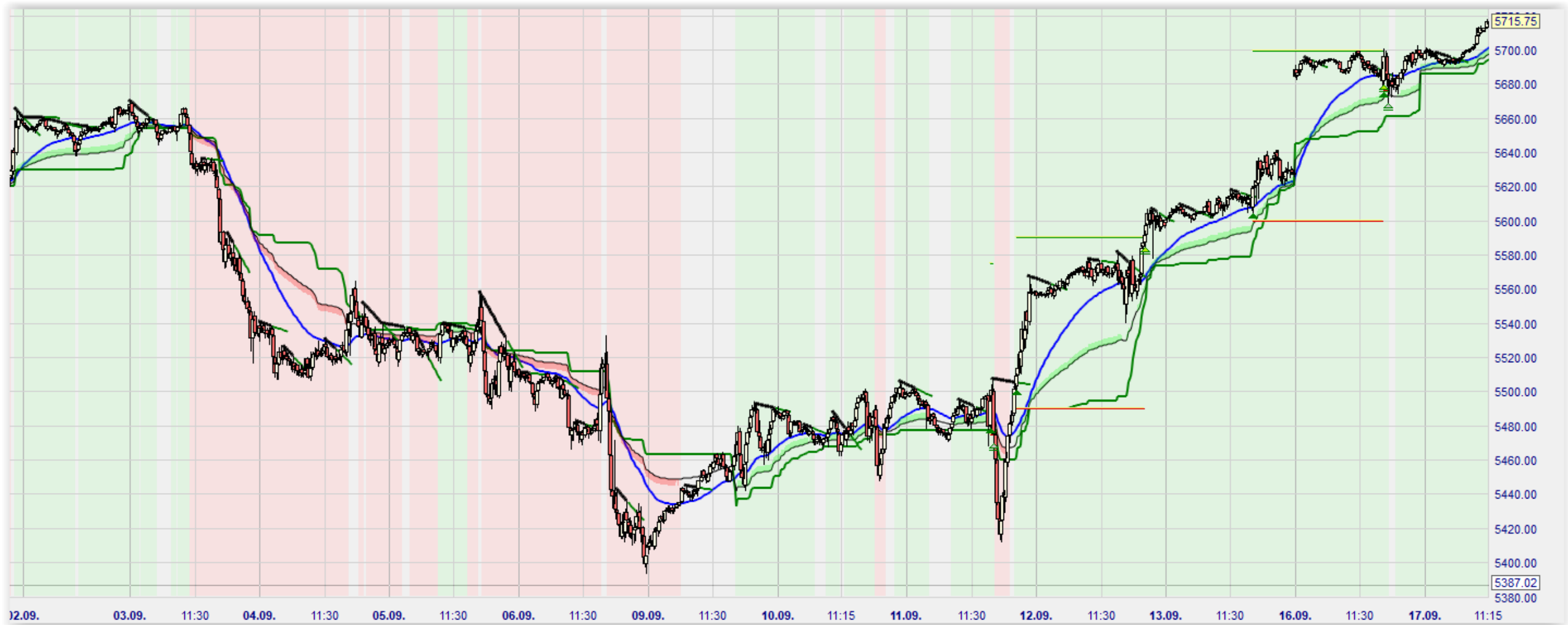
En collaboration avec

WH Selfinvest

N A N O T R A D E R

Première étape

- Choisir un support: ici ce sera le **mini S&P 500** pour du swing trading ou de l'intraday. L'unité de temps **15 minutes** convient bien pour l'élaboration d'un tel système. Les positions prises entre **8h et 21h59** pour un maximum de trades.
- Démarrer d'une idée, d'un signal, d'une configuration ou d'un filtre détecteur de tendance.
- On monte souvent un système de trading à partir d'un signal. Ici, pour changer, je partirai d'un filtre de tendance:
Le filtre « Neutral Zone »
(**EL_NeutralZone_B_V2** que vous pourrez trouver en téléchargement sur le site Mogalef-Trading)
- Principe : on examine le sens de deux indicateurs, **une moyenne mobile exponentielle** (150 pour les repères mais 50 pour le filtre) et **le RET90** (milieu du range des 90 dernières bougies)



- Ce filtre est basé sur le sens concordant des deux indicateurs

Intégrer un signal d'entrée

- Pour faire simple et parce que cet indicateur que j'ai mis au point est en standard dans la plateforme NanoTrader:
La cassure haussière ([SignalBullishBreakoutLine_v2](#)
ou bien [EL_Bullish_Breakout2](#) que vous pourrez trouver en téléchargement sur le site Mogalef-Trading)



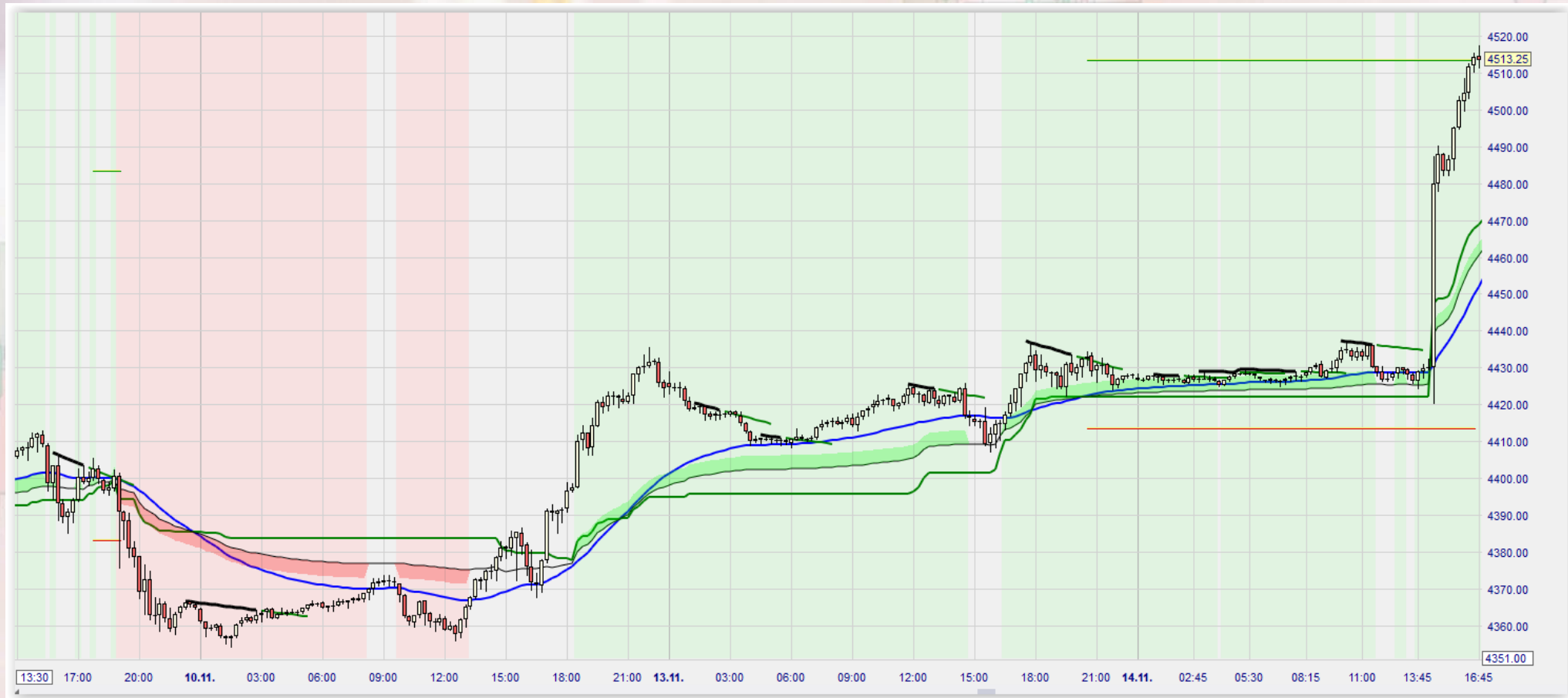
Un signal d'entrée c'est bien, mais il faut un ou plusieurs signaux de sortie.

- J'ai examiné des sorties sur stop suiveur sans rien trouver de prometteur.
- De toute façon il faut obligatoirement un stop fixe pour protéger le capital. Donc stop fixe posé arbitrairement à 15 points.



Il faut une ou plusieurs conditions de sortie

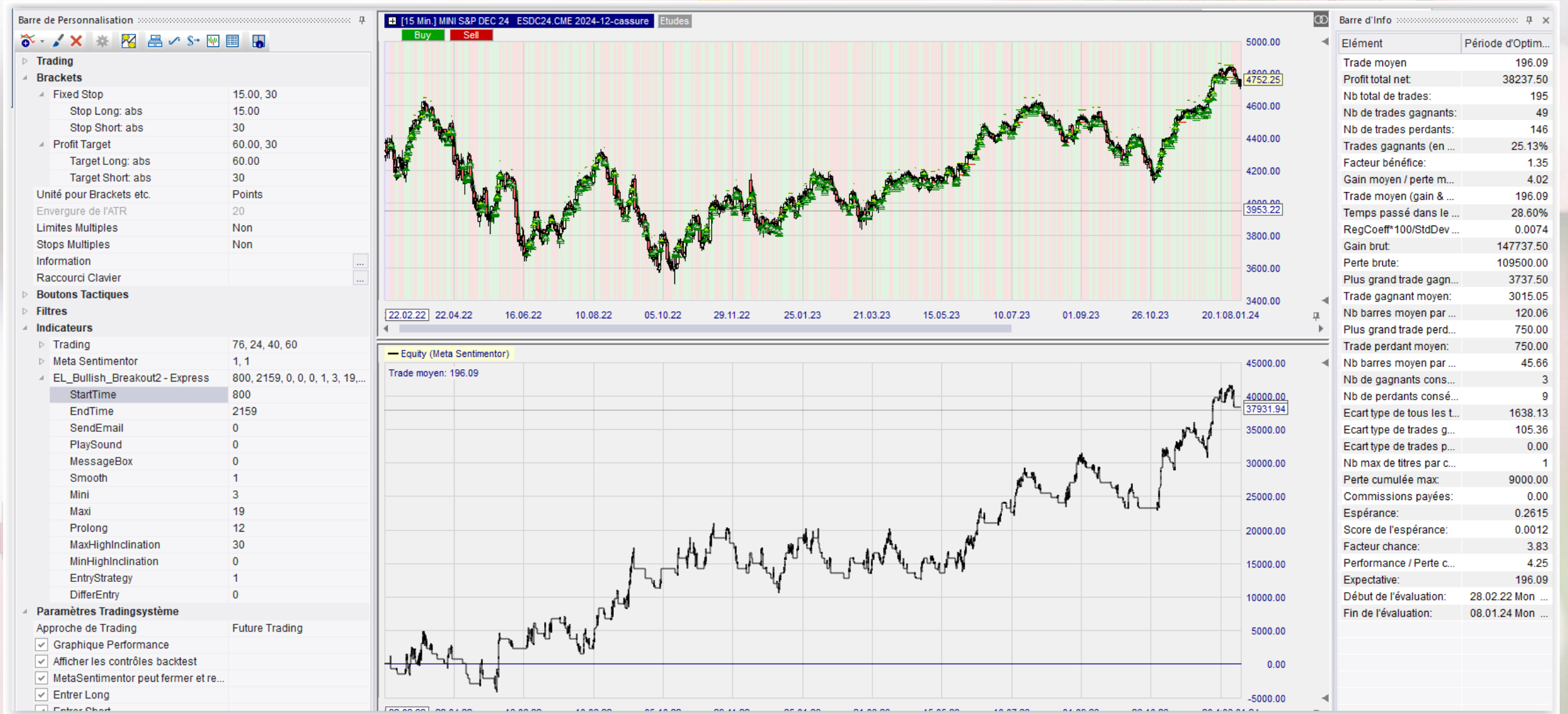
- Je teste au plus simple, c'est-à-dire un objectif fixe.
- Je le fixe au jugé à 60 points, 4 fois le risque dans un premier temps. On verra plus tard pour ajuster l'ensemble stop-objectif.



On peut maintenant estimer un premier résultat

- Compter le spread en slippage puisqu'on va le payer en entrée.
- Les frais varient suivant les individus.
- On regarde les 1000 derniers jours.
- **Pour pouvoir vérifier ensuite sur des données non vues nous faisons la mise au point du système sur les premiers 600 jours et nous gardons les 400 derniers comme échantillon de vérification.**

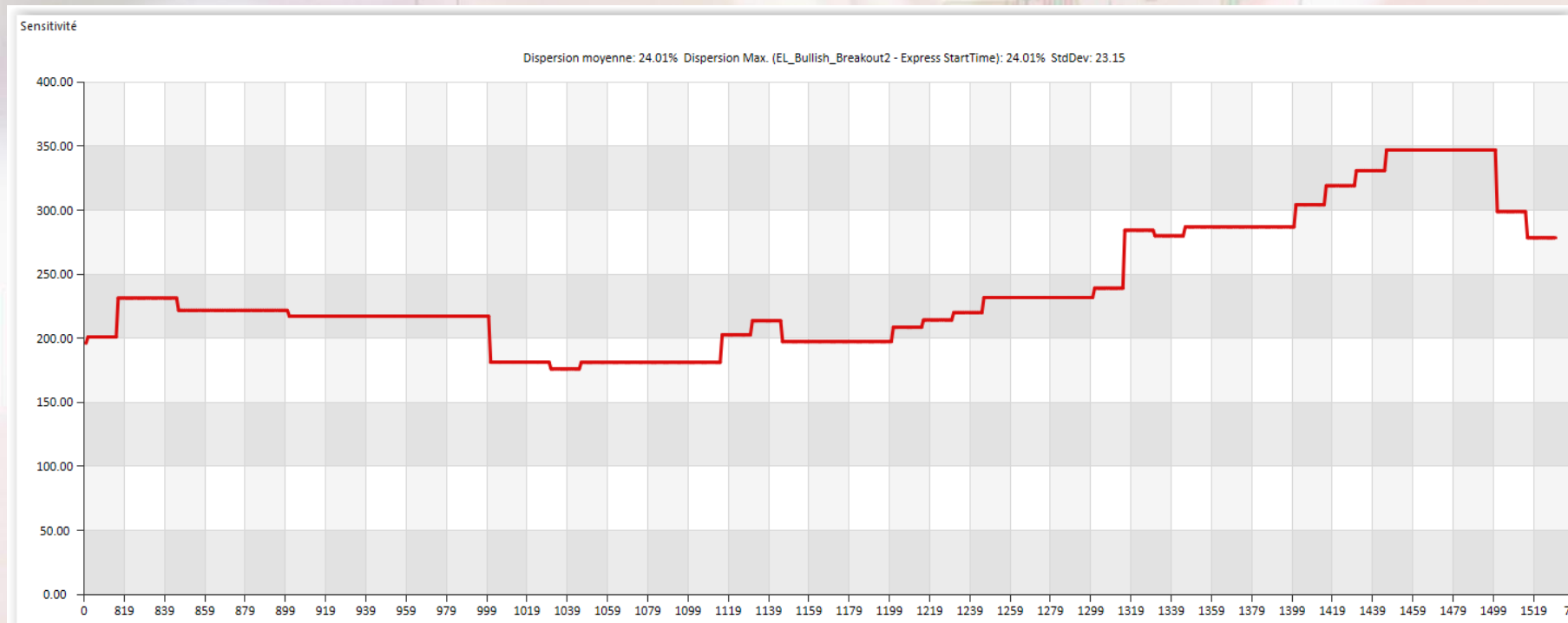
Etude des 600 premiers jours



horaires

- Trade moyen en fonction de l'heure de début du trading

Indicateurs	
Trading	76, 24, 40, 60
Meta Sentimentor	1, 1
EL_Bullish_Breakout2 - Express	800, 2159, 0, 0, 0, 1, 3, 19, ...
StartTime	800
EndT	Visualisation ...
Send	Afficher le sentimentor dans une sous- fenêtre du grap
PlayS	Aggregation ...
Mess	Modifier Interprétation ...
Smoc	Supprimer Sentimentor Actif
Mini	Remise à zéro Sentimentor Actif
Maxi	
Prolo	Sensibilité du Sentimentor ...
MaxH	Sensibilité du Paramètre
MinHi	
Entry	Recherche Tabou pour Sentimentor actif ...
Differ	Recherche Exhaustive du Paramètre actif ...



Il faut comprendre que **plus on restreint la période d'entrée, moins on prend de trades.**

On doit donc trouver un juste milieu : bonne rentabilité par trade et nombre de trades maximum.

Ici, en commençant à 13h on a un bon compromis.

Objectif

Brackets

Fixed Stop	15.00, 30
Stop Long: abs	15.00
Stop Short: abs	30
Profit Target	60.00, 30
Target Long: abs	60.00
Target Short: abs	30.00

Unité pour Brackets etc.

Envergure de l'ATR

Limites Multiples

Stops Multiples

Information

Raccourci Clavier

Boutons Tactiques

Filtres

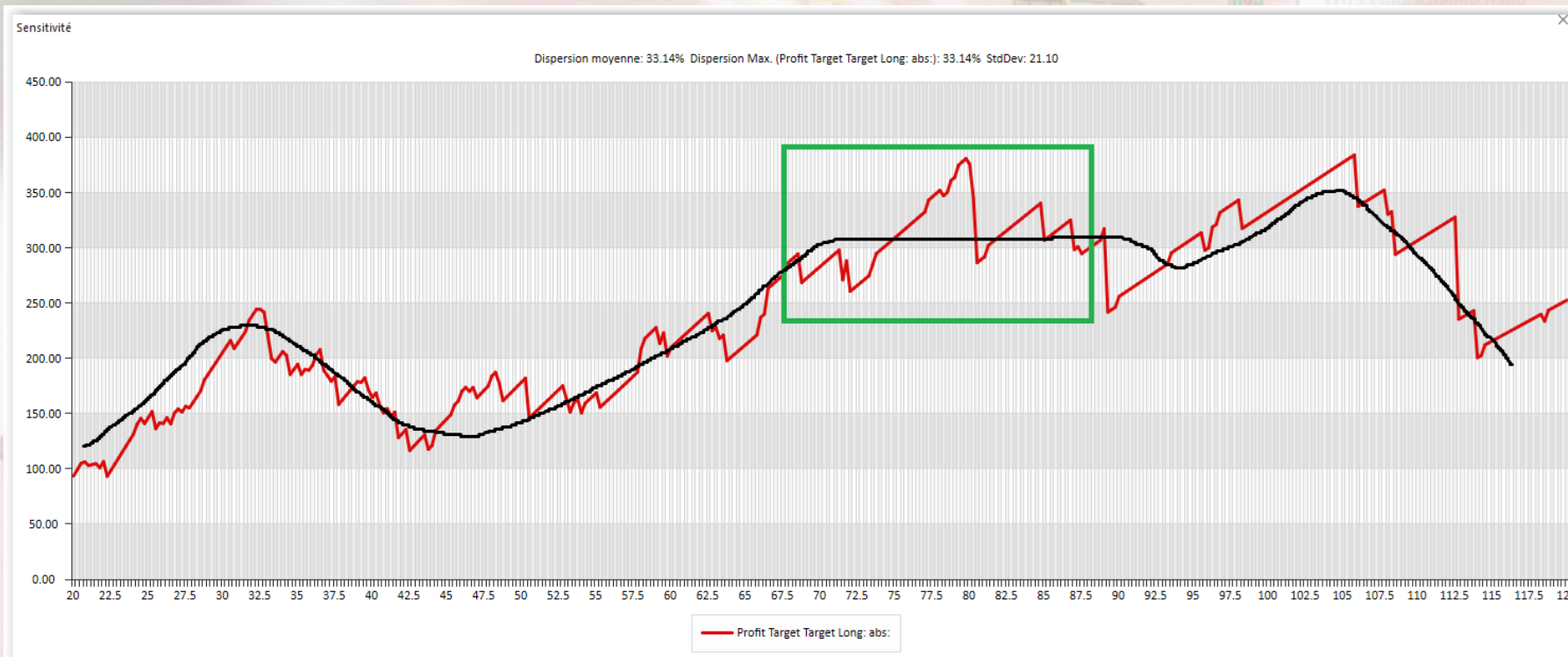
Indicateurs

- Visualisation ...
- 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

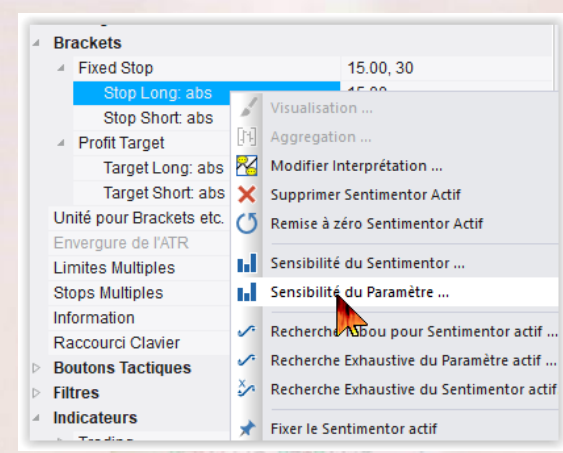
On ne recherche surtout pas la meilleure valeur !

Ici on a une zone à peu près homogène **autour de 80 points**.

79,50 serait très nettement meilleur mais utopique quant à la pérennité des résultats.



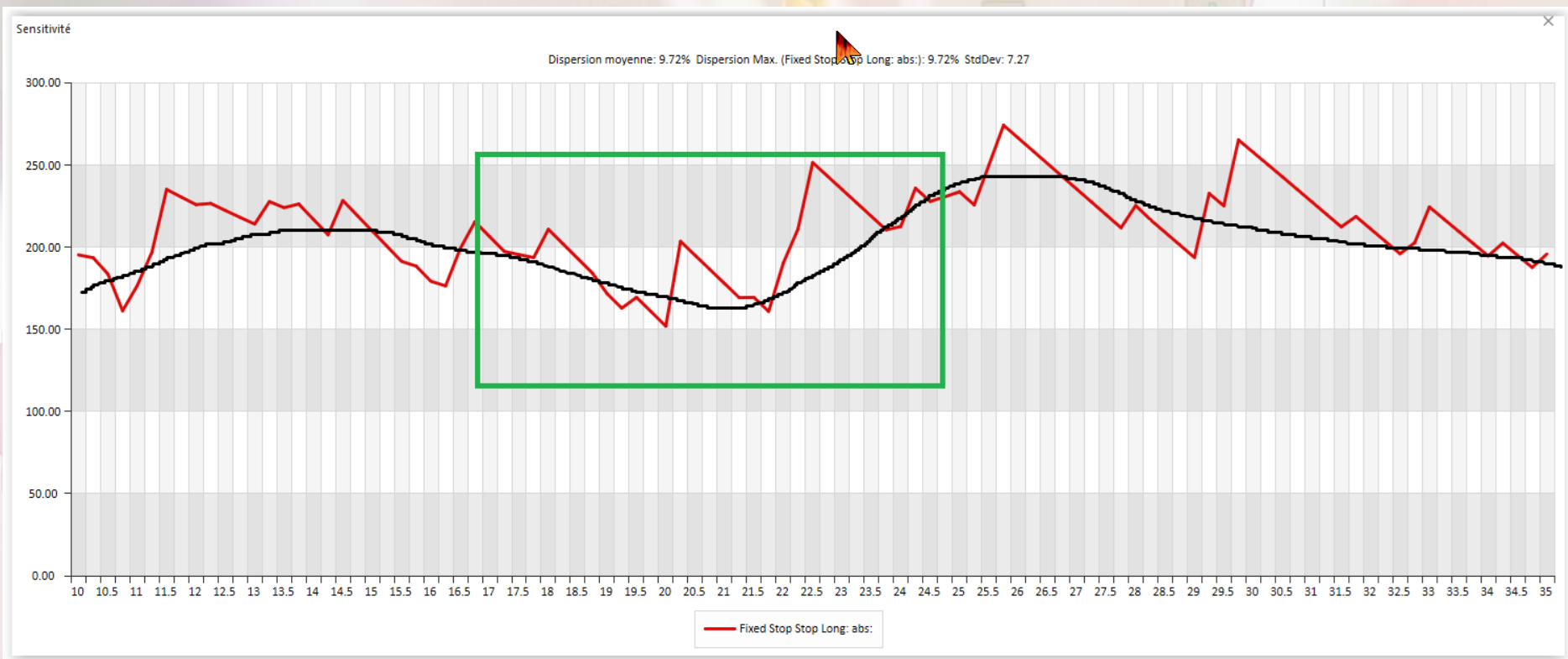
Stop loss



Nous avons peu de différence entre les diverses tailles d'objectif.

Pour garantir autant que faire se peut la stabilité de nos résultats futurs il nous faut rechercher ou bien une zone plate, ou bien un creux de type « volcan ».

Ici nous avons un creux autour de 80. C'est certes la valeur la moins bonne, mais c'est celle qui nous donne le meilleur espoir de validité.



Résultat avec stop 20 et target 80

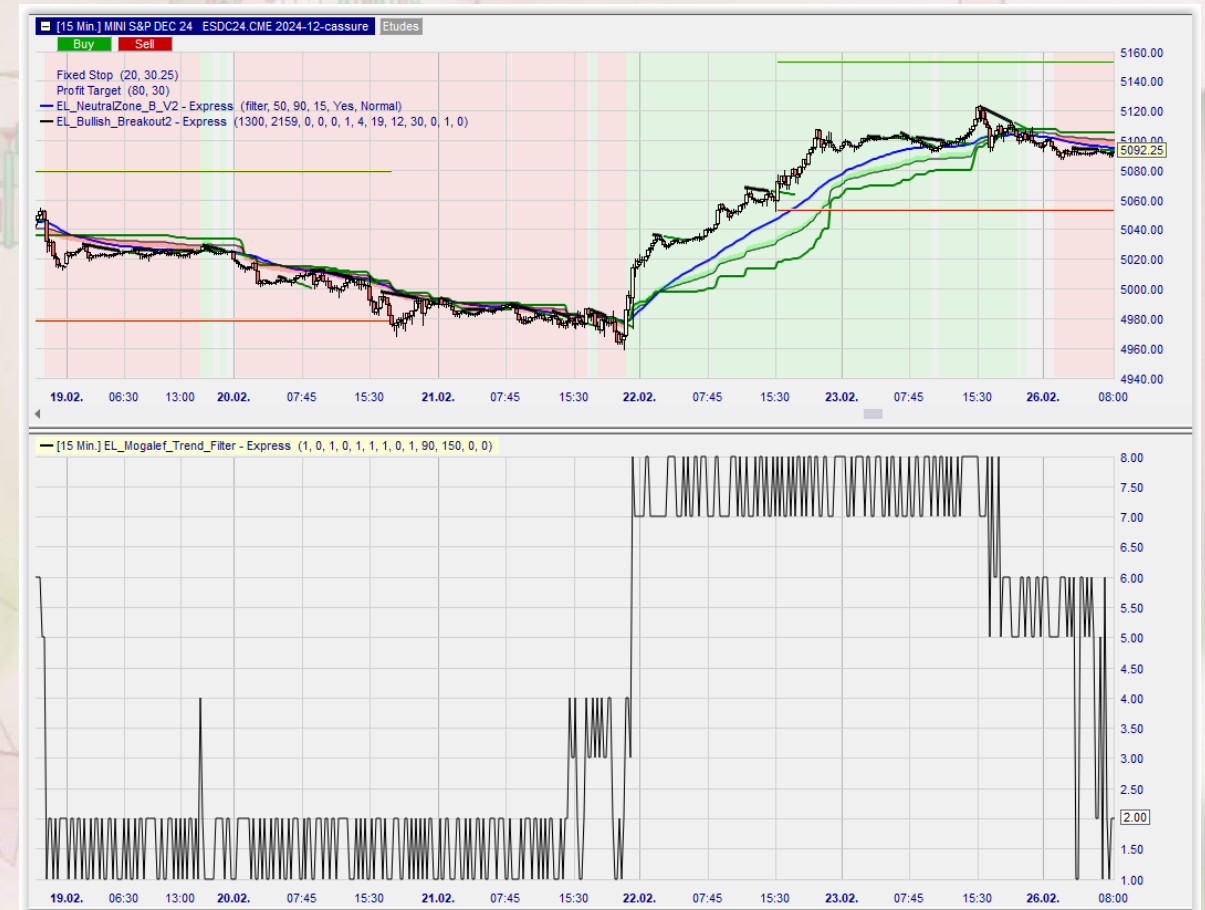
Nous sommes passés d'un trade moyen de 195 à 389.

La courbe de gain manque cependant de régularité. Il faudrait encore éliminer des trades perdants.

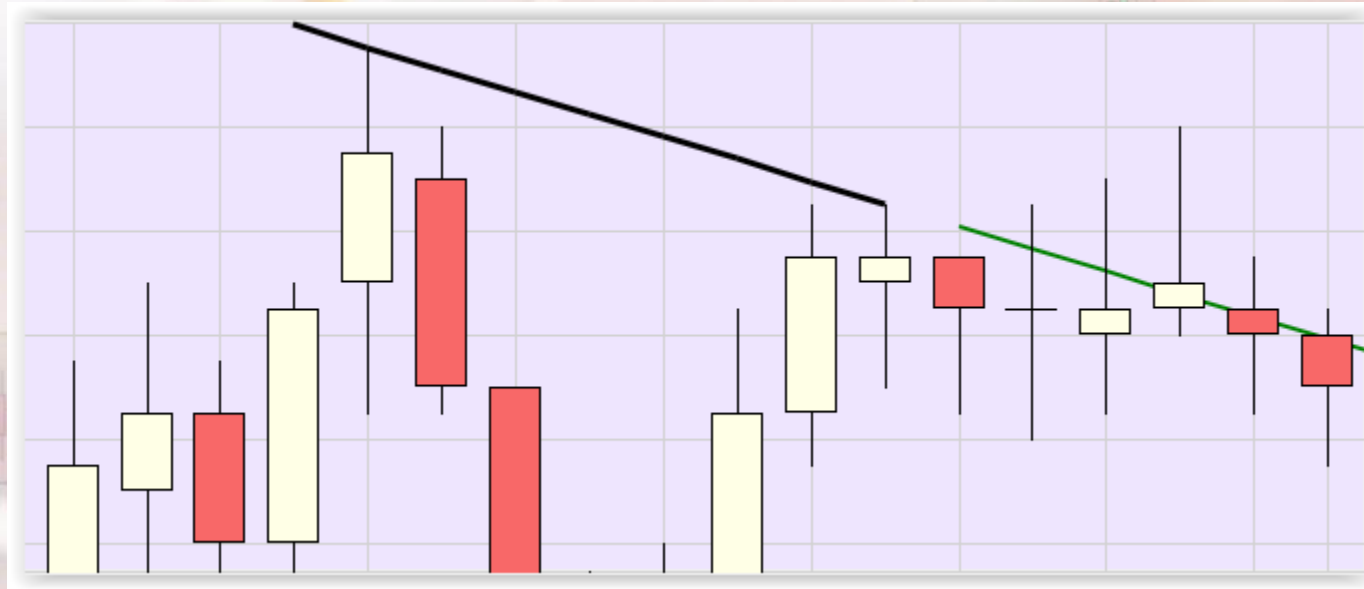


Ici intervient le « Mogalef Trend Filter »

- Ce filtre va nous permettre de sélectionner les configurations des cours favorables aux gains.
- Suivant la valeur du MTF au moment du signal d'achat nous allons entrer ou pas.
- Examinons donc les courbes de gain en fonction de la valeur du MTF.



Le MTF examine la **poussée** et non pas l'évolution



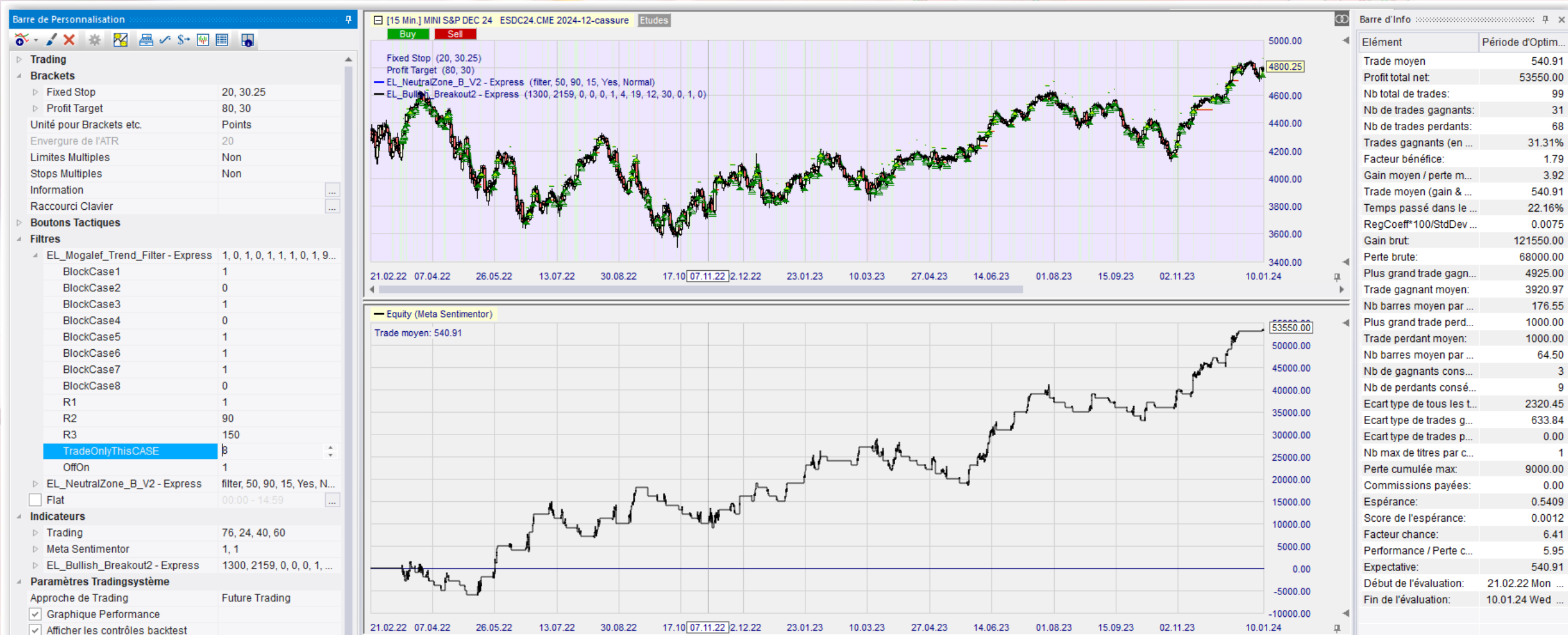
La bougie de signal est blanche.

Si l'on examinait l'évolution des cours alors on prendrait ce signal.

Mais la poussée est négative (cas 1 ou 3 ou 5 ou 7 du MTF)

Il est donc logique de ne pas prendre les signaux dans les cas 1-3-5-7 du MTF

La grande majorité des trades ont lieu quand **MTF = 8**
 Le trade moyen est à 540 points soit bien au-dessus des 389.



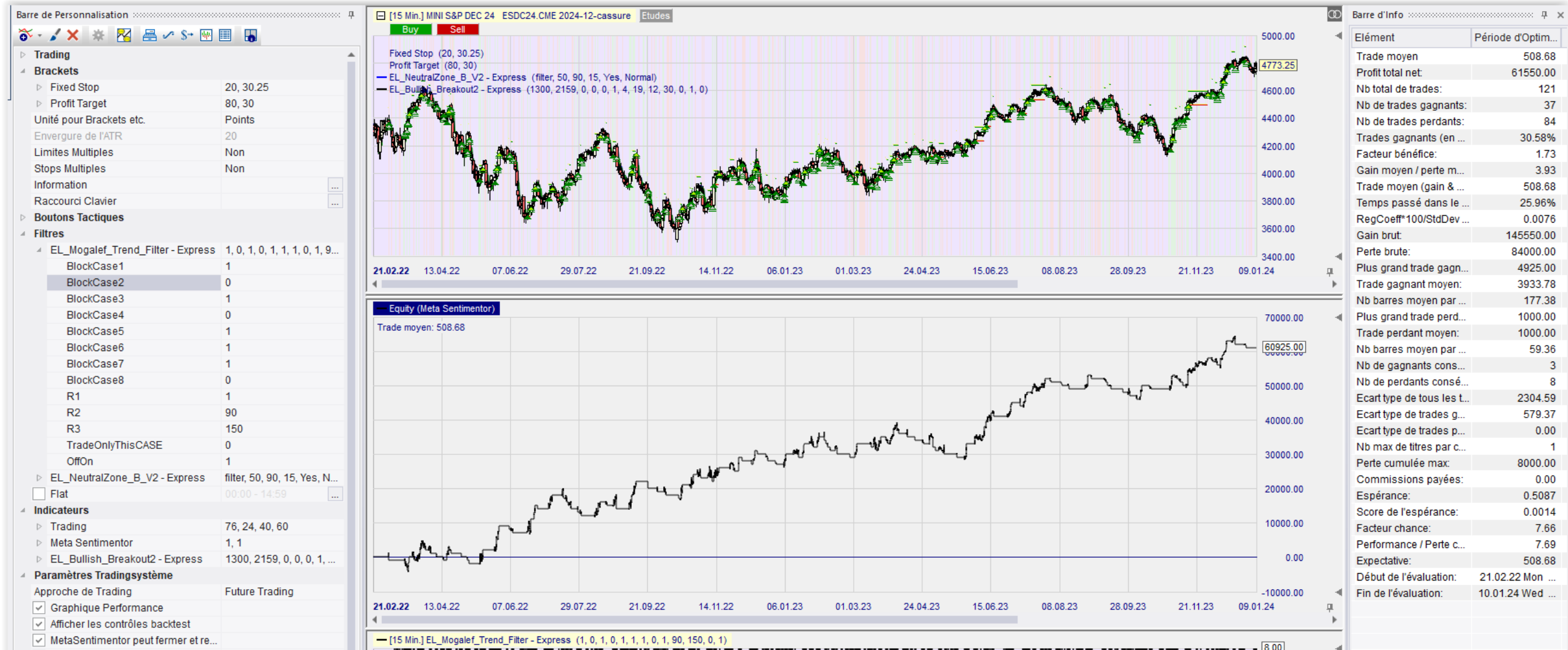
On regarde la courbe de gain pour chaque valeur du MTF

Exemple : MTF = 6.

On ne prend pas les signaux si MTF = 6 !



Résultat sur la période de travail



Optimisation

- On a optimisé le stop et l'objectif avec des plages de stabilité larges.
- On a rajouté un filtre supplémentaire (le MTF)
- On a réduit l'intervalle de temps pendant lequel on suit les signaux.

On pourrait :

- Optimiser le signal de cassure
- Optimiser les paramètres du MTF ou le filtre « Neutral Zone ».

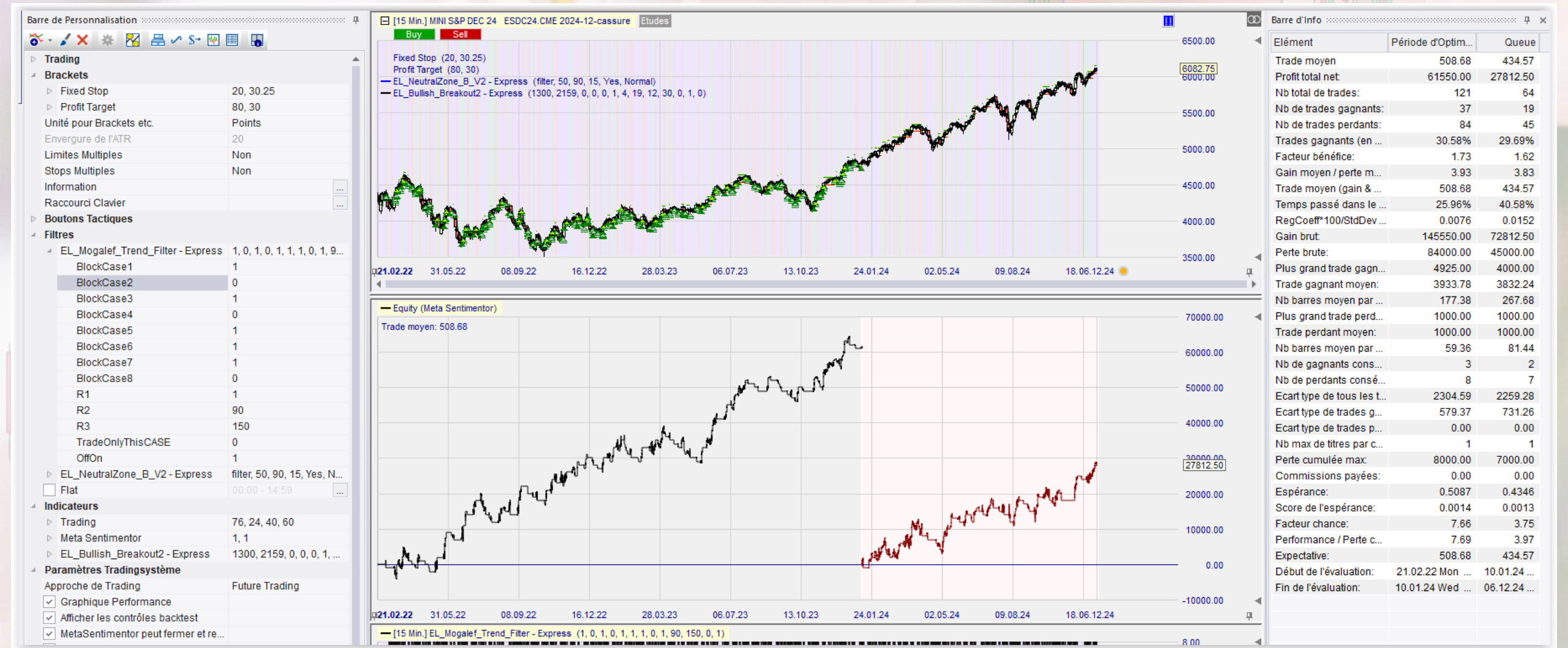
Mais plus on optimise, plus le système sera fragile et moins nous aurons de chances qu'il fonctionne dans le futur.

Résultat sur la période suivante (non vue)

Les résultats sont un peu moins bons mais restent très favorables.

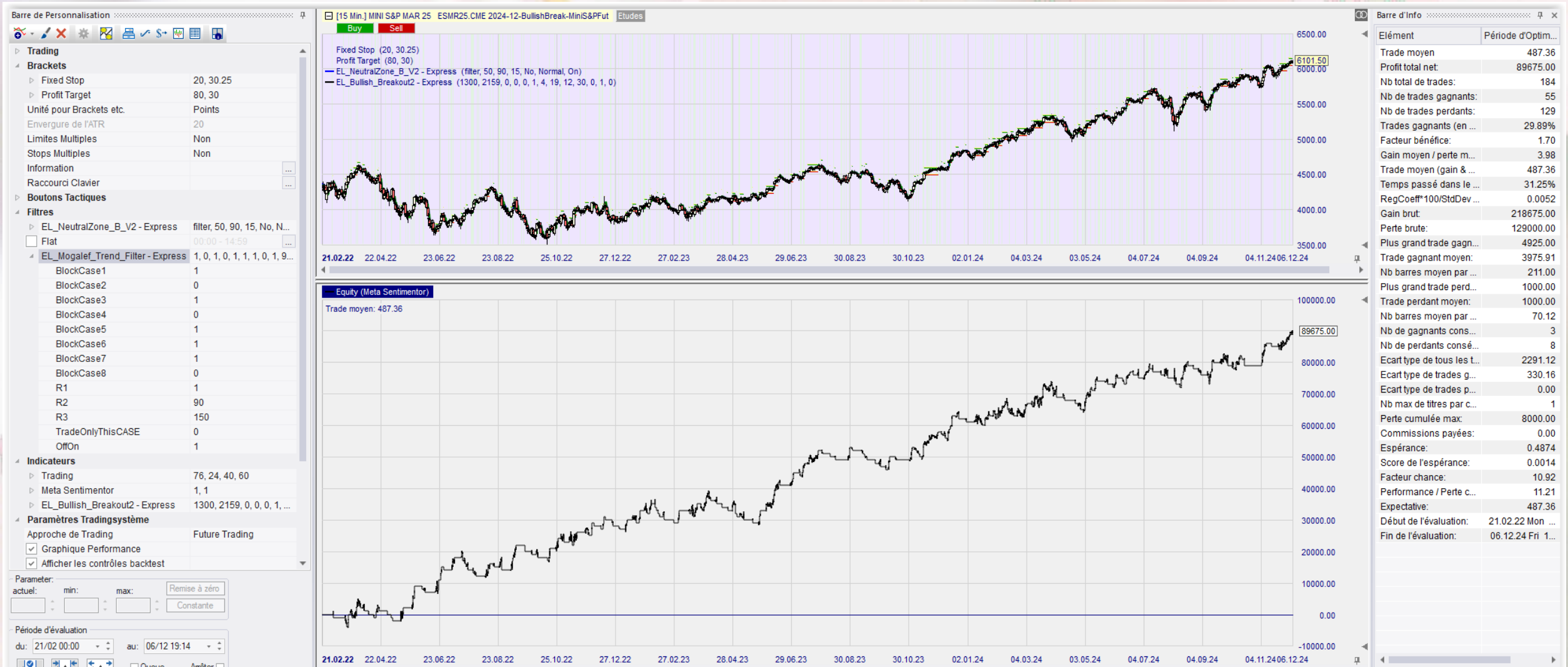
Notre système est maintenant au point.

0,22 0,19



Sur l'ensemble des 1000 jours

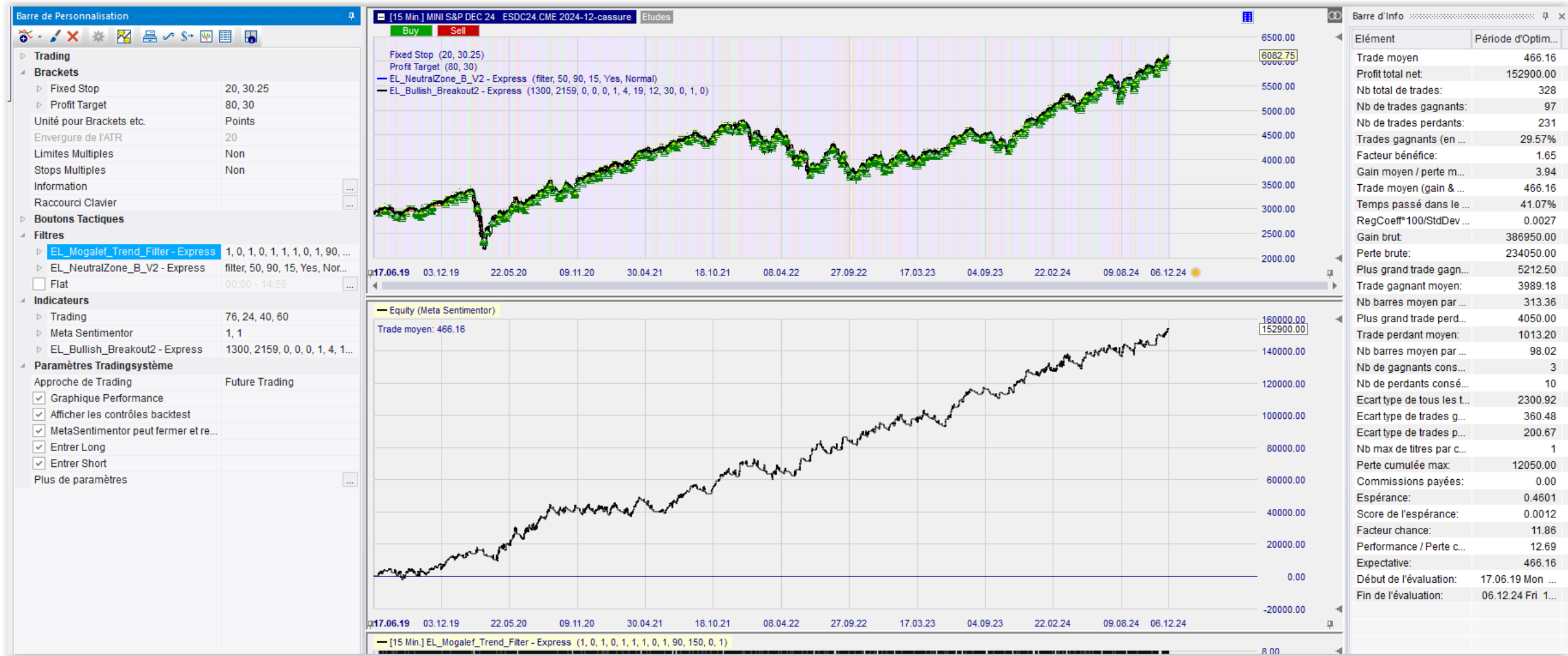
0,21



Mais ... et si l'on regardait avant ?

- On passe de 1000 à 2000 jours d'historique

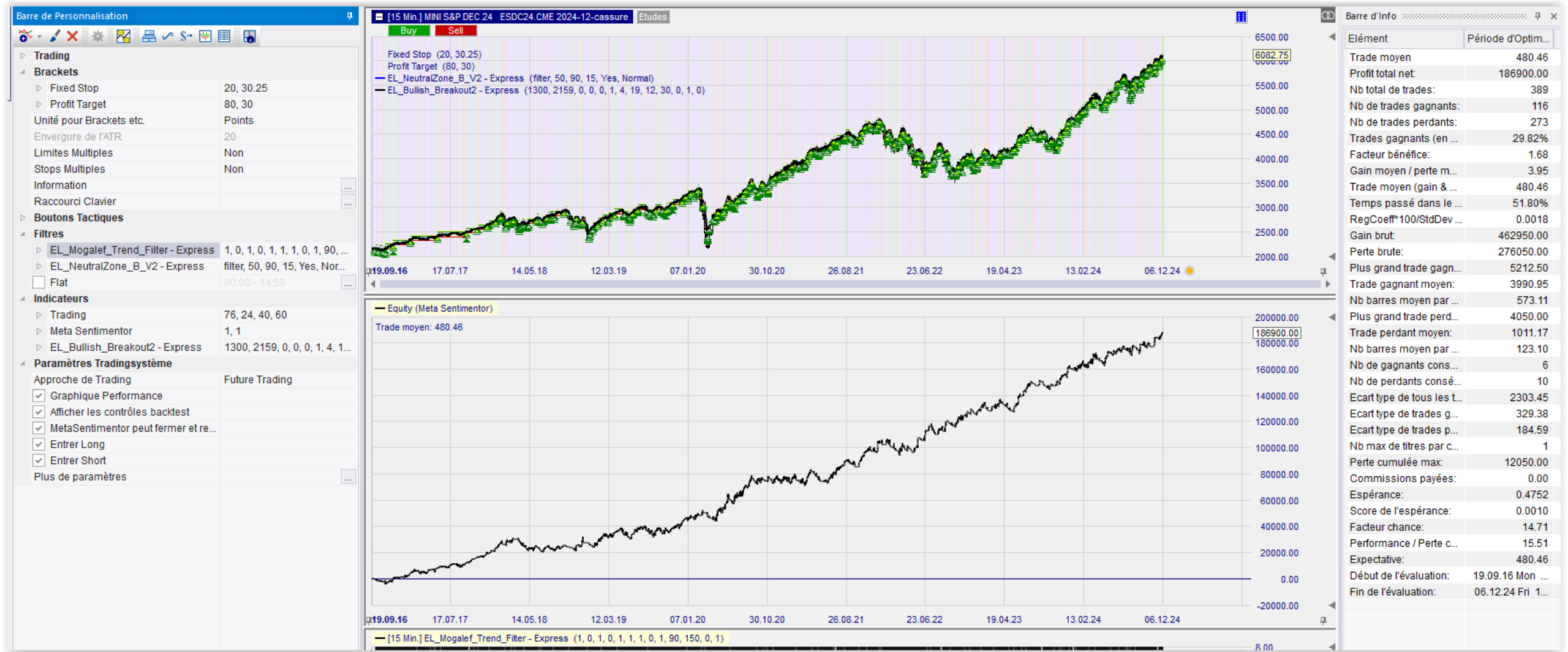
0,20



Mais ... et si l'on regardait avant ?

- On passe de 2000 à 3000 jours d'historique

0,21



Pour résumer on doit :

- Choisir une période de mise au point et garder une période de vérification.
- Intégrer le signal.
- Un stop loss pas forcément fixe mais admissible pour le money-management.
- Un objectif et/ou un stop suiveur.
- Une sélection des horaires de trading.
- Un ou deux filtres, pas plus.
- Ne pas chercher les meilleures valeurs d'optimisation des paramètres.
- Régler les optimisations sur des plages stables ou des « creux de volcan ».
- Pratiquer le moins d'optimisations possible.

Espérant vous avoir apporté durant toutes ces années,
merci de votre attention.