



Bonjour Jeff_X,

Merci pour ton intéressant brainstorming. Il a eu le mérite de bien reposer le pb et d'amorcer l'écriture du cahier des charges.

Car il est évident que si cahier des charges il n'y a pas, il ne faudra pas que nous nous étonnions qu'il apparaisse parfois des résultats bizarroïdes comme tu le dis, i.e. l'algorithme qui sera développé devra prévoir tous les cas de figures et quoi faire face à eux.

La question du nombre de points qui doivent être alignés pour considérer que la ligne de tendance est viable est la question centrale en effet et va déterminer la complexité de l'algorithme.

Il me semble difficile de prendre 3 points à moins de nous tourner vers une droite de régression comme le conseillait récemment ggo.

Tu exigerai dans ce cas un coeff de régression=1 dis-tu. Est-ce vraiment indispensable? Si on exige ceci cela veut dire que les 3 points sont alignés et c'est tant mieux. Ne pourrait-on pas autoriser un petit intervalle de tolérance? Un $R^2 \geq 0.98$ ou 0.97 ne serait-il pas suffisant? On aurait là un processus flexible pas très difficile à programmer. A essayer c'est sûr.

Si on abandonne l'idée de ggo maintenant, il se trouve, belle coïncidence, que j'ai déniché dans mes docs un article de Giorgos Siligardos paru dans TASC en novembre 2006 (v24:11) et qui est intitulé :

"A Computerized Approach To A Fundamental Analysis Tool, **Building Automatic Tendlines**"! Article dans lequel il développe une méthode pour tracer des droites de tendance.

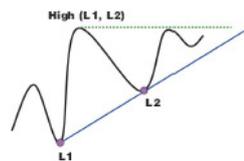
Peut-être serait-il intéressant que j'en donne quelques éléments? Peut-être pas besoin de réinventer la roue...

Je tiens à ta disposition un pdf de l'article en question si cela t'intéresse d'y jeter un coup d'oeil. Même proposition pour les amis qui seraient intéressés. Une adresse email en PV et je te l'envoie, je vous l'envoie.

Pour résumer sommairement l'approche de Siligardos :

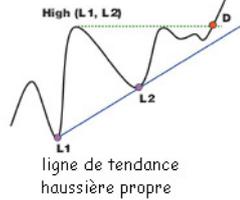
- il se place dans une approche à 2 points;
- il considère 3 stades pour une ligne de tendance : la ligne potentielle, la ligne propre et la ligne propre/active.

Les figures qui suivent sont tirées de son article.

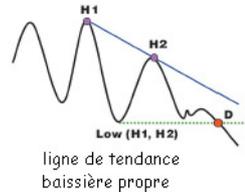


ligne de tendance potentielle

Une ligne de tendance haussière joignant les deux plus bas successifs L1 et L2 n'est que **POTENTIELLE** si son tracé est effectué sans regarder ce qui se passe après L2 par rapport au niveau plus haut qu'atteignent les cours entre L1 et L2 (noté High(L1,L2) sur la figure).

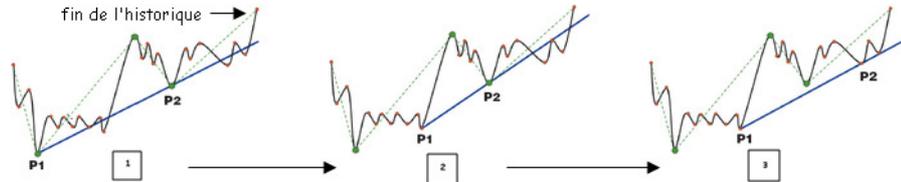


La ligne de tendance devient *PROPRE* lorsqu'on s'est assuré que sa prolongation au delà de L2 ne coupe pas la courbe des cours et que le plus haut entre L1 et L2 (High(L1,L2)) peut très bien être dépassé (point D). C'est peut-être ce critère, non pris en compte dans le proto précédent, qui conduisait à des figures bizarres dans certains cas.



Même chose pour la ligne de tendance baissière H1-H2 qui est propre car elle n'intersecte pas les cours au delà de H2, le plus bas entre H1 et H2 (Low(H1,H2)) étant dépassé.

Enfin pour Siligardos la ligne de tendance devient *PROPRE/ACTIVE* si les conditions énoncées ci-dessus pour que la ligne de tendance soit propre sont satisfaites jusqu'à la fin de l'historique.



On voit sur les figures 1, 2 et 3 ci-dessus la progression de son algorithme pour aboutir finalement à une ligne de tendance haussière viable en fin d'historique. Les gros points verts sont des points de swing déterminés par un zigzag à x% de seuil. Les points rouges étant les points des cours de clôture. On peut imaginer, comme nous l'avions fait, une recherche par une méthode différente de ces points de swing.

Serais-tu d'accord pour qu'on s'inspire de cette étude pour établir le cahier des charges ?

Ceci posé je suis d'accord pour ne conserver qu'un paramètre pour définir la zone en fin d'historique dans laquelle l'éventuelle droite de tendance sera tracée. Sa valeur numérique est à définir.

Comme toi Jeff je souhaite un travail coopératif et bien sûr ce vœux s'adresse à tous les amis intéressés et aussi aux "silencieux" qui visitent cette file...
Merci par avance pour vos remarques et propositions.

Cordialement.

PS : Mon québécois est superficiel je le reconnais 😊... réminiscence de deux voyages effectués là-bas en 1996 et 2002 et comme je n'ai pas retrouvé le petit carnet dans lequel j'avais consigné les expressions les plus "colorées", ma mémoire défaille. Mais je suis sûr qu'avec cette étude on ne va pas...flagosser et qu'on aura beaucoup de fun même si on pitonne dur!

édité le : 26-11-2009 11:20:53



J'aime : 0 !



#1063917



Posté le : le 26-11-2009 12:06:13 [-] [img alt="Print icon"] [img alt="Share icon"] [img alt="Reply icon"]

#1064061

Parisboy



Bonjour SmallCaps, Bonjour Jeff X,

c'est effectivement un sujet intéressant.

Je voudrais apporter 2 pierres à l'édifice.

Dans son livre Profit Magic of Transaction Timing et dans son cours J.M. HURST développe la notion de VALID TREND LINE (VTL).

Pour lui Une Valid Trend Line n'est pas autre chose que la ligne passant par 2 points bas ou 2 sommets appartenant au même cycle.

Ces droites de tendances sont dites Valides parcequ'elles relient des points de même NATURE, de même degré.

Ce qui est tout aussi intéressant ce sont les conséquences que l'on peut en tirer quand elles sont "cassées" par les prix.

La cassure valide définitivement le plus bas ou le sommet précédent de même nature.

En terme Elliottiste on pourrait dire que la cassure valide le nouveau mouvement (haussier ou baissier) non plus comme

(599 msg)



correctif au sein de la tendance précédente mais comme impulsif.

Ci dessous le CAC 40 et ses VTL



J'aime : 0 !

#1064061



smallcaps90

Posté le : le 26-11-2009 14:26:57 [-] [img alt="Print icon"/> [img alt="Share icon"/> [img alt="Reply icon"/>

#1064169



Bonjour Parisboy,

Merci pour l'intérêt que tu manifestes pour le pb qui nous occupe actuellement.

J'ai le grand bouquin bleu de Hurst dans sa réédition de 2000 depuis 2005 et je l'avais oublié! Pourrais-tu m'indiquer les n° des pages où se trouvent les définitions que tu nous donnes?

J'ai aussi un pdf de celui de Millar : "Channel and cycles : a tribute to J.M. Hurst" de 1999, qui reprend et surtout approfondit les travaux de Hurst qui datent de 1970.

Si nous suivions ta proposition cela voudrait dire qu'il faudrait changer d'approche en privilégiant celle de Hurst préalablement à la recherche des points par lesquels il faudrait tracer les lignes de tendance...

Qu'en pense Jeff_X dans sa "Belle Province"? Je suppose qu'il nous le dira sous peu.

Pour ce qui concerne l'approche elliotiste, pour ma part je ne l'utilise pas.

J'avais écrit un petit programme qui devait tracer les canaux de Hurst avec GAP (GrapheAT Pro), il est toujours à l'état de proto...assez bugué...

A propos qu'utilises-tu comme soft?

Cordialement.

PS : Je t'envoie le pdf dans l'après-midi car je dois m'absenter un moment là.

édité le : 26-11-2009 14:28:28

J'aime : 0 !

#1064169



Parisboy

Posté le : le 26-11-2009 15:07:23 [-] [img alt="Print icon"/> [img alt="Share icon"/> [img alt="Reply icon"/>

#1064197



Bonjour Smallcaps,

Au Chapitre 3 page 52, HURST a un paragraphe intitulé,

" Why Trend Lines and Channels Form and repeat "

Au chapitre 4 page 78 et 79 HURST donne la définition d'une Valid Trend Line (VTL) dans le paragraphe intitulé "**Recognizing the Valid Trend Line "**

Je te conseille la lecture des paragraphes suivants :

- Edge Band Transaction Timing
- et Mid-Band Transaction Timing

où HURST explique comment utiliser les VTL en combinaison avec les points bas potentiels des cycles pour déterminer un point d'entrée

Enfin l'ensemble du Chapitre 8 où HURST utilise l'ensemble de ses outils et où il décrit le suivi d'une transaction

- quand entrer
- comment entrer
- comment suivre l'évolution de la transaction en utilisant les différentes VTL
- quand et comment sortir en utilisant les Trailing Loss Level (TLL) (Chapitre 5 page 86 à 91)

J'ai aussi le livre de MILLARD. En fait ce dernier travaille quasi exclusivement sur les Enveloppes, Canaux / Channels, Dominancy Enveloppes quelque soient le nom qui leur est attribué.

Etant un petit artisan investisseur 🧑🏻‍🔧 j'utilise principalement EXCEL.

Par ailleurs tu peux consulter ma file sur INVEST-AT où j'explique en détail (page 24 et suivantes) comment on construit une VTL, et comment l'utiliser.

Le tout avec des exemples variés et utilisant un passé récent, voire actuel.

<http://www.invest-at.com/forums-bourse/bourse-24-2...>

En ce qui concerne l'approche Elliottiste il ne faut pas (à mon avis) jeter le bébé avec l'eau du bain.

La notion de Vague est essentielle.

HURST y fait référence dans son petit livre **Cyclic Analysis**.

Il décrit sa théorie sous le nom de *The Wave Theory of Price Action*.

Il explique page 9 à 11 **The Quantification of Trends using Wave Concepts**.

Il y définit la notion d'**Underlying Trend** (Tendance Sous-jacente) et celle de **Valid Trend Line (VTL)**

Ensuite j'ai intégré à mes analyses les notions de Vagues Impulsives et de Vagues Correctives.

Là on rejoint l'Analyse Cyclique et la notion de Tendance sous-jacente.

édité le : 26-11-2009 15:53:57

J'aime : 0 !

#1064197



Parisboy

Posté le : le 26-11-2009 16:30:06 [-]

#1064287



Smallcaps, Jeff X,

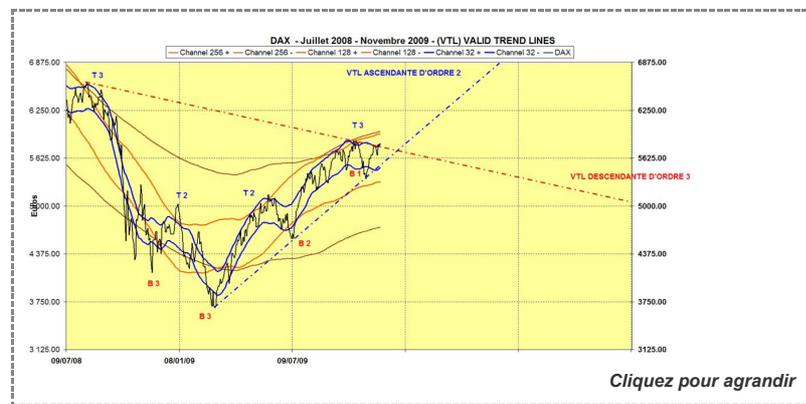
je ne voudrais pas polluer cette file avec mes dadas favoris.

Mais en ce qui me concerne la méthode générale de HURST (enfin ce que j'en ai compris 😊) c'est le truc le plus performant que je connaisse.

(599 msg)



Je vais vous détailler un exemple avec le DAX.



Pour ce faire j'utilise 3 Canaux différents (parfois 4) basés sur une moyenne mobile centrée en leur ajoutant un valeur fixe définie par une autre méthode (on reviendra dessus si vous êtes intéressé);

Mon modèle nominal (moyen, théorique) est basé sur 32, 128 et 256 jours de bourse (Trading Days).

Ce modèle donne d'excellents résultats pour la grande majorité des valeurs et indices que je suis (environ 150).

Le principe est simple :

- quand un sommet ou un plus bas a lieu à l'intérieur du canal 32, on le note 0
- quand un sommet ou un plus bas coupe le canal 32, on le note 1
- quand un sommet ou un plus bas ou un canal 32 coupe le canal 128, on le note 2
- quand un sommet ou un plus bas ou un canal 32 ou 128 coupe le canal 256, on le note 3

Tu as un exemple sur le graphique du DAX mis à jour au mercredi 25 novembre 2009.

On observe :

- une VTL d'Ordre 3 Descendante (ROUGE) qui relie les 2 Sommets successifs notés T3
- une VTL d'Ordre 2 Ascendante (BLEUE) qui relie le Plus Bas noté B3 et le Plus Bas noté B2

Quand le DAX franchira à la hausse la VTL d'Ordre 3 Descendante (ROUGE) le mouvement haussier sera confirmé, on ne pourra plus le cataloguer comme un rebond (même important).

En attendant ce moment cette VTL constitue une solide RESISTANCE.

Ce croisement des cours avec la VTL d'Ordre 3 Descendante (ROUGE) sera la confirmation définitive du Plus Bas B3 (rouge) comme point d'inflexion majeur, ce que n'était pas le précédent Plus Bas B3.

On observe aussi que la VTL d'Ordre 2 Ascendante (BLEUE) constitue A LA FOIS la Ligne de Tendance haussière du DAX ET un solide SUPPORT.

Support d'autant plus solide qu'on aurait pu tirer une VTL d'Ordre 1 reliant les Plus Bas notés B2 et B1.

Mais tous ces Plus Bas sont alignés et les 2 VTL se confondent, ce qui renforcent leur rôle de Résistance et leur Rôle Directionnel.

On notera qu'un plus Bas d'Ordre 3 est AUSSI un Plus Bas d'Ordre 2, d'Ordre 1 et d'Ordre 0.

Situation actuelle du DAX :

On voit que les Cours du DAX sont confinés entre 2 puissantes résistances les 2 VTL examinées.

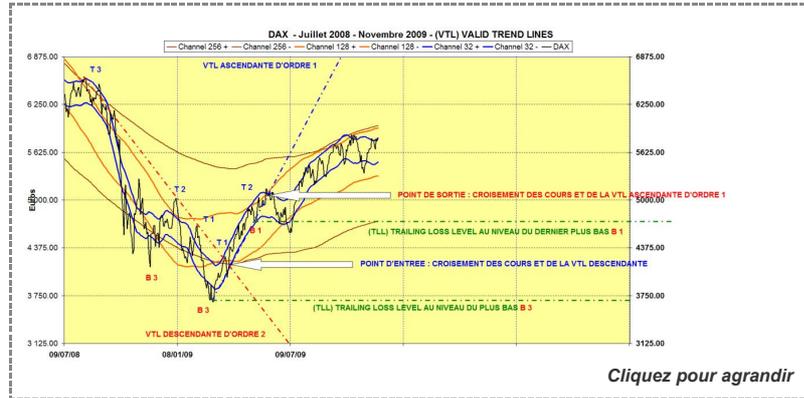
Pronostic :

à très court terme une congestion des cours jusqu'au croisement des 2 VTL

à ce moment

- soit un franchissement direct de la VTL descendante d'Ordre 3 ouvrant la voie à un puissant mouvement haussier

- soit une baisse court terme allant éventuellement jusqu'à la limite inférieure du Canal 128 suivie par un franchissement direct de la VTL descendante d'Ordre 3 ouvrant la voie au même puissant mouvement haussier.



Sur le graphique ci dessus on voit comment on aurait pu utiliser les VTL dans le passé.

Dès mi-janvier 2009 on sait que l'on a fait un Sommet T2, on peut donc construire une VTL d'Ordre 2 reliant les Sommets T3 et T2.

Le 6 Mars 2009 on fait un Plus Bas B3. Mais on a déjà fait un Plus Bas B3 le 21 Novembre 2009.

Va-t'on aller encore plus bas ? Impossible à dire à ce moment là.

Courant mars 2009, on remonte, mais est-ce un rebond correctif ou une impulsion haussière ?

Ce n'est que quand les cours franchiront la VTL Descendante d'Ordre 2 (construite dès la mi-janvier 2009) que le plus Bas noté B3 du 6 Mars 2009 sera validé comme un plus bas définitif.

Par la même, le "Rebond " au sein d'une tendance baissière sera requalifié en franche tendance haussière.

Enfin on pourra l'esprit plus libre passer un ordre d'achat juste au-dessus du croisement de la VTL Descendante d'Ordre 2 et des cours.

De plus on placera un Trailing Stop au niveau du plus Bas B3 du 6 Mars 2009.

En effet si (il y a peu de chances) les cours du DAX venait casser ce stop, cela voudrait dire que la tendance baissière du DAX ne serait pas terminée et que le plus bas B3 du 6 Mars 2009 ne serait pas le point le plus bas de la Baisse.

édité le : 27-11-2009 00:05:42

J'aime : 0 ! #1064287



Jeff_X

Posté le : le 26-11-2009 17:49:52 [-]

#1064376



Merci à vous ParisBoy et SmallCap de bien vouloir participer à ce projet. Malheureusement je n'ai pas lu vos documents, mais je viens d'activer mon email 😊!! Je ne viens pas fréquemment ici ... et je m'en veux !

(23 msg)

PROFIL NON RENSEIGNÉ

J'ai repensé à l'idée (simple) de ggo du calcul du coeff. de régr. sur 3 points et il semble que ce soit la solution la plus facile ... et qui devrait fonctionner. Avec 2 points on obtiendrait toujours un coeff. de 1,00. Donc par cette approche on oublie 2 points. Mais avec 3 points et un résultat entre 0,95 et 1,00 nous devrions obtenir qqch d'intéressant. MAIS ...

Qu'arriverait-il si l'on a, par exemple, 2 sommets (2 + hauts significatifs) et que le troisième point + haut ne serait que peu significatif ? Nous obtiendrions une droite farfelue. En fait, cette droite ne serait pas tracée car elle ne rencontrerait pas la condition du coeff. Mais nous manquerions une vraie tendance formée de 2 points !!

Il reste aussi que le choix de la période d'observation demeure un casse-tête ! Sur un court terme par exemple, nous pourrions manquer une tendance qui sur un moyen terme serait très nette et significative.

Par ailleurs, l'approche de Hurst (que je ne connais pas) mériterait aussi d'être étudiée. Il s'agit bien du tracé de droites de tendance (avec 2 points) ET de l'ajout de canaux (calcul de mm ???). Ceci sort quelque peu du projet de départ qui consiste à ne tracer qu'une droite de tendance automatique, sans faire intervenir autre chose (mm, indicateurs, etc.). Mais je me trompe pè car je n'ai rien lu de son approche.

J'en reviens donc au programme que SmallCap avait préparé et qui franchement donnait souvent de bons résultats (avec 2 points pour construire la droite). Il faudrait pè seulement revoir l'ajout des paramètres suivants:

- P4 = nb de périodes servant à prolonger supports et résistances à gauche de l'extrema le plus à gauche;
- P5 = nb de périodes servant à prolonger supports et résistances à droite de la zone neutralisée

SmallCap, P4 et P5 sont-ils vraiment essentiels ?

En outre, le choix de 2 périodes P1 et P2 (courte, longue) constitue une limitation dans l'utilisation de ce programme. Il faudrait d'abord rechercher les 2 plus hauts (ou plus bas) les plus significatifs, à partir desquels la période serait le "terrain d'observation". Et c'est p   l   que l'approche de Hurst deviendrait utile.

Il faudrait que je lise vos documents pour que tout cela soit plus clair.

Merci pour votre support.



J'aime : 0 !



#1064376



Post   le : le 26-11-2009 18:19:26 [-] [img alt="Print icon"/> [img alt="Share icon"/> [img alt="Reply icon"/>

#1064404

Parisboy



Jeff X,

bonjour ! je n'ai pas tr  s bien saisi ce que tu voulais obtenir avec ton calcul automatique de droite de tendance.

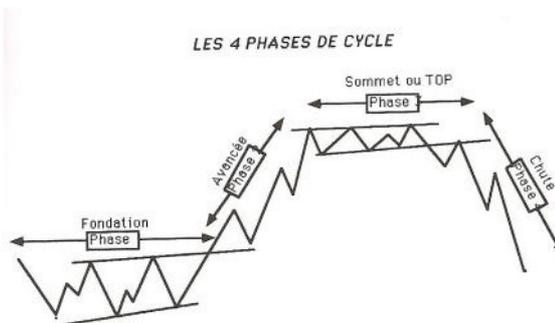
En ce qui concerne ton int  r  t pour Stan Weinstein, personnellement je trouve que la m  thode Weinstein n'est qu'une variante simpliste des th  ories cycliques.

J'ai trouv   son bouquin illisible et ai beaucoup plus appris en lisant des r  sum  s sur sa m  thode faits par ceux qui avaient d  brouill   la question.

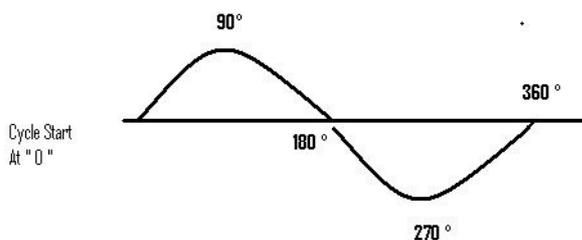
Pour moi cela en dit d  j   long sur la clart   de sa pens  e !   

Son concept de 4 phases est utile.

(599 msg)



Life of a Cycle



Il a tout simplement r  duit la vie d'une valeur ou d'un indice    1 seul cycle (de long terme) alors que le mod  le de HURST en identifie une dizaine et peut   tre utilis   sur des espaces de temps tr  s variables.

De plus le param  trage de ses moyennes mobiles comme indicateurs est purement empirique, ce qui personnellement ne me satisfait pas.

Son travail ressemble plus    une suite de recettes empiriques qu'   un syst  me coh  rent.

De mon point de vue le soubassement th  orique (et math  matique) des m  thodes de J.M. HURST est beaucoup plus riche et pertinent.



Jeff_X

Posté le : le 26-11-2009 18:54:39 [-]

#1064416



Effectivement ce qu'on doit retenir du livre de Weinstein se résume surtout à son approche par "phases".

Néanmoins, pour quelqu'un qui débute en bourse (at) la lecture de ce livre est déjà un grand pas en avant ! Je l'ai lu en ... 2000 ! Et il m'a fait sortir de Nortel Networks AVANT la débâcle !!

(23 msg)

PROFIL NON RENSEIGNÉ

Pour le reste, l'obtention de droites de tendance (1 qui rejoint les + hauts et l'autre, les + bas) servent à mettre en évidence les break out, break down, fuseaux descendants, ascendants, triangles, etc. Elles ne doivent pas considérées le cours le plus récent car c'est avec ce cours qu'on aura un signal de Break Out, Break Down, etc.

Rien de plus simple !!



J'aime : 0 ! #1064416



Parisboy

Posté le : le 26-11-2009 19:08:17 [-]

#1064424



HURST explique très bien dans son livre Profit Magic au Chapitre 3, page 67, comment on peut expliquer les différentes figures chartistes par des combinaisons de Cycles.

" Chart patterns form and repeat because of the repetitive nature of cyclic price action"

Quand à MILLARD dans son livre Profitable Charting Techniques il y consacre un long chapitre très détaillé (Chapitre 4, Theoretical Chart Patterns)

(599 msg)



édité le : 26-11-2009 19:11:12



J'aime : 0 ! #1064424



smallcaps90

Posté le : le 26-11-2009 20:46:58 [-]

#1064451



Bonsoir Parisboy,

Merci pour tes références et tes études à partir de la méthode de Hurst.

Il est vrai qu'il y a là beaucoup de choses à ingurgiter/assimiler avant d'être capable de les utiliser. Mais qui sont des éléments ô combien intéressants aussi.

(1193 msg)



Je pense aussi que nous nous éloignons quelque peu de notre projet initial qui ne consistait qu'à tracer des droites de tendance en sélectionnant des plus hauts ou des plus bas successifs sans plus ainsi que Jeff_X le rappelle.

Je pense que c'est ce que nous ferons dans un premier temps pour voir puisqu'un avant-projet existe déjà qui utilise les mêmes concepts ou presque.

Ensuite il sera possible de prendre en compte l'approche par les canaux de Hurst qui m'intéresse depuis un bon moment et qui est restée à l'état de proto non publié ici.

Une question : comment prolonges-tu les courbes des bandes vers la fin de l'historique, les moyennes mobiles centrées laissant les dernières périodes sans courbes?

J'avais pour ma part tenté d'utiliser différentes approches m'inspirant de celles de Clive Lee, de régressions non linéaires aussi et de courbes AFIRMA. J'ai toujours cela sous le coude...

Cordialement.



J'aime : 0 ! #1064451



Parisboy

Posté le : le 26-11-2009 21:04:14 [-]

#1064453



Smallcaps,

Je pense que la bonne question c'est pourquoi tracer des droites de tendances ?

Dans quel but ? Qu'est-ce que cela apporte ?

(599 msg)



Je suppose que vous ne voulez pas faire cela par habitude ou pour faire joli ?

Dans Computerized Approach for Building Automatic Trendlines

Il y a 2 mots nécessaires mais dangereux :

Computerized : on peut faire de l'ordinateur et des programmes

Automatic : on peut sombrer dans l'illusion que tout est automatisable.

J'ai lu les messages de Jeff X et je n'ai toujours pas compris POURQUOI et DANS QUEL BUT il voulait automatiser la construction de Trendlines.

Qu'est ce que cela apporte concrètement pour le trading ? pour gagner des sous ?

Pour moi le point fondamental des VTL c'est que tous les points hauts et bas pour tracer une Trendline ne sont pas de même nature et de même degré.

C'est un point capital qui permet de les hiérarchiser.

Ensuite ces Lignes de Tendances permettent

- le suivi de la tendance,

- la confirmation des points d'inflexion,
- le tri entre correction du mouvement haussier ou baissier et inversion du mouvement (changement de nature),
- la détermination rationnelle d'un point d'entrée
- la détermination rationnelle d'un pont de sortie
- la détermination rationnelle de stop loss successifs

Cela me parait pas mal pour des "Trendlines"

Cordialement

édité le : 26-11-2009 21:06:58

J'aime : 0 ! #1064453 

Parisboy

Posté le : le 26-11-2009 21:06:18 [-]   

#1064454



ne question : comment prolonges-tu les courbes es ban es ers la fin e l'histori ue les mo ennes mobiles centr es laissant les emi res p rio es sans courbes
a ais pour ma part tent utiliser iff rentes approches m inspirant e celles e lie ee e r gressions non lin aires aussi e e courbes A IR A. ai tous ours cela sous le cou e...

(599 msg)



C'est la fameuse remarque à 100 euros : Vos canaux repeignent le passé, BEURK ! 🤔

En fait c'est vrai cela repeint le passé, mais cela n'est pas (trop) grave si on utilise le système COMPLET

TRIAD, VTL, FLD, PHASING ANALYSIS ETC

et si on se fixe des objectifs de Zone (entre tel et tel Prix et entre telle et telle période.

Pour un investisseur qui applique les règle d'optimisation de HURST et de MILLARD

Durée optimum moyenne : 2 Mois

Profit minimum = + 20 %

Ratio minimum P/L = 2

Cela fonctionne très bien.

Pour "prolonger" les Canaux utilisés j'applique des moyennes mobiles centrées décroissantes.

Exemple :

Pour le Canal 32 on place (centre) le dernier résultat calculé 16 jours en arrière à J -16.

A J-15 je place la MM centrée 31 jours

A J-14 la MM centrée 30 jours etc

C'est la méthode qui produit ces jolis canaux 😊

Elle se rapproche d'une méthode utilisée (à l'époque en 1980) pour le guidage des missiles balistiques.

J'ai un PDF sur le sujet.

édité le : 26-11-2009 21:28:19

J'aime : 0 ! #1064454 

smallcaps90

Posté le : le 26-11-2009 21:18:37 [-]   

#1064457



Bonsoir Jeff_X,

Ou bonjour plutôt car avec le décalage horaire...

(1193 msg)



Alors pour répondre à tes questions plus haut, nous avons 3 pistes possibles :

- utilisation d'une la droite de régression qui permettrait d'augmenter le nombre de points de "contacts" ;
- amélioration des programmes existants en tentant de s'inspirer de l'approche de Siligardos pour obtenir des droites de tendances propres et actives ;
- utilisation de la méthode des "Hurst bands".

Reste à choisir...

Plus précisément et un peu en vrac pardonne-moi :

Je suis d'accord avec toi pour ce qui concerne les risques que présente l'approche "régression linéaire". On risque bien de manquer une droite de tendance valable alors qu'on s'escrime à la faire passer par trois points que la régression éliminera et qu'il en existe une évidente qui passe par deux points seulement. Et avec deux points pas besoin de régression. Alors laisse-t-on tomber ou regarde-t-on ce que cela donne?

Je ne vois pas de solution simple non plus au pb de la fixation du nombre de périodes retenues pour définir "l'espace" dans lequel on cherche à reconnaître la présence ou non d'une droite de tendance. On sait tout de même que l'on cherche en fin d'historique...

Je pense qu'il faut regarder les choses simplement et mettre l'approche de Hurst, dans un premier temps, en attente.

Tu me poses une question concernant l'intérêt des paramètres P4 et P5 que j'utilisais dans mon programme. Ceux-ci n'avaient qu'une fonction purement cosmétique au niveau du tracé des lignes et peuvent être supprimés sans problème. Quant aux paramètres P1, P2 et P3 il est tout à fait possible d'envisager les choses différemment aussi.

dans l'approche que propose Siligardos aucun paramètre n'est utilisé hormis le seuil du zigzag qui permet de rechercher les plus haut (vs les plus bas) sur lesquels la droite de tendance s'appuiera.

Ce que je pourrait faire aussi serait de reprendre mes programmes et en face de cas bizarres voir d'où cela provient et tenter d'y remédier.

Mais tu as raison de dire que ces programmes permettaient aussi la reconnaissance de figures autres que de simples droites de tendance si on prenait en compte les plus hauts et les plus bas trouvés. Ce qui n'est pas négligeable...

Cordialement.

J'aime : 0 !

#1064457



smallcaps90

Posté le : le 26-11-2009 21:27:05

#1064462



Re Parisboy,

Pourquoi tracer des droites de tendance?
Pour toutes les raisons que tu avances évidemment avec en priorité je pense pour la détection de breakouts.

On peut aussi élargir cette question en la posant à nos amis utilisateurs de GrapheAT Pro :

**Cela les intéresse-t-il de disposer d'un outil qui leur permettrait de tracer des droites de tendance automatiquement ou presque?
Et quels intérêts y trouvent-ils?**

Merci par avance pour vos réponses et/ou questions.
N'hésitez pas à intervenir dans le débat.

=====
Pour ce qui concerne ma question concernant l'extension des courbes des canaux de Hurst, je n'avais pas vu ta réponse excuse-moi. Astucieux d'utiliser des moyennes centrées de longueur de calcul décroissantes.
Toutes les méthodes appliquées repeignent le passé effectivement...il suffit de le savoir.

Ton pdf m'intéresse...

Cordialement.

édité le : 26-11-2009 21:35:31

J'aime : 0 !

#1064462



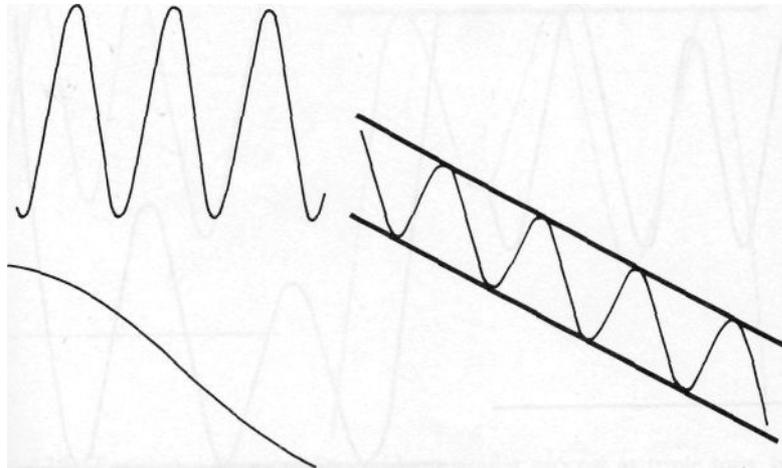
Parisboy

Posté le : le 26-11-2009 21:41:36

#1064466



En ce qui concerne les droites de tendances après avoir lu et relu HURST et MILLARD, j'en reste à L'Analyse Cyclique.



A downchannel (right) is formed by a combination of a very long term cycle (lower left) and a short term cycle (upper left).

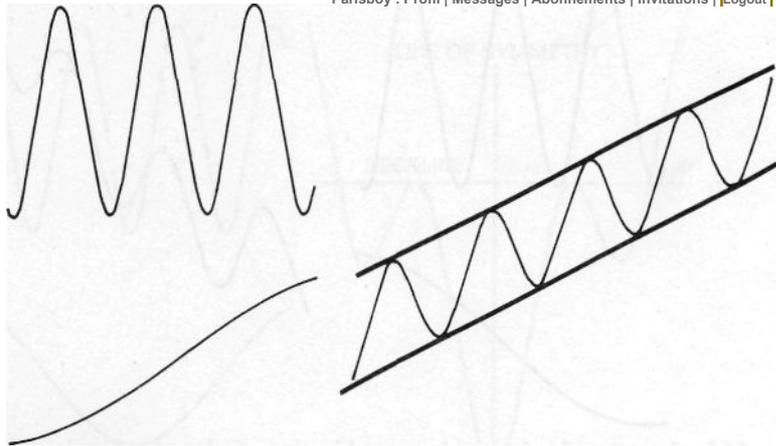
The dominant longer term cycle is on its way down to its minimum.

Because of its long wavelength, the downward leg is almost a straight Line

MILLARD PROFITABLE CHARTING TECHNIQUES

Chapitre 4 : Theoretical Charts Pattern

Evidemment dans le Cas d'une tendance haussière il faut inverser les choses.



An upchannel (right) is formed by a combination of a very long term cycle (lower left) and a short term cycle (upper left).

The dominant longer term cycle is on its way up to its maximum.

Because of its long wavelength, the upward leg is almost a straight line

Upchannels

Upchannels are a particular form of uptrend.

In this case the secondary cycles are of such regularity that lines joining the troughs and lines joining the peaks can be drawn parallel to each other in the case of straight channels or concentric in the case of curved channels.

The same comments about straight and curved uptrends apply to upchannels.

Downchannels

Downchannels are a specific form of downtrend again with the secondary cycles of such regular amplitude that the lines joining the peaks and troughs are parallel in the case of straight channels and concentric in the case of curved channels.

The same comments about straight and curved downtrends apply to downchannels.

édité le : 26-11-2009 21:55:23

😊 J'aime : 0 !  #1064466

