

bambi

Posté le : le 05-12-2009 17:12:38 [-]    

#1067862



Bonjour à tous

J'ai une question **très très basique** sur la programmation dans graphAT

Quel est le code pour écrire une moyenne mobile exponentielle ?

Si par exemple, je veux $A = MME(24)$ tout simplement, que dois-je écrire pour avoir cette courbe ?

J'ai essayé tout un tas de trucs en m'inspirant de ce que j'ai pu lire sur cette file mais comme je suis archi nulle en programmation, rien ne marche 😞

Merci 😊

(2464 msg)



[EDIT]

J'ai fini par trouver oufff !! 🎉

"There is no greater indication of what the market is doing than the market itself."

édité le : 05-12-2009 18:42:30



J'aime : 0 !  #1067862



Zeugma31

Posté le : le 09-12-2009 18:49:06 [-]    

#1069588



Bonjour, tout le monde

Existe-il dans la file des programmes une statistique sur le croisement des cours avec le Sar parabolique comme cela existe pour le CCI ou le RSI entre autres ?

Merci de votre réponse.

(22 msg)



J'aime : 0 !  #1069588



smallcaps90

Posté le : le 10-12-2009 12:03:39 [-]    

#1069846



Bonjour Zeugma31,

A ma connaissance non, mais on peut te concocter cela.

Je suis absent de chez moi pour qq jours encore. Si tu peux patienter jusqu'à samedi pas de pb, à moins qu'un autre "fidèle" de la file le programme avant.

A toutes fins utiles, quel SAR utilises-tu? Il y a qq années un travail avait été fait sur le SAR...

(1193 msg)



Cordialement.



J'aime : 0 !  #1069846



Zeugma31

Posté le : le 11-12-2009 11:40:59 [-]

#1070351



Bonjour Smallcaps90
C'est avec plaisir que j'accepte ton offre, d'autant qu'en ce qui concerne la programmation je ne sais faire que les copier/coller.

(22 msg)



Je ne sais même pas si ma demande (croisement de la courbe des cours avec le SAR ? Hum !) est très pertinente, aussi si tu veux, dans cette optique faire une stat plus opérationnelle ça n'en sera que mieux (peut-être en ajoutant une moy. mob. du Sar).

Encore une fois, merci beaucoup

J'aime : 0 !



byp008

Posté le : le 13-12-2009 09:57:34 [-]

#1070841



Bonjour !
Smallcaps90, merci de ta réponse du 03/12/2009.

Le programme de la page 23 servirait à tracer le segment d'une droite de tendance ancienne, ou bien le tronçon d'un canal.

(236 msg)

PROFIL NON RENSEIGNÉ

Reprenant ton exemple BNP PARIBAS au 11/12/2009 :

Le 1er graph. serait l'horizon d'un acheteur LT-MT. La tendance grise inutile serait abandonnée. La droite de régression rouge et son canal conforte son investissement. La droite de régression jaune lui indique une tendance positive plus faible. La zone des limites basses des canaux se trouve vers 53.00. L'acheteur s'attend à un rebond ou au franchissement de la tendance.

L'acheteur peut gérer sa position en observant le 2ème graph. La droite de régression est ancrée sur la barre deux heures qui a donné le plus haut du 11/11/2009. La décision à prendre se trouve bien à 53.00 +/-

Mes suggestions proviennent de l'utilisation faite de la droite de régression ancrée :

- Recherche de la direction des cours dès qu'un sommet ou un creux près d'une limite s'est formé et que la droite de régression a suffisamment de cours-périodes pour devenir fiable.
- Observation de la sortie d'un canal bien établi. Parfois, les cours font une sortie brusque puis, réintègrent le canal et le confirment, là où tracer une droite de tendance serait difficile.
- Observation du changement de la pente d'une tendance.

Le tracé des limites du canal par les plus hauts et les plus bas des barres-périodes observées est plus précis.

Et comme la limite basse du canal est généralement plus écartée de l'axe du canal que la limite haute, on pourrait envisager de calculer une régression des plus hauts et une régression des plus bas ; puis pour l'axe du canal, calculer la régression des points médians.

Mais ce serait pousser la précision un peu loin, sauf pour une recherche particulière, comme l'établissement d'un programme de trading automatique.

Le script de la droite de régression ancrée serait utile :

L'ancrage à une date donnée ne devrait pas être difficile.

La mise à jour automatique un peu plus. Piètre programmeur, je règle manuellement selon les besoins.

Cordialement,
Byp008

image : [http://images.pro-at.com/forums-bourse/1209/12378_...//image\[/image\]./forums-bourse/1209/12378_130957.jpg](http://images.pro-at.com/forums-bourse/1209/12378_...//image[/image]./forums-bourse/1209/12378_130957.jpg) introuvable ou format inconnu

J'aime : 0 !



byp008

Posté le : le 13-12-2009 10:00:13 [-]

#1070842



1er graph:

(236 msg)

PROFIL NON RENSEIGNÉ



J'aime : 0 !



Posté le : le 13-12-2009 10:01:57 [-]

#1070843

byp008



(236 msg)

PROFIL NON RENSEIGNÉ

Parisboy : Profil | Messages | Abonnements | Invitations | Logout

2ème graph.



Bon, il faut insérer les images une à une.



J'aime : 0 !



#1070843



smallcaps90

Posté le : le 13-12-2009 18:59:53 [-]

#1070924



Bonsoir Zeugma31,

Voilà comme promis la statistique qui détecte croisement entre le Parabolique (SAR) et cours pendant les n dernières périodes de l'historique. Tu dois fixer la valeur de n que tu souhaites dans le programme de la stat ci-dessous. La statistique donne le dernier croisement historique qui s'est produit dans ces n cours.

(1193 msg)



J'ai repris le programme du Parabolique disponible dans mon post du 02/11/2004, page 46 : <http://www.pro-at.com/forums-bourse/topic.php?TOPI...> avec les paramètres 0.02 pour le facteur d'accélération initial et 0.2 pour sa limite maxi. Je n'ai pas modifié les identificateurs utilisés à l'époque. Ils sont repris tels quels par la statistique.

Programme de la statistique :

```
//=====
//Croisement_Cours_SAR
//=====

//smallcaps90
//le 12/12/2009
//=====

n=1 //à fixer selon besoins
Pour n Cours //boucle de scan

//Récupération des valeurs du SAR
//
SL=SAR_ATD2.SAR_ATD2_Long
SS=SAR_ATD2.SAR_ATD2_Short

//Croisement SAR_Long/Cours
//
Si SL>=Bas ET SL<=Haut
Alors
Colonne1="Fin SAR Long le " & datehisto$
Select=1
FinSi

//Croisement SAR_Short/Cours
//
Si SS>=Bas ET SS<=Haut
Alors
Colonne1="Fin SAR Short le " & datehisto$
Select=1
FinSi

FinPour

//Sélection des valeurs qui satisfont
//les conditions de croisement
//
Si Select=1 Alors Selection

//fin du code
```

Fenêtre Propriétés de la statistique :

Parisboy : Profil | Messages | Abonnements | Invitations | Logout

Propriétés Programme

Nom règle: Croisement_Cours_SAR Liste des statistiques Non modifiable

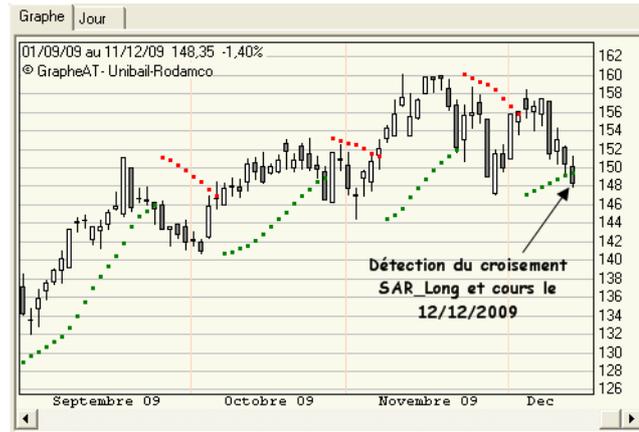
Description: Statistique de recherche des valeurs dont le SAR croise les cours dans les n dernières périodes (n à fixer dans le prog). La statistique détecte le dernier croisement historique sur ces n périodes.

Colonnes: 1 Trier suivant: Colonne 1 Croissant

Colonne Achat/Vente Maximum de lignes: 0

Libellé	Type	Décimales	Visible	
Colonne 1	Colonne 1	Texte	2	<input checked="" type="checkbox"/>

Appliquée au CAC40 vendredi dernier avec n=1, la statistique trouvait Unibail-Rodamco dont le SAR_Long croisait les cours :



Dans ton dernier post tu souhaiterais avoir une "stat plus opérationnelle". Tu fais sans doute allusion à un possible système de trading basé sur le SAR. Il est évident que d'utiliser ses croisements avec les cours pour entrer et sortir ne donnera pas quelque chose d'intéressant. Il faudrait l'associer à d'autres indicateurs et ils ne manquent pas... Ou alors l'utiliser comme filtre dans un système de trading. Les exemples ne manquent pas sur le Net. Ceci est une autre histoire...

Cordialement.

édité le : 13-12-2009 19:02:12



J'aime : 0 !



#1070924



Zeugma31

Posté le : le 14-12-2009 11:39:45 [-]

#1071113



Bonjour Smallcaps90.

Merci bien, merci simplement, parce que ton dévouement à ce site et à ses utilisateurs, est tel que tout compliment paraîtrait médiocre.

(22 msg)

Je vais utiliser SAR ATD2 et cette statistique telle quelle et je te recontacterai sur "SYTSEME DE TRADING" que je fréquente assidûment, si tu veux bien. Cordialement, à bientôt.



J'aime : 0 !



#1071113



alexandre

Posté le : le 20-12-2009 15:17:30 [-]

#1073756



// Impulse System selon Alexander Elder
 // p 157 de Come Into My Trading Room
 // Principe:
 // si EMA(13) et MACD histo sont en phase alors signal
 // la fin du signal indique de sortir de ses positions
 // Très utile pour entrer au bon moment en utilisant le Triple Screen
 // en n'allant pas contre l'Impulse.

(221 msg)

//EMA P1
 EMA = EXPOSUIV(EMA,cloture,P1)

SI ((EMA>EMA(1)) ET (RMACDHISTO.RMACDHISTO>RMACDHISTO.RMACDHISTO(1))) ALORS
 IMPULSE = Bas * 0.99
 SINON

SI ((EMA<EMA(1)) ET (RMACDHISTO.RMACDHISTO<RMACDHISTO.RMACDHISTO(1))) ALORS



IMPULSE = Haut * 1.01
 SINON
 IMPULSE = (Haut+Bas)/2
 FINSI

J'ai un souci avec une parenthèse sur cette programmation le logiciel ayant évolué. 😊

FINSI

```
// Impulse System selon Alexander Elder
// p 157 de Come Into My Trading Room
// Principe:
// si EMA(13) et MACD histo sont en phase alors signal
// la fin du signal indique de sortir de ses positions
// Trègrave;s utile pour entrer au bon moment en utilisant le Triple Screen
// en n'allant pas contre l'Impulse.

//EMA P1
EMA = EXPOSUIV(EMA,closure,P1)

SI ((EMA>EMA(1)) ET (RMACDHISTO.RMACDHISTO>RMACDHISTO.RMACDHISTO(1))) ALORS
IMPULSE = Bas * 0.99
SINON
SI ((EMA<EMA(1)) ET (RMACDHISTO.RMACDHISTO<RMACDHISTO.RMACDHISTO(1))) ALORS
IMPULSE = Haut * 1.01
SINON
IMPULSE = (Haut+Bas)/2
FINSI
FINSI
```

[Cliquez pour agrandir](#)

Merci pour votre aide

😊 J'aime : 0 !  #1073756



Posté le : le 20-12-2009 15:29:13 [-]   

#1073757

alexandre



Problème résolu. J'ignore par quel moyen. Le caractère non reconnu était tout simplement un caractère du type > ou >.



(221 msg)



😊 J'aime : 0 !  #1073757



Posté le : le 21-12-2009 15:22:36 [-]   

#1073872

smallcaps90



Bonjour Alexandre,

Tu peux trouver le programme de l'Impulse de Elder qui utilise les possibilités de la nouvelle version 3.09 pour colorier les chandeliers sur : <http://www.pro-at.com/forums-bourse/bourse-141-659...>(voir posts du 21 et du 22/04/09).

(1193 msg)



Cordialement.

édité le : 21-12-2009 15:24:09

😊 J'aime : 0 !  #1073872



Posté le : le 21-12-2009 20:18:50 [-]   

#1074018

alexandre



Encore mille fois merci Smallcaps.

Je profite de cette occasion pour te souhaiter de bonnes fêtes de fin d'année ainsi qu'à tous les contributeurs du forum. 😊



(221 msg)



😊 J'aime : 0 !  #1074018



Posté le : le 22-12-2009 20:12:14 [-]   

#1074321

smallcaps90



(1193 msg)



Merci Alexandre, tous mes voeux également.

Parisboy : Profil | Messages | Abonnements | Invitations | Logout



J'aime : 0 !



#1074321



Posté le : le 29-12-2009 15:18:42 [-] [img alt="Print icon"] [img alt="Share icon"] [img alt="Reply icon"]

#1075397

smallcaps90



Bonjour ybm,

(1193 msg)



Cà y est, je tiens une version qui semble fonctionner après de multiples et drastiques simplifications du code. En effet le code initial pour MT4 était particulièrement touffus, redondant et loin d'être "propre". Pas un modèle du genre! J'ai donc procédé à un sérieux nettoyage après avoir passé du temps à essayer de comprendre et extraire l'algorithme utilisé par son auteur. Cet algorithme, d'après ce que j'en ai compris, est basé sur le range moyen des cours calculé sur P4 périodes. Ce range moyen est coefficienté différemment pour chercher les signaux mineurs et majeurs.

J'ai conservé la plupart des identificateurs du programme initial qui ne sont pourtant pas toujours très explicites et lourds à manipuler, supprimé aussi des paramètres dont les valeurs restent figées et qui entrent pourtant dans des conditions de "Si Alors Sinon", dès lors bien inutiles...

Ainsi je ne conserve que :

- PriceActionFilter** qui devient **P1**;
- Length** qui devient **P2**;
- MajorCycleStrength** qui devient **P3**;
- rnglength** qui devient **P4**.

J'ai supprimé aussi l'usage de la Moyenne ZeroLag qui n'est en fait pas utilisée dans le programme pour Metatrader. Même chose pour le RSI.

Je n'ai donc conservé pour définir la variable "CyclePrice", qu'une simple moyenne arithmétique de paramètre P1.

Il n'est pas difficile de la remplacer par une ZeroLag...

de toutes façons comme le setup courant utilise P1=1, on affaire aux cours eux-mêmes mais, si on le souhaite, on peut changer cette valeur. Attention au lag introduit dans ce cas.

Il ne s'agit que d'un premier proto qui doit être mis à l'épreuve s'il t'intéresse.

Voici le **programme** pour GrapheAT Pro :

```
//=====
//Cycle_Identifier
//=====

//\0.1 PROTOTYPE
//29/12/2009
//transcodé par smallcaps90
//à partir de Cycle_Identifier.mq4
//=====

//=====Ingrédients
//
// Range sur P4 barres
srange=0
Pour P4 Cours
srange=srange+haut-bas
FinPour
Range=srange/P4*P2

//Prix pour l'étude
//ici on peut choisir une zerolag aussi
//sur les clotures ou sur un RSI des clotures
//
CyclePrice(0)=Moyenne(Clature,P1)

//=====Cycles mineurs
//
Si RangHisto>P8 Alors

Si Switch>-1 Alors
Si CyclePrice<Price1BuyA Alors
Si BuySwitchA=1 Alors
MinorCycleBuy(RangHisto-Price1BuyB)=0
LineBuff(RangHisto-Price1BuyB)=0
FinSi
Price1BuyA=CyclePrice
Price1BuyB=RangHisto
BuySwitchA=1
Sinon //ici CyclePrice>=Price1BuyA
SwitchA=RangHisto-Price1BuyB
MinorCycleBuy(SwitchA)=-1
LineBuff(SwitchA)=-1
BuySwitchA=1
CyclePrice1=CyclePrice(SwitchA)
Cond1= CyclePrice-CyclePrice1>=Range //SweepA
```

```

Si Cond1=1 ET SwitchA>=1 Alors
Switch=-1
Price1SellA=CyclePrice
Price1SellB=RangHisto
SellSwitchA=0
BuySwitchA=0
FinSi
FinSi
FinSi

Si Switch<1 Alors
Si CyclePrice>Price1SellA Alors
Si SellSwitchA=1 Alors
MinorCycleSell(RangHisto-Price1SellB)=0
LineBuff(RangHisto-Price1SellB)=0
FinSi
Price1SellA=CyclePrice
Price1SellB=RangHisto
SellSwitchA=1
Sinon
SwitchA=RangHisto-Price1SellB
MinorCycleSell(SwitchA)=1
LineBuff(SwitchA)=1
SellSwitchA=1
CyclePrice2=CyclePrice(SwitchA)
Cond1=(CyclePrice2-CyclePrice)>=Range //SweepA
Si Cond1=1 ET SwitchA>=1 Alors
Switch=1
Price1BuyA=CyclePrice
Price1BuyB=RangHisto
SellSwitchA=0
BuySwitchA=0
FinSi
FinSi
FinSi

FinSi

LineBuff=0
MinorCycleBuy=0
MinorCycleSell=0

//=====Cycles majeurs
//
Si RangHisto>P8 Alors

Si Switch2>-1 Alors
Si CyclePrice<Price2BuyA Alors
Si BuySwitchB=1 Alors
MajorCycleBuy(RangHisto-Price2BuyB)=0
//LineBuff(RangHisto-Price2BuyB)=0
FinSi
Price2BuyA=CyclePrice
Price2BuyB=RangHisto
BuySwitchB=1
Sinon
SwitchB=RangHisto-Price2BuyB
MajorCycleBuy(SwitchB)=-1
//LineBuff(SwitchB)=-1
BuySwitchB=1
CyclePrice3=CyclePrice(SwitchB)
Cond6= CyclePrice-CyclePrice3>=Range*P3 //SweepB
Si Cond6 ET SwitchB>=1 Alors
Switch2=-1
Price2SellA=CyclePrice
Price2SellB=RangHisto
SellSwitchB=0
BuySwitchB=0
FinSi
FinSi
FinSi

Si Switch2<1 Alors
Si CyclePrice>Price2SellA Alors
Si SellSwitchB=1 Alors
MajorCycleSell(RangHisto-Price2SellB)=0
//LineBuff(RangHisto-Price2SellB)=0
FinSi
Price2SellA=CyclePrice
Price2SellB=RangHisto
SellSwitchB=1
Sinon
SwitchB=RangHisto-Price2SellB
MajorCycleSell(SwitchB)=1
//LineBuff(SwitchB)=1
SellSwitchB=1
CyclePrice4=CyclePrice(SwitchB)
Cond6=(CyclePrice4-CyclePrice)>=Range*P3 //SweepB
Si Cond6=1 ET SwitchB>=1 Alors
Switch2=1
Price2BuyA=CyclePrice
Price2BuyB=RangHisto
SellSwitchB=0
BuySwitchB=0

```

```

ini
ini
ini

ini

ineuff 0
aorcleu 0
aorcelle 0

//fin uco e
    
```

Fenêtre Propriétés :

Propriétés		Programme		
Nom règle	Cycle_Identifier	<input checked="" type="checkbox"/> Liste des indicateurs	<input type="checkbox"/> Non modifiable	
Indicateur	CYCLE_IDENTIFIEI			
Paramètres	4	P1: 1	P2: 3	
		P3: 4	P4: 20	
Courbes	5	<input type="checkbox"/> Affichage sur les cours		
		<input checked="" type="checkbox"/> Minimum -1,5	<input checked="" type="checkbox"/> Maximum 1,5	
Courbe	Nom	Affichage	Couleur	Epaisseur
Courbe 1	LINEBUFF	Simple	—	1
Courbe 2	MINORCYCLESELL	Histogramme	—	1
Courbe 3	MINORCYCLEBUY	Histogramme	—	1
Courbe 4	MAJORCYCLESELL	Histogramme	—	3
Courbe 5	MAJORCYCLEBUY	Histogramme	—	3

une courbe ne peut être supprimée et l'affichage sans nuire à la lisibilité des autres signaux.

Les exemples obtenus avec le setup défini dans la fenêtre Propriétés ci-dessus qui semblent corrects compte-tenu de l'indicateur repente nous en avons parlé...

Voilà :





Un dernier exemple pour Michelin également avec le réglage :

- P1=1
- P2=2
- P3=2
- P4=5



On multiplie le nombre de signaux évidemment.
Ils correspondent en fine à la plupart des sommets et creux des cours de clôture.

Remarques :

Je reviens sur le fait que l'indic repeint le passé.

J'ai découvert sur Internet une vidéo sur un site indonésien qui présente assez bien ce qui se passe sur les dernières barres. Tu peux la trouver sur :

<http://funny4x4u.blogspot.com/2009/08/dari-sinilah...>

Cordialement.

édité le : 29-12-2009 16:21:35

😊 J'aime : 0 !  #1075397

