

ggo

Posté le : le 02-06-2011 09:10:14 [-] 

#1253385



Salut Smallcaps,

L'orthodoxie Hurstienne : je pense qu'il est important de la connaître mais évidemment, comme déjà dit, rien ne nous empêche d'explorer quelques pistes et on verra bien ce que nous gagnons ou perdons à faire cela. Autrefois, avec MT4, j'avais moi-même bricolé un programme (il s'agissait d'un filtre type Hodrick-Prescott) qui simulait assez bien une MMC en lui adjoignant un ATR pour la construction des bandes.

(280 msg)



Les règles statistiques : je n'ai pas encore vu ce point car avant cela, je voudrais terminer la programmation des trucs qui m'intéressent (les deux publiés hier font partie du lot) et me rassurer que de côté là, tout va bien mais je suis confiant maintenant.

Bonne Journée,

#1253385



ggo

Posté le : le 02-06-2011 09:24:07 [-] 

#1253392



Une question pratique :

- comment faire pour afficher deux indicateurs simultanément sur le graphe principal, par exemple, Heiken-Ashi + Hurst Bands ?

Je vois que cela est possible mais je n'ai pas trouvé le truc.

à+

(280 msg)



#1253392



smallcaps90

Posté le : le 02-06-2011 10:50:24 [-] 

#1253422



Re ggo,

J'avais touché aussi à Hodrick-Prescott ici page 132 : <http://www.pro-at.com/forums-bourse/bourse-132-659...>
Le problème avec ce genre de filtre est l'effet de bord en fin d'historique qui fait que le filtre repeint dur.

(1193 msg)



Pour répondre à ta question au sujet du tracé simultané de deux indicateurs sur les cours, je vois deux solutions possibles :
- placer les deux indicateurs dans le même programme ;
- écrire un programme par indicateur et créer un troisième programme de la façon suivante (un peu comme s'il s'agissait de l'appel de deux fonctions).

Voici ce que dit l'aide intégrée à GAP :

=====

"Une règle peut référencer une courbe d'une autre règle indicateur soit directement par son nom s'il s'agit d'une règle indicateur dérivée de la seconde soit en utilisant la syntaxe suivante : <Nom Indicateur>.<NomCourbe>. Une règle ne peut pas modifier les courbes d'une autre règle.

-Exemple d'utilisation des variables globales des deux règles indicateurs RBOLL (3 courbes RUBOLL, RMBOLL et RLBOLL) et RSAR (une courbe RSAR) dans une troisième règle (4 courbes BollingerHaut, BollingerMoy, BollingerBas et Parabolic) :

```
BollingerHaut = RBOLL.RUBOLL
BollingerMoy = RBOLL.RMBOLL
BollingerBas = RBOLL.RLBOLL
Parabolic = RSAR.RSAR
```

Que l'on peut écrire aussi de la façon suivante :

```
Courbe1 = RBOLL.RUBOLL
Courbe2 = RBOLL.RMBOLL
Courbe3 = RBOLL.RLBOLL
Courbe4 = RSAR.RSAR
"
```

=====

Donc, tu crées :
Prog "Indic1" avec courbe C1
Prog "Indic2" avec courbe C2

Puis le Prog "Indic3" dans lequel tu crées deux courbes sous la forme :
Indic1.C1
Indic2.C2

Attention tu ne peux pas passer de paramètres au programme "Indic3", il faut que les paramètres des courbes C1 et C2 soient définis dans leurs programmes respectifs.

Tu peux t'affranchir de la notation "Indic.Courbe" si tu crées un indicateur dérivé d'un autre.

Exemple :
"Indic1" crée la courbe C1
"Indic2" dérivé du précédent, peut récupérer la courbe C1 directement.

Concernant Hurst et ses enveloppes, il préconise je crois que 97% des points (clotûres, hauts, bas?) y soient contenus. Comment dans ses conditions déterminer le delta constant à appliquer à chaque moyenne pour qu'il en soit ainsi?

Cordialement

édité le : 02-06-2011 10:51:37



ggo

Posté le : le 02-06-2011 11:38:03 [-]   

#1253441



Bigre !
ça n'a pas l'air simple, 2 indicis sur la même fenêtre principale

Concernant Hurst et ses enveloppes, il préconise je crois que 97% des points (clotûres, hauts, bas?) y soient contenus. Comment dans ses conditions déterminer le delta constant à appliquer à chaque moyenne pour qu'il en soit ainsi?

(280 msg)



Si j'ai bien compris Hurst, faut pas trop se compliquer la vie. Lui faisait cela sans ordinateur et apparemment ce qui satisfaisait l'oeil suffisait. Donc, à mon sens, pour le delta, ici, on peut faire la même chose : quand visuellement, on est satisfait alors on retient la valeur.

Le plus important, sans doute, c'est de ne pas se tromper avec la période retenue pour une moyenne donnée. En repérant des creux successifs, il calculait une valeur moyenne pour la période mais là encore, visuellement, une moyenne devait partager harmonieusement la série de valeurs pour être retenue.

Ensuite, l'utilité pratique de ces bandes pour du trading simple, consiste à repérer ces moments où les bandes font des sommets ou des creux simultanément (ce qu'il appelle le "nesting") alors même si les deltas retenus ne sont pas rigoureux ils permettront ce repérage malgré tout.

N'empêche ... reste au moins deux points épineux :

1 - si on veut suivre plusieurs valeurs du SRD, par exemple, c'est probablement fastidieux de devoir ajuster ces deltas pour chaque valeur observée et c'est pourquoi je suggère de faire du screening très sélectif pour n'être amené à le faire que pour les actions présentant un retournement imminent.

2 - le "repainting"

Je n'aime pas trop ce mot car il suggère des trucs négatifs.



Sur cette image, même avec du "repainting" sur les bandes et sur HCP, on voit bien que nous arrivons sur un "nest" façon Hurst et qu'un retournement va se produire.

Question : quand précisément se placer ?
Et c'est là, je crois, que mes deux autres indics peuvent aider (mais je ne les ai pas encore traduits sous GAP). On peut sans aucun doute en trouver d'autres d'indics pour aider à prendre la décision.
(On peut par exemple attendre du rouge avec Heiken-Ashi ...)

Pour revenir au point 1, si on veut éviter de tâtonner laborieusement pour trouver ces deltas, je pense qu'on peut garder l'algo de calcul des moyennes (triangulaires 😊) et s'aider ensuite de l'ATR pour placer les bandes. Je voulais faire un essai ce matin mais l'ATR n'est pas proposé sur GAP et il faut se le programmer aussi
J'ai fait un essai mais je suis resté coincé dans une boucle sans fin !
à suivre ...

édité le : 02-06-2011 11:47:11



LONGWAY

Posté le : le 02-06-2011 12:31:12 [-] [img alt="share icons"]

#1253474



Bonjour,

L'ATR a déjà été programmé par smallcaps:

<http://www.pro-at.com/forums-bourse/bourse-130-659...>

(51 msg)



Je précise que le site des indicateurs et statistiques ainsi que le tableau est toujours d'actualité sauf pour les discussions de ces quelques jours l'indicateur final n'étant pas encore validé par les auteurs

Cordialement

Si tu peux rencontrer Triomphe apres Defaite
Et recevoir ces deux menteurs d'un meme front



ggo

Posté le : le 02-06-2011 12:56:04 [-] [img alt="share icons"]

#1253485



Salut Longway

et merci pour ces précisions.

Smallcaps, pour continuer une discussion commencée hier soir.

Sur cette pic :

(280 msg)





Supposons que notre fenêtre principale soit M15 (centrale), on arrive donc sur un haut de cycles simultané sur les 3 périodes. Un retournement est proche et il a commencé sur M5 (pic de droite), faut-il se placer ? pas sûr ... sur M5, une remontée des cours s'annonce dans le canal bleu et enfin, un indic (vitic) sur M15 a encore une très forte valeur. Pour se placer en descente sur M15 mieux vaut encore attendre.

Enfin, si on veut une plus grande prudence, on ne se placera pas du tout à la baisse sur M15 car cette baisse ne sera qu'une conso sur H1 où les 3 cycles sont toujours très haussiers.

Peut-être donc faut-il attendre que la baisse sur M15 (= conso sur H1) soit terminée pour se placer à la hausse car il reste un peu de marge avant qu'on atteigne un "top3cycles" sur H1.

....

Enfin, un mot pour que tout soit clair : j'ai découvert HURST et MILLARD tout récemment et donc je suis toujours et pour longtemps encore en apprentissage. Tout ce que je raconte, c'est ce que je crois avoir compris mais ne prenez pas cela pour argent comptant ! Je ne suis pas et ne veux surtout pas être un "Hurst Guru" !!! Je suis seulement un fan !

à+

édité le : 02-06-2011 13:00:01

#1253485

ggo

Posté le : le 02-06-2011 13:24:49 [-]

#1253496



ATR ...

Qu'est-ce qui ne va pas là ?
merci à vous,

(280 msg)



```
//=====
//Average True Range
//=====

//le 19/10/2008
//smallcaps90
//=====

//1 et 2- Calculer le premier True Range et les suivants.
//

Si RangHisto=1
Alors
  TR=Haut-Bas
Sinon
  TR=MAXVAL(MAXVAL((Haut-Bas),Absolu(Clature(1)-Haut)),Absolu(Clature(1)-Bas))
FinSi

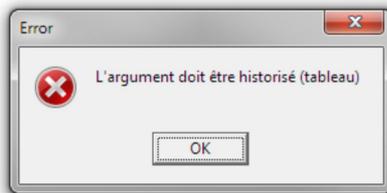
//3- Calculer le premier ATR.

Si RangHisto = P1 Alors ATR = Moyenne(TR,P1)

//4- Calculer les ATR suivants.

Si RangHisto > P1 Alors ATR = ((P1-1)*ATR(1)+TR)/P1

//fin du code
```



à+

#1253496

smallcaps90

Posté le : le 02-06-2011 13:40:08 [-]

#1253503

Re ggo,

Mais oui, c'est simple plusieurs indic sur les cours



(1193 msg)



Je ne comprends plus pourquoi tu parles de "repainting". Avec des moyennes triangulaires le pb ne se pose plus. Pourtant tes derniers graphes montrent des enveloppes qui ont été prolongées avec des traits mixtes. Qu'en est-il? Le cas se posait avec des moyennes centrées par contre.

Pour compléter/affiner ton approche, peut-être devrais-tu entrer en contact avec Parisboy qui est sans conteste un utilisateur averti des enveloppes de Hurst? Il était intervenu dans notre file lorsqu'on cherchait à tracer automatiquement des lignes de tendance comme j'avais déjà du le signaler...Je suis sûr qu'il se fera un plaisir de partager ses connaissances.

Cordialement.

#1253503

smallcaps90

Posté le : le 02-06-2011 13:51:14 [-]

#1253507

Re ggo,

Dans mon programme de l'ATR que tu as posté, tu dois écrire :

```
//=====
//1 et 2- Calculer le premier True Range et les suivants.
//
Si RangHisto=1
Alors
  TR(0)=Haut-Bas
Sinon
  TR=MAXVAL(MAXVAL((Haut-Bas),Absolu(Clature(1)-Haut)),Absolu(Clature(1)-Bas))
//ou encore ce qui revient au même :
//TR = MAXVAL(HAUT,CLOTURE(1)) - MINVAL(BAS,CLOTURE(1))
FinSi

//3- Calculer le premier ATR.
//
Si RangHisto=P1 Alors ATR=Moyenne(TR,P1)
```

(1193 msg)



```
//4- Calculer les ATR suivants.
//
Si RangHisto>P1 Alors ATR=((P1-1)*ATR(1)+TR)/P1
//=====
```

Le tout premier TR rencontré dans le programme doit être historisé pour que la moyenne puisse être calculée plus bas. D'ailleurs si tu regardes où se trouve le curseur lorsque le message d'erreur s'affiche après que tu demandes "Contrôler" dans la fenêtre du programme de l'indicateur, tu constateras qu'il se trouve juste après la variable TR dans la calcul de la moyenne...

Pour historiser une variable X il suffit donc de l'écrire : X(0).
Le fait de créer une courbe X dans la fenêtre Propriétés de l'indicateur, historisera de fait la variable en question évidemment et il sera inutile de l'écrire X(0) dans le programme.
Tu devrais lire l'aide accessible dans la fenêtre "Règle Indicateur"...

=====

PS :
dans mon programme posté page 130, la variable TR n'est pas notée TR(0) car elle était historisée de fait en apparaissant comme courbe dans les Propriétés de l'indicateur.

Cordialement.

édité le : 02-06-2011 14:23:12

 #1253507

Posté le : le 02-06-2011 14:27:52 [-]    

#1253515

ggo



Je ne comprends plus pourquoi tu parles de "repainting".
Avec des moyennes triangulaires le pb ne se pose plus. Pourtant tes derniers graphes montrent des enveloppes qui ont été prolongées avec des traits mixtes. Qu'en est-il?
Le cas se posait avec des moyennes centrées par contre.

(280 msg)



Je ne sais pas trop s'il s'agit de moyennes triangulaires ... et si, si, ça repeint !

Imagine, la première barre est de rang $i = 1000$ alors :

avec par exemple, $PER = 5$

....

init :

```
sum = (PER+1)* close(1000) //on charge le rang (i)
sumw = PER+1
```

puis

```
PER = 5 ; k = PER = 5
```

```
for j = 1 to 5 do
sum = sum + k * close(1000+j) // on charge sur les rangs situés avant (i)
sumw = sumw + k
```

```
if (j <= 1000) then
sum = sum + k * close(1000-j) // on charge sur les rangs situés après (i)
sumw = sumw + k
endif
```

```
k = k-1
```

```
next J
```

un poids identique est attribué aux rangs (i+j) et (i-j) dans le calcul de la moyenne.

Maintenant imagine que le rang (i) soit arrivé à $i = 3$

alors on ne passera pas forcément sur :

```
if (j <= 3) then
sum = sum + k * close(3-j) et
```

un poids différent sera attribué aux rangs (i+j) et (i-j) dans le calcul de la moyenne.

mais, tandis que de nouvelles barres vont apparaître, de nouveaux calculs apparaîtront sur les barres au calcul fait avec des poids non symétriques.

ça repeint donc et tel que c'est là, sur une période complète et non pas une demi-période !

Avantage : le lissage est parfait.

Cette moyenne centrée, finalement, je l'appellerai moi, *une moyenne centrée pondérée* 😊

à+

EDIT : en y réfléchissant, on pourrait modifier la pondération faite de telle sorte que le "repeint" n'affecte qu'une demi-période, cela ne devrait pas trop être difficile.
Par contre, on ne pourra plus utiliser que des périodes impaires et le lissage des courbes sera sans doute un peu moins beau.

A voir ...

édité le : 02-06-2011 15:09:56

#1253515



ggo

Posté le : le 02-06-2011 14:42:11 [-]   

#1253520



Pour compléter/affiner ton approche, peut-être devrais-tu entrer en contact avec Parisboy qui est sans conteste un utilisateur averti des enveloppes de Hurst?

Un de ces quatre prochains sans doute ...

Dans ce que je lis sur

<http://www.tts.lu/forum/analyse-technique/trader-c...>

il apparaît qu'ils sont très branchés FLD et VTL avec des périodes qui se mesurent en mois, années.

FLD et VTL : je ne suis pas trop au fait pour l'instant et par ailleurs, j'ai un horizon qui se mesure plutôt en heures actuellement. Du coup, j'attends un peu avant d'aller les ennuyer avec mes questions. Par ailleurs, je n'ai pas encore réussi à lire tous leurs écrits et ils sont bavards ... (plus que moi, en fait !)

Merci pour ATR

à+

(280 msg)



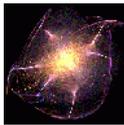
#1253520



ggo

Posté le : le 02-06-2011 15:22:36 [-]   

#1253531



pour continuer mon exemple de lecture des Bandes/HCP :

(280 msg)





1 :

es c cles rouges et aunes sont tous ours tourn s ers le or seul le bleu escen : nous sommes probablement sur une conso et le c cle bleu a encore le temps e se retourner ers le haut et les cours ont remonter. i les c cles rouge et bleu enaient escen re en m me temps cela serait plus s rieu .

onclusion pour l instant : le top3c cle n est pas encore atteint sur 1.



Post le : le 02-06-2011 16:1 :51 [-] [] [] [] [] []

12535 3

smallcaps90

Re ggo



(1193 msg)



act otre honneur lle peint bel et bien cela ma ait chapp . est une mo enne triangulaire malgr tout (e cherche la petite b te) triangulaire u fait e la nature es pon rations en triangle affect es au barres par le param tre ui cro t lin airement et s m tri uement e part et autre e la barre i. lle est centr e u fait e la s m trie es pon rations et es barres au uelles on les affecte mais effecti ement elle repeint en fin histori ue sur un c cle complet le triangle es pon rations tant forc ment biais les corrections apparaissant lors e la enue progressi e es barres futures...

or ialement.

ggo

Posté le : le 02-06-2011 18:30:18 [-] [img alt="document icon"] [img alt="print icon"] [img alt="share icon"]

#1253585



Voici un autre programme bien intéressant me semble-t-il : **DeTrend**

Ce que nous avons déjà :

1 - les moyennes mobiles : ce sont des filtres qui ignorent (ou presque) les cycles de périodes inférieures ; elles ne sont sensibles qu'aux cycles de périodes égales ou supérieures

2 - HCP :

cet indicateur ne regarde que les cycles de période spécifiée ; il ignore les cycles de périodes plus grandes ou les cycles de périodes plus petites

3 - Detrend : c'est un filtre qui regarde la somme de tous les cycles de périodes inférieures ou égales à celle spécifiée Il complète donc les deux précédents.

Je reprends maintenant ce que j'avais écrit dans un autre forum :

Chaque valeur des cours est remplacée par son écart à la moyenne (centrage) et ensuite ces écarts sont mesurés en nombres d'écart-types (réduction). Cette technique de centrage-réduction est notamment utilisée dans les analyses multifactorielles car elle a l'immense avantage de supprimer l'unité dans laquelle on s'exprime.

En outre, si les données ont le bonheur de suivre une répartition gaussienne on peut estimer les probabilités de se trouver au-delà de 2 écart-types (environ 5%, donc 2.5 % de chaque côté), au-delà de 2.5 écart-types (environ 1 % de mémoire). Les cours ne sont pas distribués normalement puisqu'il s'agit de séries temporelles. Les écarts à la moyenne, non plus, puisqu'en fait nous avons une moyenne glissante pour l'ensemble de la série. Enfin, comme je fais du lissage de données, il faut abandonner complètement cette idée de données distribuées normalement.

Cela étant dit, quand les courbes atteignent 2 ou 3 écart-types, on peut sans grand risque tableer sur un prochain retournement. Si on a aussi un intérêt pour les bandes de HURST, cela veut aussi dire que l'on tangente ces bandes.

Enfin, on utilise ici des moyennes mobiles simples :

- avantage : **ça ne repeint pas**
- inconvénient : un poil en retard sur le signal mais à peine

Remarque : le fait que le cycle jaune de detrend soit la somme de tous les cycles (= et inf) ne se voit pas ici car les trois courbes sont normalisées séparément l'une de l'autre.

le code :

```

////////////////////////////////////
// DeTRend
////////////////////////////////////
// version du 02 Juin 2011
// G. GOUSSET aka ggo aka FGATS
////////////////////////////////////

```

```

LongPer = P1
MedPer = P2
ShortPer = P3

```

```

Liss1 = P4
Liss2 = P5
Liss3 = P5

```

```

C_LONG(0) = (CLOTURE - MOYENNE(CLOTURE, LongPer)) / ECARTYPE(CLOTURE, LongPer)
C_MED(0) = (CLOTURE - MOYENNE(CLOTURE, MedPer)) / ECARTYPE(CLOTURE, MedPer)
C_SHORT(0) = (CLOTURE - MOYENNE(CLOTURE, ShortPer)) / ECARTYPE(CLOTURE, ShortPer)

```

```

ALong(0) = MOYENNE(C_LONG, Liss1)
AMed(0) = MOYENNE(C_MED, Liss1)
AShort(0) = Moyenne(C_SHORT, Liss1)

```

```

BLong(0) = MOYENNE(ALong, Liss2)
BMed(0) = MOYENNE(AMed, Liss2)
BShort(0) = MOYENNE(AShort, Liss2)

```

```

CLong(0) = MOYENNE(BLong, Liss3)
CMed(0) = MOYENNE(BMed, Liss3)
CShort(0) = MOYENNE(BShort, Liss3)

```

```

SUP25 = 2.5
INF25 = -2.5
ZERO = 0

```

// fin code

les propriétés :

Nom règle: DeTrend Liste des indicateurs Non modifiable

Indicateur: DETREND

| | | | | | | | |
|------------|----|----|----|----|----|----|----|
| Paramètres | 6 | P1 | P2 | P3 | P4 | P5 | P6 |
| | 41 | 21 | 9 | 4 | 2 | 2 | |

Courbes: 6 Affichage sur les cours

Minimum Maximum

| | Nom | Affichage | Couleur | Epaisseur |
|----------|--------|-----------|---------|-----------|
| Courbe 1 | CLONG | Simple | | 3 |
| Courbe 2 | CMED | Simple | | 3 |
| Courbe 3 | CSHORT | Simple | | 2 |
| Courbe 4 | SUP25 | Tirets | | 2 |
| Courbe 5 | INF25 | Tirets | | 2 |
| Courbe 6 | ZERO | Simple | | 2 |

ce que cela donne :



Un mot d'interprétation :

- au dessus de Mars 08, detrend atteint environ -2.5, on peut s'attendre à un retournement ; en fait les cours continuent à chuter un peu et sont en divergence avec detrend.
pendant ce temps, les 3 cycles HPC s'organisent pour remonter en phase : à partir de ce moment on peut se placer en toute quiétude, les cours vont remonter

autre moment :

- au dessus de mai 08, detrend a déjà atteint 2 écart-types et redescend déjà suggérant un sommet pour les cours. Les bandes le suggèrent aussi à ce moment.
HPC : cycle jaune et cycle rouge en opposition de phase, nous sommes en congestion, attendre un peu et bientôt les 3 cycles seront en phase pour descendre. Detrend confirmera aussi cette descente.

Il est toujours intéressant de noter une divergence entre les cours et les courbes DeTrend annonçant un prochain retournement. Le moment précis du retournement sera lui annoncé par le passage HPC (et aussi par VitAc à venir).

Y'a sans doute plus à dire !

à suivre,

EDIT : ceux qui n'aiment pas trop les lissages de courbes peuvent le supprimer et avoir ainsi des signaux, certes plus hachés, mais aussi plus réactifs.

édité le : 02-06-2011 18:44:18

 #1253585

smallcaps90

Posté le : le 02-06-2011 20:33:40 [-]    

#1253620



Re ggo,

Merci encore pour ce travail très intéressant que tu nous proposes. Que de choses à assimiler!
Serait-il envisageable de créer un système de trading qui utiliserait, entre autres, enveloppes de Hurst et Detrend?
Manifestement GAP semble ne plus avoir de secrets pour toi...

(1193 msg)

Cordialement.



édité le : 02-06-2011 20:40:18

 #1253620