

STRATEGIES D'INVESTISSEMENT AVEC VISUAL CHART

Table des matières

Préface

LES SYSTÈMES AUTOMATISÉS D'INVESTISSEMENT. INTRODUCTION

Définition. 10

A quel type de modèle d'investissement s'applique-t'il? 10

Quels sont les avantages? 11

Comment s'organisent ils? 12

Comment s'élaborent ils? 13

Que sont la gestion de capital et le contrôle du risque? 16

Comment cela peut-il affecter la psychologie de l'investisseur? 26

LES SYSTÈMES AUTOMATISÉS D'INVESTISSEMENT. DESIGN ET PROGRAMMATION AVEC VISUAL CHART

I^{er} PARTIE. PRINCIPES DE BASES 32

-Visual Chart. Possibilités 32

-Visual Chart. Modèle d'organisation 33

-Les scénarii de design 34

- Les principes 35

Le calcul 36

Les outils 37

II^e PARTIE. LA PLATAFORME DE DESIGN VISUELLE 47

-PDV. L'Environnement 47

-PDV. La structure du code 47

-Parcours didactique de la programmation en PDV 52

Système Moyenne Mobile 52

Système comparatif 66

Système Croisement 72

Système Pivots 80

Système Bandes 87

Système Consécutifs 91

Système Sorties 95

Système Fluctuation 102

Système RSI 106

Système Clôtures 114

Système Accumulation 118

Système Retracements 122

Système Attente 125

-Principaux éléments apparaissant dans les Systèmes 132

-Trucs pratiques pour la programmation 137

Déplacer des blocs et des unités 137

Supprimer un élément 139

Copier un élément 139

Créer des copies de travaux 140

Travailler à plein écran 140

- Graphique et code en simultanée 140
- Vue générale et zoom 142
- Création plusieurs variables à la suite 144
- Variables ou fonctions oubliées 144
- Alignements 144
- Edition direct depuis le diagramme 146
- Changement d'environnement: De la PDV au VBA 147
- Liaison entre les différents éléments 147
- Création des Etudes et des Indicateurs 148
- Etude Double Courbe des prix 148
- Etude Suivi de Moyenne Mobile 151
- Etude Echantillon de Points Pivots 152
- Etude Clôtures consécutives 154
- Etude Volumen 155
- Indicateur Moyenne Mobile d'une autre Moyenne Mobile 158
- Indicateurs Points Pivots supérieures / Points Pivots inférieures 159
- Indicateur Croisement de moyennes avec alerte 161
- Indicateur MACD histogramme 162
- Nouveaux éléments apparus dans les études et Indicateurs 164
- Questionnaire 168
- Réponses au questionnaire 174

III^a PARTIE .L'ENVIRONNEMENT DE PROGRAMMATION VISUAL BASIC FOR APPLICATION 180

- VBA. Déclarations et Procédures 180
- Parcours didactique de la programmation en VBA 181
- Système Flat 181
- Système Permanence 184
- Système For Next 192
- Système Haussier/Baissier 201
- Système Bouclier 205
- Système SKSD Stochastique 208
- Système Moyennes RSI 215
- Systèmes Bandes Continues 221
- Système Figure 228
- Système Bande de Bollinger 232
- Système Barre Volatile 237
- Système Turtle Soup Plus 241
- Système Run Day 248
- Système Direction 255
- Principaux éléments apparaissant dans les Systèmes 269
- Trucs pratiques pour la programmation 280
- Projets ouverts 280
- Copie de données 280
- Liste des fonctions disponibles 281
- Procédure pour dépurer une stratégie 281
- Syntaxe de l'Identificateur d'un indicador 285
- Affichage du code ajusté à l'écran 285
- Créer des Etudes et des Indicateurs 287
- Etude Haussier/Baissier 287
- Etude RSI 289
- Etude Barres Run Day 291
- Etude Délimitage 295
- Indicateur Ecran 297

Indicateur Double Plancher 299
Indicateur Force Relative 303
Indicateurs Moyennes mobiles déplacées 306
- Nouveaux éléments apparus dans les Etudes et Indicateurs 310
- Questionnaire 312
- Réponses au questionnaire 317

GLOSSAIRE 322

ANNEXE I. UN MODELE DE PROTOCOLE POUR EVALUER LES SYSTEMES DE TRADING 329

- Evaluations des Systèmes appliqués sur l'intraday 332
- Evaluation des Systèmes appliqués sur le journalier ou sur
une unité de temps plus grande 349

ANNEXE II. VISUAL CHART ET LE PASSAGE D'ORDRE DIRECT SUR LE MARCHÉ 357

- Les systèmes automatisés et leur connexion au marché 358
- Autres utilisations du Direct Access 365

ANNEXE III. APPROFONDISSEMENT CONCERNANT LES SYSTEMES ET STRATEGIES ANALYSÉS DANS CE LIVRE 373

BIBLIOGRAPHIE