

hbo78



(3 msg)

PROFIL NON  
RENSEIGNÉ

Bonsoir smallcaps90,

Je suis admiratif de ton savoir et te remercie de le partager avec nous.

Je viens de programmer STOCH\_RSI en suivant ce que ton message ci-dessous, mais message d'erreur "Indicateur STOCH\_RSI inconnue".

Qu'ai-je oublié ?

Merci our ton aide.

Hbo78

**Citation de : smallcaps90** (au 10-06-2011 23:34:07)

Bonsoir Demon,

J'arrive de qq jours de vacances et je viens de regarder ta stat double.

Les conditions Jour sont semble-t-il OK.

Pour les conditions Semaine, si STOCH\_RSI est en hausse, ne faudrait-il pas plutôt écrire cela ainsi (et qui est peut-être insuffisant) :

STOCH\_RSI.MSTOCH\_RSI&gt;STOCH\_RSI.MSTOCH\_RSI(1) ?

Dans cette hypothèse et avec les réglages P1=13, P2=8, P3=P4=5 de l'indicateur (qui doivent être les tiens), j'ai créé deux colonnes "texte" :

Colonne1="X" placée dans la règle Jour et Colonne2="A1" ou "A2" ou "V1" ou "V2" placée dans la règle Semaine pour repérer les conditions qui sont satisfaites.

**Programmes :**/Stat Jour  
//Sur croisements

Si MVOL&gt;=100000 Alors // Elimine les actions peu liquides (MVOL&lt;100000)

Si CROISE(STOCH\_RSI.MSTOCH\_RSI,STOCH\_RSI.MMSTOCH\_RSI)>0  
Alors  
Colonne1="X"  
SelectionAchat  
FinSiSi CROISE(STOCH\_RSI.MMSTOCH\_RSI,STOCH\_RSI.MSTOCH\_RSI)>0  
Alors  
Colonne1="X"  
SelectionVente  
FinSi

```

FinSi
//=====

//Stat Semaine

Si MVOL>=100000 Alors // Elimine les actions peu liquides (MVOL<100000)

//StochRsi en hausse mais pas en SA (achat)
Si STOCH_RSI.MSTOCH_RSI>STOCH_RSI.MSTOCH_RSI(1)
et STOCH_RSI.MSTOCH_RSI<75
Alors
Colonne2="A1"
SelectionAchat
FinSi

//StochRsi en baisse mais pas en SV (vente)
Si STOCH_RSI.MSTOCH_RSI<STOCH_RSI.MSTOCH_RSI(1)
et STOCH_RSI.MSTOCH_RSI>25
Alors
Colonne2="V1"
SelectionVente
FinSi

//StochRsi en SV (achat)
Si STOCH_RSI.MSTOCH_RSI<25
Alors
Colonne2="A2"
SelectionAchat
FinSi

//StochRsi en SA (vente)
Si STOCH_RSI.MSTOCH_RSI>75
Alors
Colonne2="V2"
SelectionVente
FinSi

FinSi
//=====

```

**Fenêtre Propriétés :**

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

En me plaçant au vendredi 07/01/2011 et en lançant la stat Jour seule sur le groupe CAC40, j'obtiens :

```

=====
Groupe : cac40 Date : 07/01/2011

ACHAT X Pernod Ricard
VENTE X Alstom
VENTE X Bouygues
VENTE X Credit agricole SA
VENTE X Schneider Electric
VENTE X Societe Generale
=====

```

Avec la règle Semaine seule :

```

//=====
Groupe : cac40 Date : 07/01/2011

ACHAT A1 Alcatel Lucent
ACHAT A1 Bnp Paribas
ACHAT A1 Bouygues
ACHAT A1 Carrefour
ACHAT A1 Credit agricole SA
ACHAT A1 Eads
ACHAT A1 EDF
ACHAT A1 France Telecom
ACHAT A1 GDF Suez
ACHAT A2 L'Oreal
ACHAT A2 Michelin
ACHAT A1 Natixis
ACHAT A1 Peugeot
ACHAT A2 PPR
ACHAT A1 Renault
ACHAT A1 Sanofi-Aventis
ACHAT A1 Societe Generale

```

ACHAT A1 Veolia Environnement  
VENTE V2 Accor  
VENTE V1 Air Liquide  
VENTE V2 Alstom  
VENTE V1 Arcelor Mittal  
VENTE V2 Axa  
VENTE V2 Cap Gemini  
VENTE V1 Danone  
VENTE V1 Essilor International  
VENTE V1 Lafarge  
VENTE V1 LVMH  
VENTE V1 Pernod Ricard  
VENTE V1 Publicis Group  
VENTE V1 Saint Gobain  
VENTE V1 Schneider Electric  
VENTE V2 STMicroelectronics  
VENTE V1 Suez Environnement  
VENTE V2 Technip  
VENTE V2 Total  
VENTE V1 Unibail-Rodamco  
VENTE V2 Vallourec  
VENTE V1 Vinci  
VENTE V1 Vivendi  
//=====

Là toutes les valeurs sont sélectionnées d'une façon ou d'une autre et il en est aussi de même quelle que soit la date choisie, ce qui prouve que les conditions sont trop "larges"...il faudra les affiner.

Avec les deux séries de conditions Jour et Semaine présentes, j'obtiens :

//=====

Groupe : cac40 Date : 07/01/2011  
  
VENTE X V2 Alstom  
VENTE X V1 Schneider Electric  
//=====

Qui sont bien les deux valeurs qui satisfont **à la fois** les conditions que tu imposes...  
A toutes fins utiles, voici ce que j'obtiens pour ce soir :

//=====

Groupe : cac40 Date : 10/06/2011  
  
ACHAT X A2 Alcatel Lucent  
ACHAT X A2 Sanofi-Aventis  
ACHAT X A1 Unibail-Rodamco  
ACHAT X A2 Vallourec  
ACHAT X A2 Vinci  
//=====

Cordialement.

 #1272129

Posté le : le 28-07-2011 20:39:09 [-]   

#1272135

bambi



**Citation de : hbo78 (au 28-07-2011 20:24:05)**

Bonsoir smallcaps90,  
Je suis admiratif de ton savoir et te remercie de le partager avec nous.  
Je viens de programmer STOCH\_RSI en suivant ce que ton message ci-dessous, mais message d'erreur "**Indicateur STOCH\_RSI inconnue**".

(2464 msg)



Bonsoir hb078

Ce que tu viens de programmer n'est pas l'indicateur STOCH\_RSI mais une statistique basée dessus.  
Donc, comme tu n'as pas l'indicateur, il ne peut pas exécuter ta demande de statistique et te le signale par "Indicateur STOCH\_RSI inconnue"

Il faut programmer l'indicateur lui même que tu trouveras sur ce lien >> [STOCH\\_RSI](#)

En espérant que cela t'aide 😊

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

 #1272135

Posté le : le 29-07-2011 11:24:53 [-]   

#1272276

smallcaps90



Bonjour hbo78,

Bienvenue au "club"...  
5/5 avec ce que que t'a conseillé Bambi que je remercie.  
J'ajoute que tu dois utiliser les identificateurs indiqués dans la fenêtre Propriétés de la règle indicateur "STOCH\_RSI" si tu veux que la règle statistique "Stat\_STOCHRSI" puisse récupérer les valeurs des variables MSTOCH\_RSI et MMSTOCH\_RSI.

(1193 msg)





Ceci s'y réalise par les notations :  
STOCH\_RSI.MSTOCH\_RSI et STOCH\_RSI.MMSTOCH\_RSI  
Cordialement.

#1272276

hbo78

Posté le : le 29-07-2011 14:48:00 [-]

#1272406



Bonjour,

Et merci à Bambi et smallcaps90.  
En suivant vos indications, cela fonctionne parfaitement 😊.

(3 msg)

Bonne journée.

PROFIL NON  
RENSEIGNÉ

Cordialement

**Citation de : smallcaps90** (au 29-07-2011 11:24:53)

Bonjour hbo78,

Bienvenue au "club"...  
5/5 avec ce que que t'a conseillé Bambi que je remercie.  
J'ajoute que tu dois utiliser les identificateurs indiqués dans la fenêtre Propriétés de la règle indicateur "STOCH\_RSI" si tu veux que la règle statistique "Stat\_STOCHRSI" puisse récupérer les valeurs des variables MSTOCH\_RSI et MMSTOCH\_RSI.  
Ceci s'y réalise par les notations :  
STOCH\_RSI.MSTOCH\_RSI et STOCH\_RSI.MMSTOCH\_RSI  
Cordialement.

#1272406

hbo78

Posté le : le 29-08-2011 14:12:08 [-]

#1281116



Bonjour smallcaps90,

Existe-t-il pour GrapheAt Pro les indicateurs utilisés pour la méthode de trading Robert C. MINER (DTOSC; retacements internes, externes et PPA de Fibonacci; retacements et projections de temps, calcul des points pivots; etc....).

(3 msg)

Merci.

PROFIL NON  
RENSEIGNÉ

Cordialement.

**Citation de : smallcaps90** (au 29-07-2011 11:24:53)

Bonjour hbo78,

Bienvenue au "club"...  
5/5 avec ce que que t'a conseillé Bambi que je remercie.  
J'ajoute que tu dois utiliser les identificateurs indiqués dans la fenêtre Propriétés de la règle indicateur "STOCH\_RSI" si tu veux que la règle statistique "Stat\_STOCHRSI" puisse récupérer les valeurs des variables MSTOCH\_RSI et MMSTOCH\_RSI.  
Ceci s'y réalise par les notations :  
STOCH\_RSI.MSTOCH\_RSI et STOCH\_RSI.MMSTOCH\_RSI  
Cordialement.

#1281116

smallcaps90

Posté le : le 29-08-2011 22:03:53 [-]

#1281284



Bonsoir hbo78,

En fait nous n'avons à notre disposition pour le moment que le DTOSC de R. Miner qui n'est autre que le STOCHRSI (dispo page 163 de la présente file).  
On pourrait essayer de programmer ses autres outils pour GrapheAT Pro à condition d'avoir leurs cahiers des charges...

(1193 msg)

Cordialement.



bazouboy

Posté le : le 09-10-2011 12:51:16 [-]    

#1293642



Bonjour,

l'indicateur lowess est en temps réel et repeint donc le passé  
Hk Lisse a programmé l'indicateur end-point pour corriger cet inconvénient

(1 msg)

quelqu'un aurait-il déjà converti ce programme pour grapheat

merci beaucoup



```
////////// programme de la courbe noire et blanche //////////  
////////// il faut introduire a en variable (51 par défaut) //////////  
myke1 = CALL "kernel endpoint "[a]  
myke2 = CALL "kernel endpoint veille"[a]  
c=myke1-myke2  
return myke1 coloured by c
```

```
////////// programme kernel endpoint //////////  
////////// il faut mettre p3 en variable (51 par défaut) //////////  
n=p3 mod 2  
p=(p3-n)/2  
p3=(2*p)+1  
once x=0  
w=abs((p-x)/p)  
w=w*w*w  
w=(1-w)  
w=w*w*w  
x=x+1  
if barindex=p3 then  
a=0  
b=0  
e=0  
for i=1 to p+1  
z=barindex-i+1  
a=a+w[z]  
b=b+w[z]*(i)  
e=e+(i)*(i)*w[z]  
next  
endif  
if barindex>p3 then  
c=0  
d=0  
for i=1 to p+1  
z=barindex-i+1  
c=c+close[p+1-i]*w[z]  
d=d+close[p+1-i]*w[z]*i  
next  
endif  
alpha=(a*d-b*c)/(a*e-b*b)  
beta=(c*e-b*d)/(a*e-b*b)  
lowess=alpha*(p+1)+beta  
if barindex<p3*2 then  
lowess=undefined  
endif  
return lowess
```

```
////////// programme kernel endpoint veille //////////  
////////// il faut introduire p3 en variable (51 par défaut) //////////  
n=p3 mod 2  
p=(p3-n)/2  
p3=(2*p)+1  
once x=0  
w=abs((p-x)/p)  
w=w*w*w  
w=(1-w)  
w=w*w*w  
x=x+1  
if barindex=p3 then  
a=0  
b=0  
e=0  
for i=1 to p+2  
z=barindex-i+1  
a=a+w[z]  
b=b+w[z]*(i)  
e=e+(i)*(i)*w[z]  
next  
endif  
if barindex>p3 then  
c=0  
d=0  
for i=1 to p+2  
z=barindex-i+1  
c=c+close[p+2-i]*w[z]  
d=d+close[p+2-i]*w[z]*i  
next  
endif  
alpha=(a*d-b*c)/(a*e-b*b)  
beta=(c*e-b*d)/(a*e-b*b)  
lowess=alpha*(p+1)+beta  
if barindex<p3*2 then
```

```
lowess=undefined
endif
return lowess
```

#1293642

Papy29

Posté le : le 03-02-2012 18:11:28 [-] [img alt="share icon"] [img alt="print icon"] [img alt="refresh icon"] [img alt="help icon"]

#1325747



Bonjour a tous

je suis toujours nul en programmation mais je cherche

En recherchant des similitudes de courbe entre les diverses moyennes  
J'ai remarqué que la courbe d'une moyenne Pondéré(Clôture,4) est très proche de celle du filtre de Kalman  
De même la courbe du filtre Alma à P1=10 est proche de la même moyenne Pondéré à 4

(21 msg)



Toujours dans les similitudes et pour essayer de masquer le défaut de repeindre le passé du filtre HODRICK\_PRESCOTT  
a P2 =10 et P2 =30 élaboré par smallcaps90 page 132 de la file

J'ai essayé de trouver une courbe approchant une de ces 2 courbes pour cela j'ai fait plusieurs essais et mélanges de  
différentes moyennes mais les résultats sont loin du but

Sur la file quelqu'un aurait-il la solution ?  
Merci d'avance



#1325747

Démon

Posté le : le 15-04-2012 11:51:24 [-] [img alt="share icon"] [img alt="print icon"] [img alt="refresh icon"] [img alt="help icon"]

#1347655



Bonjour,Je me sers de l'indicateur de Force relative du programme et j'ai des anomalies que ne m'explique pas.

Ainsi, pour la valeur Hermès, le l'indicateur graffe me donne 44,76 (Ecran joint), la statistique me donne 1,06 et je me suis  
essayé à faire le calcul et je trouve 0.84!!!  
Quelqu'un peut il m'indiquer mon erreur?

(114 msg)



Merci d'avance.  
Démon.



Groupe : SRD Date : 13/04/2012  
Force relative par rapport à cac40 (depuis le 13/04/2011)

1,06 Hermes intl  
0,99 Zodiac  
0,84 Gemalto  
0,82 EADS  
0,81 Remy Cointreau

Hermès CAC Différence  
Cours au 13/04/2012 247.7 3189.09  
Cours au 13/04/2011 150.75 4006.23  
Ecart 96.95 -817.14  
Ecar/cours 13/04/11 0.643117745 -0.203967321 0.847085066

L'homme sage est celui qui connaît ses limites (Magnum force (Callahan/Clint Eastwood))

#1347655

smallcaps90

Posté le : le 15-04-2012 14:05:12 [-]

#1347661



Bonjour Demon,

Merci de redonner un peu de vie à la file.  
Pour ce qui concerne la "Force Relative" (externe), j'avais proposé un programme qui la recalcule et qui trouve les mêmes valeurs que la Force Relative livrée avec GAP.  
Tu pourras trouver mon post du 09/08/2003 qui en parle à l'adresse :  
<http://www.pro-at.com/forums-bourse/topic.php?TOPI...>



Ton problème peut venir du fait que tes historiques de Hermes et du CAC ne commencent pas à la même date...vérifie...

On peut aussi au lieu de démarrer les calculs à l'origine de l'historique disponible le plus court, choisir la durée sur laquelle les calculs seront effectués, 1 mois, 2 mois,..., ou 12 mois par exemple.

Cordialement.

#1347661

Démon

Posté le : le 15-04-2012 20:19:52 [-]

#1347690



Merci Smallcaps

Je m'interroge: si la FR (Weinstein) se calcule sur 52 semaines, ne devrait on pas plutôt prendre la durée de calcul comme valeur fixe et non le point de départ.  
Et au lieu (ou en plus) de calculer la moyenne de la FR, comparer deux FR de durée différente (1an et trois mois par exemple).



Je vois que tu es toujours attentif aux messages de cette file. Sois en mille fois remercié.  
Bonne soirée.  
Démon

L'homme sage est celui qui connaît ses limites (Magnum force (Callahan/Clint Eastwood))

#1347690

smallcaps90

Posté le : le 16-04-2012 08:32:54 [-]

#1347733



Bonjour Démon,

Oui je pense que Tu as raison pour ce qui concerne le choix de la durée du calcul de 52 semaines si tu utilises méthode de Weinstein plutôt que de fixer le point de départ de l'indicateur.  
Ensuite tout est possible et pourquoi pas comparer deux FR de durées différentes effectivement. Reste à en tirer des conclusions utiles...

(1193 msg)



bonne nuit

Post le : le 21-0 -2012 19:3 : 5 [-]

13 9621

Démon



bonsoir  
utilise l'indicateur cliquer pour tracer les canaux en tenant partir du programme de roite de regression.  
comme je ne sais pas comment faire le point de départ des cycles et le fait généralement globalement en traçant sur le A et affine si nécessaire.

(11 msg)



quelqu'un peut-il me dire comment modifier mon programme pour que les canaux se tracent automatiquement  
après mes observations il faudrait que une fois le nouveau point de cycle apparaît le nouveau canal ne s'aligne  
une fois le canal antérieur cassé. cela compenserait le petit défaut de répétition du passé.

le top serait que les canaux apparaissent sur le dernier changement (même si le calcul ne se fait que sur celui-ci) cela  
permettrait de faire une statistique sur les ruptures des canaux.

je sais que le dévot est beaucoup c'est pour quoi la réponse ou non et remercie tous les contributeurs de cette file.  
merci à l'avance.  
mon

mon



```
// roite de regression linéaire se termine P1 p rio es
// de la p rio e actuelle et commence P1 P2 p rio es de celle-ci.
// anau de regression linéaire tracés parallèlement la roite
// de regression linéaire par la plus haute (ou ouverture-cloture) et la plus basse (ou ouverture-cloture)
// de la p rio e.
//
```

```
ourbe1
ourbe2
ourbe3
```

```
IRAGIT IIT -P1
AR
```

```
PRP2 R
(0) RA GP R
(0) TR
IPR
```

```
( P2)
( P2)
( P2)
( P2)
```

```
A (P2 - - )/P2 )(P2 - - )
```

```
PRP2 R
AT (0) AA (ouverture cloture)
A (0) IA (ouverture cloture)
```

```
RT R G(0) A
ART AT (0) AT - RT R G
```

ART A (0) R IT R G- A  
I P R

A ( ART A T P2)  
A ( ART A P2)

P R P2 R  
I A T R IT R G  
A R

1 RA GP R  
T A T  
I I  
I A R IT R G -  
A R  
2 RA GP R  
A  
I I  
I P R

P R P2 R  
R IT P A ( T - A 1)  
R IT I A ( - A 2)  
I P R  
I I

IRA G I T I I T - P  
A R

P R P3 R  
(0) RA GP R  
(0) T R  
I P R

( P3)  
( P3)  
( P3)  
( P3)

(P3 - - )/P3 - - )  
( - - )P3

P R P3 R  
A T (0) A A ( u erture loture)  
A (0) I A ( u erture loture)

R IT R G1(0)  
ART A T (0) A T - R IT R G1  
ART A (0) R IT R G1- A  
I P R

A ( ART A T P3)  
P A ( ART A P3)

P R P3 R  
I A T R IT R G1  
A R  
1 RA GP R  
T A T  
I I  
I A R IT R G1 - P  
A R  
2 RA GP R  
P A  
I I  
I P R

P R P3 R  
R IT P1 ( T - 1)  
R IT I 1 (P - 2)  
I P R  
I I

homme sage est celui qui connait ses limites ( agnum force ( allahan/ lint astwoo ))

 13 9621

Post le : le 18-06-2012 19:51:12 [-]    

1363930

Démon



on our

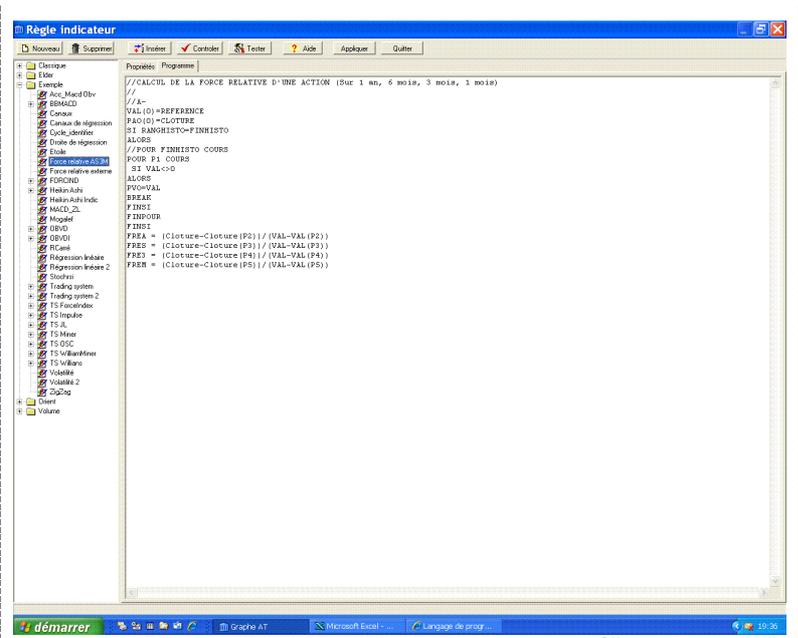
re iens sur mon probl me e orce relati e ( on boulot se calme 😊).

(11 msg)

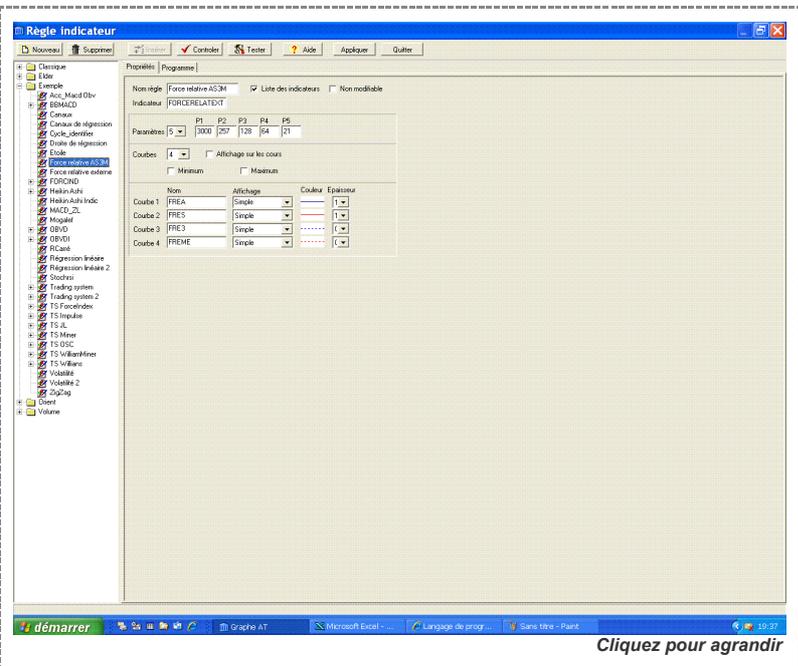


ai essa e programmer la force relati e pour a oir cet in icateur a ec longueurs iff rentes.  
ais ce uime semble interessant cest ue lin icateur soit glissant cest ire ue la R l an soit calcul e tou ours par  
rapport au cours un an a ant- ainsi la R au 10/0 /2012 serait calcul e par rapport la aleur e cl ture et celle e  
lin ice u 10/0 /2011).

on programme est ci apr s mais il ne fonctionne pas u tout ( a ne m tonne pas e sais uste a apter les programmes).  
u est ce ue e me trompe  
erci a ance pour otre ai e.  
mon



[Cliquez pour agrandir](#)



[Cliquez pour agrandir](#)



Cliquez pour agrandir

L'homme sage est celui qui connaît ses limites (Magnum force (Callahan/Clint Eastwood))

#1363930

smallcaps90

Posté le : le 27-06-2012 08:38:55 [-]

#1365753



Bonjour Demon,

J'ai écrit un petit programme pour résoudre ton pb de forces relatives multiples glissantes. J'utilise les définitions que je donnais page 3 et je n'ai pas tenu compte du fait que les valeurs que l'on compare pourraient avoir des historiques de longueurs différentes. Ceci a peu de chances de se produire vu que la force relative la plus longue, l'annuelle, est calculée sur 257 périodes. Plus précisément j'utilise une boucle "Pour" par durée de calcul, cela fait quatre boucles "Pour" donc.

(1193 msg)



**Programme :**

```
//=====
//Forces_Relatives_Multiples
//=====

//V1.0
//le 26/06/2012
//smallcaps90
//=====
//P1, P2, P3 P4 sont les durées des calculs
//pour les forces relatives annuelle, semestrielle,
//trimestrielle et mensuelle
//P5 recul de calcul des moyennes des forces relatives
//=====

//Récup de la valeur de comparaison
//
VC(0)=Reference

Si RangHisto=FinHisto Alors

//Force Relative Externe Annuelle
//
C1=Cloture(P1)
VC1=VC(P1)
Pour P1 Cours
ProAct1=(Cloture-C1)/C1
ProComp1=(VC-VC1)/VC1
FRE1(0)=ProAct1-ProComp1
MFRE1=Moyenne(FRE1,P5)
FinPour

//Force Relative Externe Semestrielle
//
C2=Cloture(P2)
VC2=VC(P2)
Pour P2 Cours
ProAct2=(Cloture-C2)/C2
ProComp2=(VC-VC2)/VC2
FRE2(0)=ProAct2-ProComp2
MFRE2=Moyenne(FRE2,P5)
FinPour

//Force Relative Externe Trimestrielle
//
C3=Cloture(P3)
```

```

3 (P3)
Pour P3 ours
ProAct3 ( loture- 3)/ 3
Pro omp3 ( - 3)/ 3
R 3(0) ProAct3-Pro omp3
R 3 oyenne( R 3 P5)
inPour

// orce Relative terme ensuelle
//
loture(P )
(P )
Pour P ours
ProAct ( loture- )/
Pro omp ( - )/
R (0) ProAct -Pro omp
R oyenne( R P5)
inPour

inSi

// in du code

```

Tu peu supprimer les lignes de calculs des moyennes si tu ne els souhaites pas.

**en tre Propri t s :**

Propriétés | Programme

Nom règle: Forces\_Relatives\_Multi;  Liste des indicateurs  Non modifiable

Indicateur: FORCES\_RELATIV

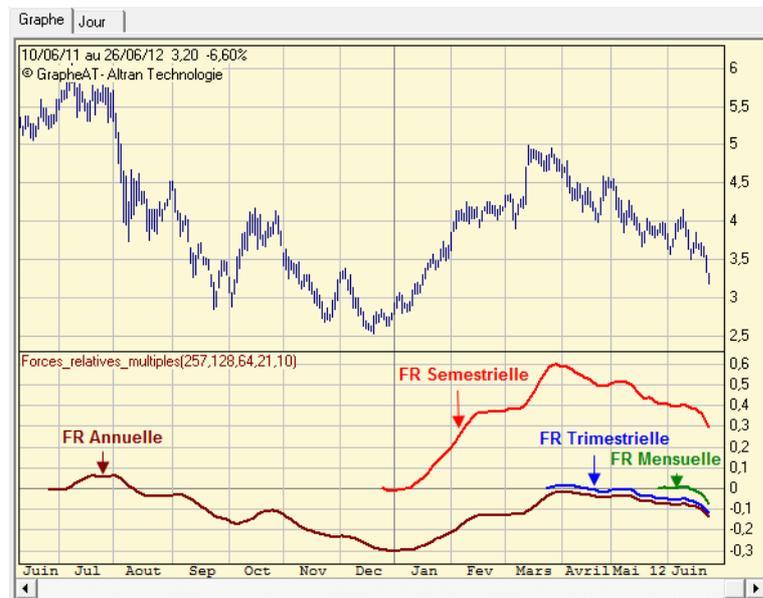
Paramètres: 5 (dropdown) | P1: 257 | P2: 128 | P3: 64 | P4: 21 | P5: 10

Courbes: 4 (dropdown)  Affichage sur les cours

Minimum  Maximum

Nom	Affichage	Couleur	Epaisseur
Courbe 1: MFRE1	Segments	[Red]	2
Courbe 2: MFRE2	Segments	[Orange]	2
Courbe 3: MFRE3	Segments	[Blue]	2
Courbe 4: MFRE4	Segments	[Green]	2

**emple a ec Altran Technologies :**



O en es-tu avec ton programme de canau automatiques  
ordialement