

max_et_min

Posté le : le 27-06-2012 20:40:53 [-]    

#1366054



Bonsoir, je vois que l'on travaille toujours ici, je m'absente 5 minutes et je retrouve de nouveaux programmes, mes amitiés à tous et bonne continuation
Didier

(308 msg)



#1366054



Démon

Posté le : le 25-07-2012 20:21:26 [-]    

#1372772



Bonjour Smallcaps90;

je remercie pour tes efforts;

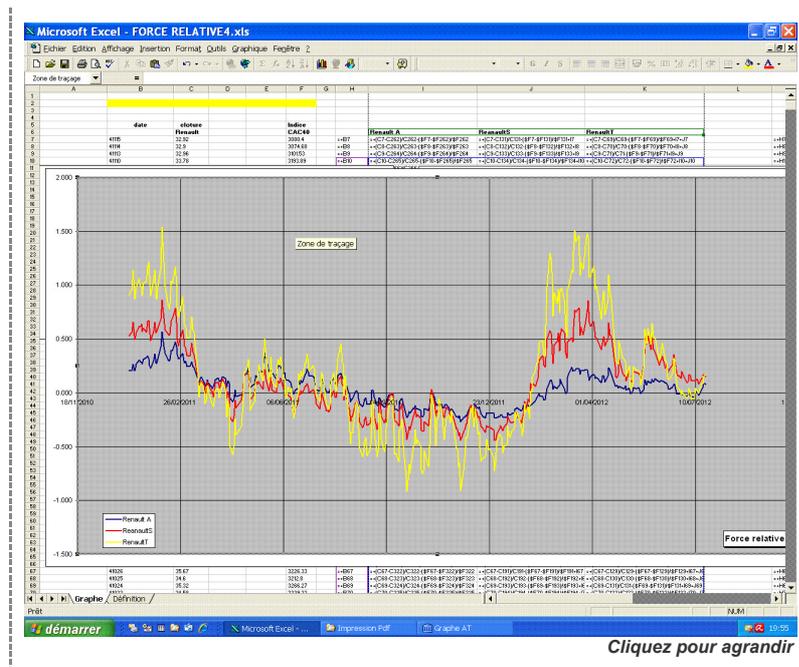
j'ai programmé sous excel, à partir des fichiers de Cyberpapy, l'indicateur de force relative glissante tel que je pense qu'il donne des informations intéressantes.

J'ai ajouté les FR semestrielles et trimestrielles à la FR annuelle, ce qui peut s'assimiler à une courbe de signal. Exemple ci après.

Mais je n'arrive pas à la programmer sous GraphAt.

(114 msg)





En ce qui concerne mes canaux, j'ai commencé à regarder.
Je pense (mais je suis très faible en programmation) utiliser la formule de pente dont tu t'es servi pour tracer les divergences.

Merci encore de tout ce travail que tu partages.

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

#137272

Démon

Posté le : le 02-08-2012 02:12:08 [-]

#1374463



Bonsoir,

ce soir la colère m'a pris et après bien des essais, je suis arrivé à faire partir les canaux de la déclarations des cycles. Cela me permet d'avoir une visualisation automatique du déroulement des cycles.

Cf programme et graphe exemple.

(114 msg)



```
// Droite de régression linéaire se termine à P1 périodes
// de la période actuelle, et commence à P1+P2 périodes de celle-ci.
// Canaux de régression linéaire tracés parallèlement à la droite
// de régression linéaire par la plus haute (ouverture-cloture) et la plus basse (ouverture-cloture)
//de la période.
//
Courbe1 = UBOLL
Courbe2 = MBOLL
Courbe3 = LBOLL
```

```
SI RANGHISTO = FINHISTO - 3
ALORS
pour 120 COURS
CycleMajeur=-CYCLE_INDENTIFIER.MajorCycleBuy+CYCLE_INDENTIFIER.MajorCycleSell
CycleMineur=-CYCLE_INDENTIFIER.MinorCycleBuy+CYCLE_INDENTIFIER.MinorCycleSell
SI CycleMajeur=1
ALORS
CM = FINHISTO-RANGHISTO-1
FINSI
SI CycleMineur=1
ALORS
CP = FINHISTO-RANGHISTO-1
FINSI
FINPOUR
FINSI
```

```
SI RANGHISTO = FINHISTO - P1
ALORS
```

```
POUR CP COURS
X(0) = RANGPOUR
Y(0) = CLOTURE
FINPOUR
```

```
SOMX = SOMME(X,CP)
SOMY = SOMME(Y,CP)
SOMXX = SOMME(X*X,CP)
SOMXY = SOMME(X*Y,CP)
```

$A = (CP \cdot SOMXY - SOMX \cdot SOMY) / (CP \cdot SOMXX - SOMX \cdot SOMX)$
 $B = (SOMY - A \cdot SOMX) / CP$

POUR CP COURS
HAUTC(0)=MAXVAL(Ouverture,Cloture)
BASC(0)=MINVAL(Ouverture,Cloture)

$DROITE_REG(0) = A \cdot X + B$
 $ECART_HAUTC(0) = HAUTC - DROITE_REG$
 $ECART_BASC(0) = DROITE_REG - BASC$
FINPOUR

$EH = \max(ECART_HAUTC, CP)$
 $EB = \max(ECART_BASC, CP)$

POUR CP COURS
SI HAUTC=DROITE_REG + EH
ALORS
X1=RANGPOUR
HT=HAUTC
FINSI
SI BASC=DROITE_REG - EB
ALORS
X2=RANGPOUR
BS=BASC
FINSI
FINPOUR

POUR CP COURS
 $DROITE_SUP = A \cdot X + (HT - A \cdot X1)$
 $DROITE_INF = A \cdot X + (BS - A \cdot X2)$
FINPOUR
FINSI

SI RANGHISTO = FINHISTO - P3
ALORS

POUR CM COURS
V(0) = RANGPOUR
W(0) = CLOTURE
FINPOUR

$SOMV = \text{SOMME}(V, CM)$
 $SOMW = \text{SOMME}(W, CM)$
 $SOMVV = \text{SOMME}(V \cdot V, CM)$
 $SOMVW = \text{SOMME}(V \cdot W, CM)$

$C = (CM \cdot SOMVW - SOMV \cdot SOMW) / (CM \cdot SOMVV - SOMV \cdot SOMV)$
 $D = (SOMW - C \cdot SOMV) / CM$

POUR CM COURS
HAUTE(0)=MAXVAL(Ouverture,Cloture)
BASE(0)=MINVAL(Ouverture,Cloture)

$DROITE_REG1(0) = C \cdot V + D$
 $ECART_HAUTE(0) = HAUTE - DROITE_REG1$
 $ECART_BASE(0) = DROITE_REG1 - BASE$
FINPOUR

$EO = \max(ECART_HAUTE, CM)$
 $EP = \max(ECART_BASE, CM)$

POUR CM COURS
SI HAUTE=DROITE_REG1 + EO
ALORS
V1=RANGPOUR
OT=HAUTE
FINSI
SI BASE=DROITE_REG1 - EP
ALORS
V2=RANGPOUR
PS=BASE
FINSI
FINPOUR

POUR CM COURS
 $DROITE_SUP1 = C \cdot V + (OT - C \cdot V1)$
 $DROITE_INF1 = C \cdot V + (PS - C \cdot V2)$
FINPOUR
FINSI



Cliquez pour agrandir

Voilà. Pour vous les AS de la programmation, ce n'est rien mais moi c'est la fête et je partage ma joie avec vous.

Sur ce, Bonne Nuit.

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

#1374463

smallcaps90

Posté le : le 02-08-2012 13:42:39 [-]

#1374581



Bonjour Demon,

Eh bien voilà tu y es arrivé, bravo!
 Pourrais-tu poster aussi la fenêtre "Propriétés" de l'indic?
 Elle est bien utile pour comprendre quelles sont les courbes que tu traces et connaître les valeurs de tes paramètres.
 Je te souhaite bonne continuation.
 Cordialement.

(1193 msg)



#1374581



Démon

Posté le : le 04-08-2012 12:25:30 [-]

#1375143



Bonjour Smallcaps;
 merci pour tes encouragements

ci joint le tableau propriété.
 J' ai changé légèrement le programme pour mettre en variable la période ou je ne veux pas que des cycles soient détectés.
 En effet je me sers visuellement des canaux pour valider ou non un changement de cycle (je n'oublie pas que cet indicateur repeint le passé: par exemple un cycle majeur baissier sur le CAC déclenché le 5 juillet a disparu le 27. Il est vrai qu'avant ce jour le cycle corroborait la théorie de Dow-haut: sommet du 19 plus bas et bas du 25 plus bas).
 Programme modifié:

(114 msg)



```
//Sur une idée originale de Smallcaps90
// Droite de régression linéaire se termine à P1 périodes
// de la période actuelle, et commence à début des derniers cycles mineurs (à P3 & P4 jours) et majeurs de celle-ci
// Canaux de régression linéaire tracés parallèlement à la droite
// de régression linéaire par la plus haute (ouverture-cloture) et la plus basse (ouverture-cloture)
//de la période.
```

```
//
Courbe1 = UBOLL
Courbe2 = MBOLL
Courbe3 = LBOLL
```

```
SI RANGHISTO = FINHISTO - P3
ALORS
pour 220 COURS
CycleMajeur=-CYCLE_IDENTIFIER.MajorCycleBuy+CYCLE_IDENTIFIER.MajorCycleSell
SI CycleMajeur=1
ALORS
CM = FINHISTO-RANGHISTO-1
FINSI
FINPOUR
FINSI
```

```
SI RANGHISTO = FINHISTO - P4
ALORS
pour 220 COURS
CycleMineur=-CYCLE_IDENTIFIER.MinorCycleBuy+CYCLE_IDENTIFIER.MinorCycleSell
SI CycleMineur=1
ALORS
```

```

CP = FINHISTO-RANGHISTO-1
FINSI
FINPOUR
FINSI

SI RANGHISTO = FINHISTO - P1
ALORS

POUR CP COURS
X(0) = RANGPOUR
Y(0) = CLOTURE
FINPOUR

SOMX = SOMME(X,CP)
SOMY = SOMME(Y,CP)
SOMXX = SOMME(X*X,CP)
SOMXY = SOMME(X*Y,CP)

A = (CP*SOMXY-SOMX*SOMY)/(CP*SOMXX-SOMX*SOMX)
B = (SOMY-A*SOMX)/CP

POUR CP COURS
HAUTC(0)=MAXVAL(Ouverture,Cloture)
BASC(0)=MINVAL(Ouverture,Cloture)

DROITE_REG(0) = A * X + B
ECART_HAUTC(0) = HAUTC-DROITE_REG
ECART_BASC(0) = DROITE_REG-BASC
FINPOUR

EH =MAX(ECART_HAUTC,CP)
EB =MAX(ECART_BASC,CP)

POUR CP COURS
SI HAUTC=DROITE_REG + EH
ALORS
X1=RANGPOUR
HT=HAUTC
FINSI
SI BASC=DROITE_REG - EB
ALORS
X2=RANGPOUR
BS=BASC
FINSI
FINPOUR

POUR CP COURS
DROITE_SUP = A*X + (HT - A*X1)
DROITE_INF = A*X + (BS - A*X2)
FINPOUR
FINSI

SI RANGHISTO = FINHISTO - P2
ALORS

POUR CM COURS
V(0) = RANGPOUR
W(0) = CLOTURE
FINPOUR

SOMV = SOMME(V,CM)
SOMW = SOMME(W,CM)
SOMVV = SOMME(V*V,CM)
SOMVW = SOMME(V*W,CM)

C = (CM*SOMVW-SOMV*SOMW)/(CM*SOMVV-SOMV*SOMV)
D = (SOMW-C*SOMV)/CM

POUR CM COURS
HAUTE(0)=MAXVAL(Ouverture,Cloture)
BASE(0)=MINVAL(Ouverture,Cloture)

DROITE_REG1(0) = C * V + D
ECART_HAUTE(0) = HAUTE-DROITE_REG1
ECART_BASE(0) = DROITE_REG1-BASE
FINPOUR

EO =MAX(ECART_HAUTE,CM)
EP =MAX(ECART_BASE,CM)

POUR CM COURS
SI HAUTE=DROITE_REG1 + EO
ALORS
V1=RANGPOUR
OT=HAUTE
FINSI
SI BASE=DROITE_REG1 - EP
ALORS
V2=RANGPOUR
PS=BASE
FINSI
FINPOUR

```

POUR CM COURS
 DROITE_SUP1 = C*V + (OT - C*V1)
 DROITE_INF1 = C*V + (PS - C*V2)
 FINPOUR
 FINSI

Propriétés | Programme

Nom règle : Canaux Liste des indicateurs Non modifiable

Indicateur : CANAUX

Paramètres : 4 P1 P2 P3 P4
 1 1 12 3

Courbes : 7 Affichage sur les cours Ne pas afficher les cours

Nom	Affichage	Couleur	Epaisseur
Courbe 1 CUBOLL	Simple	—	1
Courbe 2 CMBOLL	Simple	—	1
Courbe 3 CLBOLL	Simple	—	1
Courbe 4 DROITE_SUP	Segments	—	1
Courbe 5 DROITE_INF	Segments	—	1
Courbe 6 DROITE_SUP1	Segments	---	C
Courbe 7 DROITE_INF1	Segments	---	C

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

#1375143

jelofe

Posté le : le 28-09-2012 16:47:57 [-]

#1387658



bonjour

J'ai besoin d'un peu d'aide pour programmer le cdur de JI sur graphe at pro
 Je bute sur la transcription de WILDERAVERAGE[z](hausse)
 Une idée
 Merci

(6 msg)

PROFIL NON RENSEIGNÉ

#1387658

smallcaps90

Posté le : le 29-09-2012 09:45:47 [-]

#1387753



Bonjour jelofe,

Pour ce qui concerne la moyenne de Wilder, appelée aussi moyenne arithmétique modifiée (voir le bouquin de Thierry Béchu sur l'analyse technique), j'avais montré qu'il s'agit tout simplement d'une moyenne exponentielle de recul de calcul différent de celui de la moyenne de Wilder.

(1193 msg)



On peut donc la programmer facilement avec GrapheAT Pro.
 Si le paramètre de calcul de la moyenne de Wilder est n1, il suffit de calculer une moyenne exponentielle (EXPOSUIV dans Graphe AT Pro) de paramètre n2 tel que : **n2=2*n1-1**.

Si tu veux de plus amples explications tu peux te reporter à mon message du 20/09/2004 à l'adresse : <http://www.pro-at.com/forums-bourse/bourse-2-13424.html> en bas de page.

A ta disposition si tu as d'autres problèmes...

Cordialement.

édité le : 29-09-2012 10:07:44

#1387753

jelofe

Posté le : le 30-09-2012 10:26:22 [-]

#1387799



Bonjour,

Merci pour ton attention

J'ai programmé ceci mais j'obtiens une courbe bien trop lissée

(6 msg)

PROFIL NON RENSEIGNÉ

//Code CDUR de jI pro at

//Mettre Z en variable et valeur Z = 8

```

// MACD ZERO LAG
// p= variable macd zerolag
// q= variable signal
// r= variable macd - signal mettre histogramme
z0(0)= EXPOSUIV(z0,Cloture,P1)//
z1(0)= EXPOSUIV(z1,z0,P1)//dema[9](close)
z2(0)= EXPOSUIV(z2,Cloture,P2)//
z2(0) = EXPOSUIV(z2,z02,P2)//dema[19](close)
e(0)= z1(0) - z2(0)
z03(0)= EXPOSUIV(z03,e,P3)//dema[6](e)
z3(0)=EXPOSUIV(z3,z03,p3)//dema[6](e)
f(0)=z3(0)

hau =max(f(0)-f(1),p1)
bai =max(f(1)-f(0),p1)

z4(0)=EXPOSUIV(z4,hau,P4)
z5(0)=EXPOSUIV(z5,bai,P4)

diff=z4-z5
// Calcul du RSI de Wilder suivant le paramètre P4
Si diff>0 Alors
moyh = (moyh * (P4-1) + diff) / P4 // moyenne des hausses
moyb = (moyb * (P4-1)) / P4
Sinon
moyb = (moyb * (P4-1) - diff) / P4 // moyenne des baisses
moyh = (moyh * (P4-1)) / P4
FinSi
cdur = 100 * (moyh / (moyh + moyb)) // équivalent à la formule classique : 100 - 100 / (1 + moyh/moyb)

Où se trouve mon , mes erreurs?
merci

```

 #1387799

Posté le : le 30-09-2012 12:09:16 [-]    

#1387803

smallcaps90

Bonjour jefefe,



Plusieurs petites erreurs dans ton programme.

En raccourci :

- tu ne calcules pas vraiment des DEMA ;
- tu as confondu **Max** et **MaxVal** dans le calcul des variations journalières ;
- tu ajoutes le programme de calcul du RSI alors que celui-ci est déjà calculé plus simplement.

(1193 msg)



Je te propose le **programme** suivant qui date de 2009 mais que je n'avais pas posté à l'époque :

```

//====
//CDUR
//====

//V2.0
//transcodé le 24/04/2009
//version corrigée
//smallcaps90
//=====

//1 MACD_Zero_Lag
//
M1(0)=Exposuiv(M1,Cloture,P1)
M2(0)=Exposuiv(M2,M1,P1)
DEMA1=2*M1-M2 //Z1

M3(0)=Exposuiv(M3,Cloture,P2)
M4(0)=Exposuiv(M4,M3,P2)
DEMA2=2*M3-M4 //Z2

MACD_Zero_Lag=DEMA1-DEMA2 //E

//Signal
//
M5(0)=Exposuiv(M5,MACD_ZERO_LAG,P3)
M6(0)=Exposuiv(M6,M5,P3)
Signal(0)=2*M5-M6 //F

//2 CDUR = RSI du Signal de la MACD Zéro Lag
//
Hauss=MaxVal(0,Signal-Signal(1))
Baiss=MaxVal(Signal(1)-Signal,0)
M_Hauss=Exposuiv(M_Hauss,Hauss,P4)
M_Baiss=Exposuiv(M_Baiss,Baiss,P4)

RS=M_Hauss/M_Baiss
CDUR=100*(1-1/(1+RS))

//3 X up CDUR
//
Si CDUR(1)<15 ET CDUR>=CDUR(1) Alors I=25

```

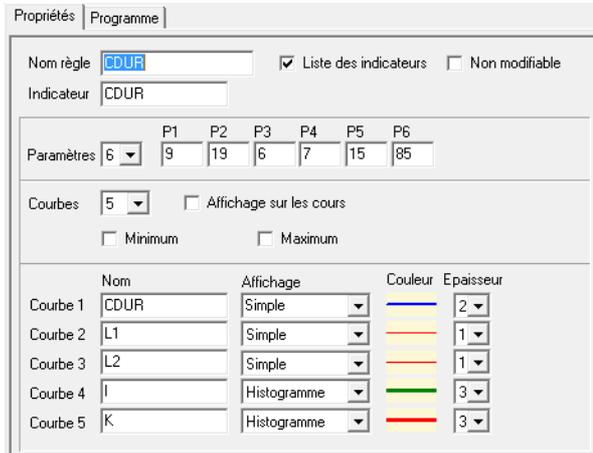
```
//4 X Down CDUR
//
Si CDUR(1)>85 ET CDUR<=CDUR(1) Alors K=25

//5 Limites
//
L1=P5
L2=P6

//Fin du code

//=====
```

Fenêtre Propriétés :



Comme tu peux le constater, P4 qui est le paramètre qui représente Z devrait valoir 15 ici. En effet la valeur préconisée par JL étant Z=8, P4 devrait donc valoir : $2 \cdot 8 - 1 = 15$ pour calculer la moyenne Expo assimilable à une moyenne de Wilder présente dans le calcul du RSI.

Avec cette valeur peu de signaux apparaissent sur le graphe...

C'est la raison pour laquelle j'ai choisi P4=7 ce qui correspond à Z=4 sur le graphe suivant et qui donne bien les pics et creux du CDUR.

Bon il y aurait moyen de les calculer différemment ces extremas en ne faisant apparaître qu'un tlc ou K par extrémum. J'ai conservé la manière de les calculer de JL dans le programme ci-dessus néanmoins.

Voici ce que cela donne par exemple sur Altran Techno :



Cordialement.



Bonjour;

je viens sur la file ce jour pour livrer mes résultats de recherche et je m'aperçois que quelqu'un a programmé le CDUR, mon prochain "travail à faire".

(114 msg)

C'est Bizance.

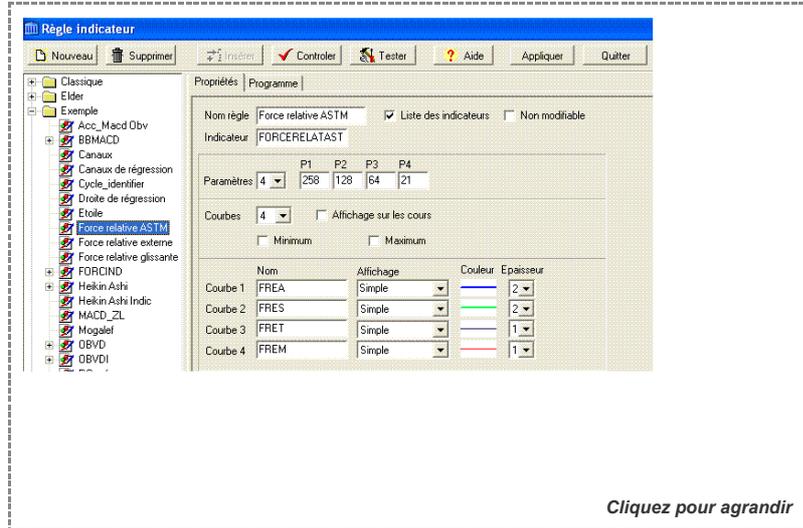


De mon côté je vous joins ci après la courbe de force relative (avec plusieurs reculs: année, semestre, trimestre, mois (attention en cumul, exemple Fr semestre = Fr annuelle + Fr semestre ce qui rend beaucoup plus parlant la lecture de l'indicateur)) qui se calcule sur toute la longueur de l'historique.

J'espère que ça aidera.

Elle est pas belle la vie?

Démon



[Cliquez pour agrandir](#)

Le programme maintenant (c'était si simple).

//CALCUL DE LA FORCE RELATIVE D'UNE ACTION (Sur 1 an, 6 mois, 3 mois, 1 mois)

```

VAL(0)=REFERENCE
PAO=closure(0)
VALA=VAL(P1)
VALS=VAL(P2)
VALT=VAL(P3)
VALM=VAL(P4)
PAOA=CLOTURE(P1)
PAOS=CLOTURE(P2)
PAOT=CLOTURE(P3)
PAOM=CLOTURE(P4)
FREA = (PAO-PAOA)/PAOA-(VAL-VALA)/VALA
FRES = FREA + ((PAO-PAOS)/PAOS-(VAL-VALS)/VALS)
FRET = FRES + ((PAO-PAOT)/PAOT-(VAL-VALT)/VALT)
FREM = FRET + ((PAO-PAOM)/PAOM-(VAL-VALM)/VALM)

```

Une image pour le résultat



[Cliquez pour agrandir](#)

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

#1387820



jelofe

Posté le : le 30-09-2012 16:33:47 [-]

Finalement merci pour ces explications.J'ai compris mes erreurs.

#1387821



Si je peu me permettre il me semble qu'il faut écrire:
Si CD R(1) 15 ET CD R CD R(1) Alors I 25

alors moins de signau générés.

(6 msg)

PR FIL N
RENSEIGN

ue penses tu du cdur autre filtre simple s st me très simple de prise de position Les s st mes les plus simples ne
sont ils pas en définitif rechercher

cordialement

1387821

Posté le : le 30-09-2012 21:08:08 [-]

138783

smallcaps90



Bonsoir Demon,

Merci pour ton indic de force relative avec plusieurs reculs...
uant la vie, oui on peut dire qu'elle est belle...c pas dur!

(1193 msg)

Cordialement.



Bonsoir jefofé,

ui bien sûr, tu as raison pour l'instruction :
Si CD R(1) 15 ET CD R CD R(1) Alors I 25

Perso je n'utilise pas cet indicateur car je n'ai pas suivi de pr s les travaux de L.
Des indics qui déterminent les pics et creux des cours sont assez nombreux et CD R s'ajoute à la liste.
Mais comme tu le dis, plus c'est simple mieux c'est.

Cordialement.

138783

Posté le : le 30-09-2012 21:55:2 [-]

1387839

Démon



Bonsoir Smallcaps

en copiant collant le programme ci dessus (CD R) je n'obtiens qu'un histogramme vert 25.

Le souci ne viendrait il pas de la variable Pri

(11 msg)

Cordialement



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

1387839

Posté le : le 30-09-2012 22:02: 8 [-]

13878 0

Démon



Re

j'ai remplacé pri par Cloture (comme dans le programme éro lag posté sur la file),,,,,,pas mieux .

e retourne chercher.

(11 msg)

Bonne soirée



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

13878 0

Posté le : le 30-09-2012 22:20:38 [-]

13878 1

Démon



Re

trouvé

M auss E posuiv(MM auss, auss,P)
M Baiss E posuiv(MM Baiss,Baiss,P)

(11 msg)

Ce coup ci, bonne nuit.



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

13878 1