

Trader le Bund et le 30Y TB avec le signal Heikin Ashi

Jeudi 1 mars 2018

Pascal Hirtz



WH SELFINVEST

Est. 1998

**Luxembourg, France, Belgique
Suisse, Allemagne, Pays-Bas**

Copyright 2007-2017: all rights attached to this guide are the sole property of WH SelfInvest S.A. Reproduction and/or transmission of this guide by whatever means is not allowed without the explicit permission of WH SelfInvest. Disclaimer: this guide is purely informational in nature and can in no way be construed as a suggestion or proposal to invest in the financial instruments mentioned. Persons who do decide to invest in these financial instruments acknowledge they do so solely based on their own decision and risks. All information contained in this guide comes from sources considered reliable. The accuracy of the information, however, is not guaranteed.



- Pourquoi s'intéresser aux obligations?
- A quelles heures sont-elles les plus volatiles?
- Trader les obligations est moins cher avec les futures qu'avec les CFDs
- Qu'est ce qu'un graphique Heikin Ashi?
- Le signal Heikin Ashi et ses 3 avantages
- Exemple de stratégie Heikin Ashi sur le Bund
- Ouvrir un compte



Graphique mensuel du Bund depuis juillet 2007



Graphique hebdomadaire du Bund depuis déc. 2016

- Le Bund est un panier d'obligations d'état allemandes de maturité 8,5 à 10,5 ans. Il sert de référence aux banques pour fixer le coût du crédit à long terme (immobilier, industrie, ...)
- Le Bund a connu une croissance ininterrompue depuis 2008
- Avec le retour de la croissance mondiale, les investisseurs s'attendent à une hausse des taux d'intérêt, provoquée par la crainte du retour de l'inflation
- Ce qui entraînerait une baisse des obligations et une hausse de leur volatilité



Graphique mensuel du 30Y TB depuis juillet 2007

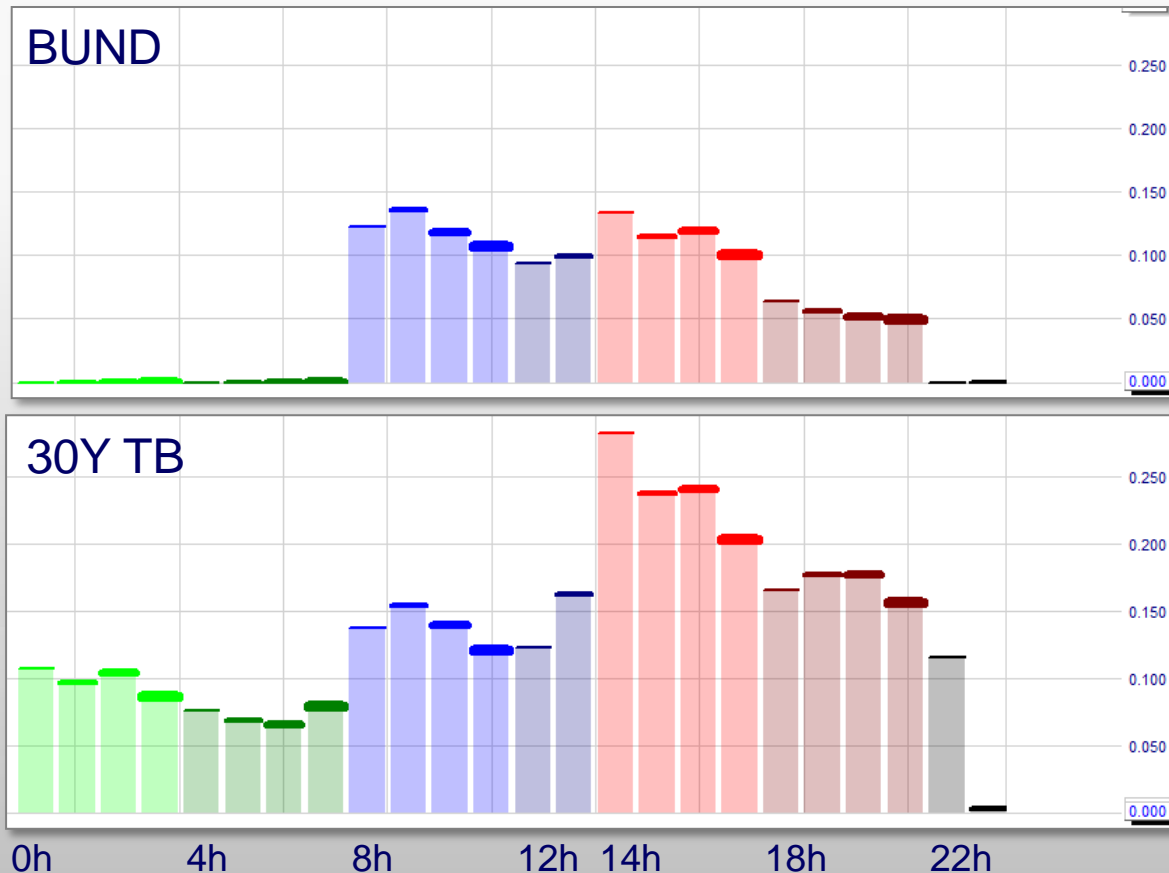


Graphique hebdomadaire du 30Y TB depuis déc. 2016

- Le Bon du Trésor U.S. de 30 ans est un panier d'obligations d'état américaines de maturité 15 à 25 ans. Il est très sensible aux perspectives de croissance et aux risques d'inflation
- Après une extraordinaire période de taux bas créée par les politiques monétaires ultra accommodantes des banques centrales, sommes-nous à un tournant?
- Le retour de la croissance aux U.S. et dans le monde, devraient augmenter les risques d'inflation et provoquer une hausse des taux d'intérêt à long terme
- C'est-à-dire faire baisser la valeur des obligations de long terme comme le 30Y TB

- Pourquoi s'intéresser aux obligations?
- ■ A quelles heures sont-elles les plus volatiles?
- Trader les obligations est moins cher avec les futures qu'avec les CFDs
- Qu'est ce qu'un graphique Heikin Ashi?
- Le signal Heikin Ashi et ses 3 avantages
- Exemple de stratégie Heikin Ashi sur le Bund
- Ouvrir un compte

- Volatilité exprimée en %
- Bund
 - volatilité max: 9h et 14h
 - volatilité min: après 18h
 - volatilité matin = après-midi
- 30Y TB
 - volatilité max: 14h-18h
 - $\text{vol}(30Y TB) = 2 \times \text{vol}(\text{Bund})$
- Les futures offrent des leviers maximum de 200x qui sont adaptés au faible niveau de volatilité

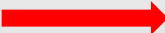


- Pourquoi s'intéresser aux obligations?
- A quelles heures sont-elles les plus volatiles?
- ■ Trader les obligations est moins cher avec les futures qu'avec les CFDs
- Qu'est ce qu'un graphique Heikin Ashi?
- Le signal Heikin Ashi et ses 3 avantages
- Exemple de stratégie Heikin Ashi sur le Bund
- Ouvrir un compte

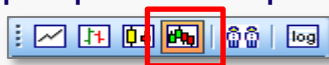
Carnet d'ordres du Bund

		158.41	225
		158.40	356
		158.39	309
		158.38	284
		158.37	284
		158.36	282
		158.35	250
		158.34	280
		158.33	229
		158.32	181
166	1 @ 158.31		
245	158.30		
252	158.29		
326	158.28		
325	158.27		
379	158.26		
589	158.25		
320	158.24		
227	158.23		
288	158.22		

- Sa forte liquidité a pour effet de compresser le spread vers son niveau minimum de 0,01 points
- Ce spread serré du future le rend moins cher à négocier que le CFD et devrait donc intéresser les investisseurs de court terme
- Sa volatilité journalière est faible, d'où le niveau relativement faible de la marge intraday à € 800 par contrat
- Il faut un minimum de € 5.000 pour ouvrir un compte futures

- Pourquoi s'intéresser aux obligations?
- A quelles heures sont-elles les plus volatiles?
- Trader les obligations est moins cher avec les futures qu'avec les CFDs
-  ■ Qu'est ce qu'un graphique Heikin Ashi?
- Le signal Heikin Ashi et ses 3 avantages
- Exemple de stratégie Heikin Ashi sur le Bund
- Ouvrir un compte

- Pour afficher le graphique HA cliquez sur cette touche:

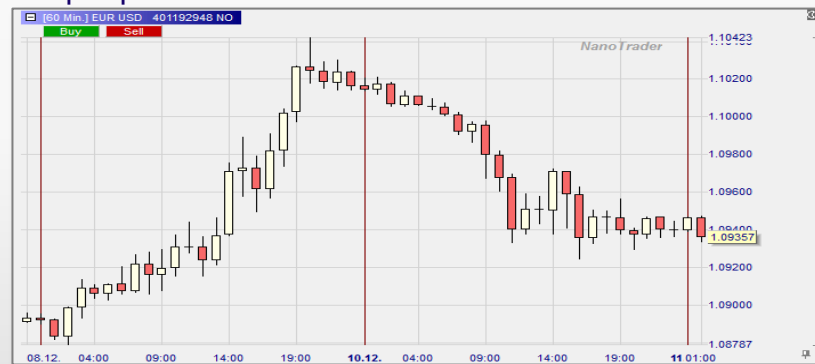


- Le graphique HA caractérise les tendances en coloriant d'une même couleur des séries de bougies consécutives

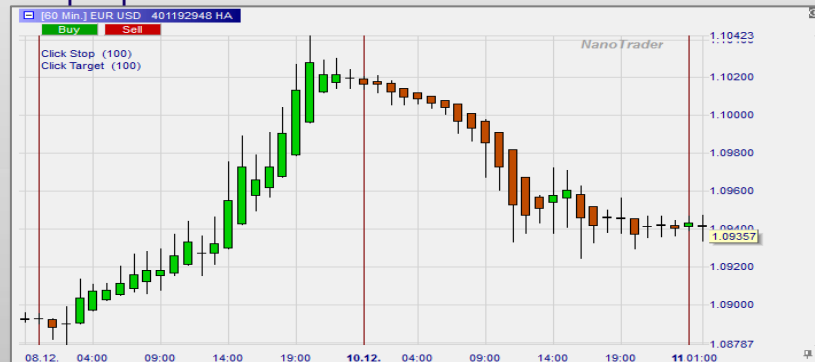
- Un changement de couleur est souvent annonciateur d'un retournement de tendance

Note: Heikin Ashi existe aussi sous forme d'indicateur

Graphique à chandeliers



Graphique Heikin Ashi



Chandeliers

O, C, H, L



t-1



t

H(t)

C(t)

O(t)

L(t)

Bougie Heikin Ashi

xO, xC, xH, xL



t-1



t

$$xH(t) = \max(H(t), xO(t), xC(t))$$

$$xC(t) = (O(t) + H(t) + L(t) + C(t))/4$$

$$xO(t) = (xO(t-1) + xC(t-1))/2$$

$$xL(t) = \min(L(t), xO(t), xC(t))$$

Chandeliers

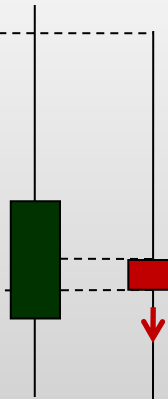


t-1

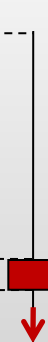


t

Bougies Heikin Ashi



t-1

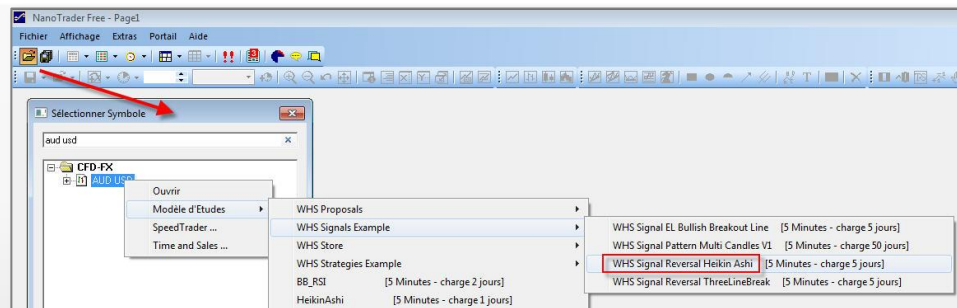


t

Pour qu'une bougie Heikin Ashi change de couleur, il faut un grand chandelier de sens opposé au mouvement en cours.

Or un tel chandelier, allant contre le mouvement en cours, est souvent le signe d'un retournement de tendance.

■ Charger le **modèle d'étude**
« WHS Signal Reversal Heikin Ashi »
dans un **nouveau** graphique:



■ Remplacer une **étude existante** par
le **modèle d'étude**
« WHS Signal Reversal Heikin Ashi »:



■ Ajouter les **indicateurs**
« SignalReversalHeikinAshi_Aggregator »
suivi de « SignalReversalHeikinAshi »
dans un graphique **existant**:



- Pourquoi s'intéresser aux obligations?
- A quelles heures sont-elles les plus volatiles?
- Trader les obligations est moins cher avec les futures qu'avec les CFDs
- Qu'est ce qu'un graphique Heikin Ashi?
- ■ Le signal Heikin Ashi et ses 3 avantages
- Exemple de stratégie Heikin Ashi sur le Bund
- Ouvrir un compte

Les signaux apparaissent dans le graphique principal et sont identifiables par le fond d'écran **grisé**

Il ont comme origine les signaux produits par le **graphique HA** de la sous-fenêtre

L'**agrégation** du graphique HA **réduit** le nombre de signaux et **améliore** leur qualité

Cliquez-droit sur le libellé pour **modifier** l'agrégation



- Les signaux HA sont définis par une **combinaison** de bougies sélectionnable par le trader dans la sous-fenêtre grâce aux deux paramètres suivants:
 - le nombre de bougies de la dernière tendance = 2
 - le nombre de bougies de la nouvelle tendance = 1

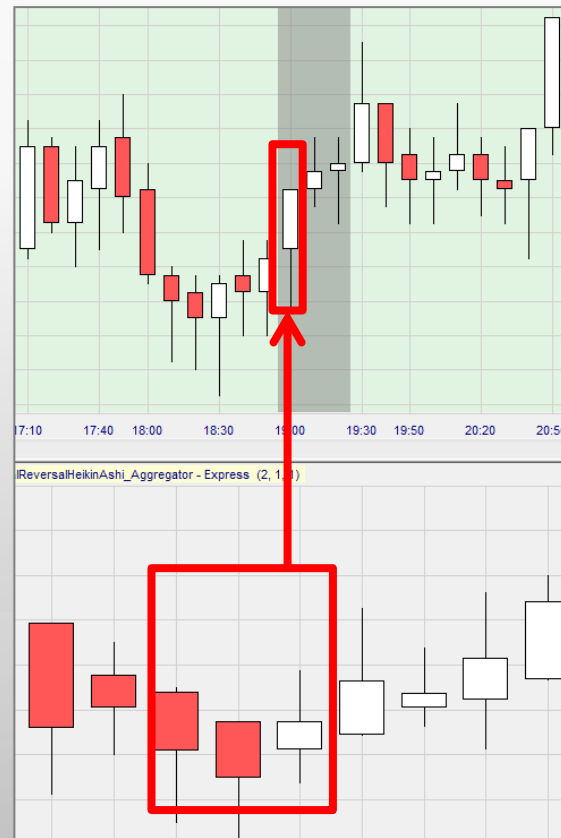


- Le 3^{ème} paramètre du signal HA permet de définir le **nombre minimum de bougies** avant une entrée en position:

SignalReversalHeiki...	2, 1, 1
nBarsOldTrend	2
nBarsNewTrend	1
nMinBarEarlySignal	1

- Si l'agrégation est 3 et le nombre minimum de bougies est 1, alors le signal HA sera déclenché à la clôture de la 1^{ère} bougie, comme dans cet exemple

- En mode **back test**, il faut que le nombre minimum de bougies **soit égal** à l'agrégation du graphique HA. Sinon, les résultats des back tests seront faux



- Plage horaire: 18h–24h

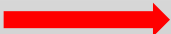
Seuls les signaux à l'intérieur de la plage horaire sont affichés

- 3 types d'alerte peuvent être activés: message, son, email

Envoi d'emails:

Entrez votre adresse email dans Extras / Options / Adresse email pour message



- Pourquoi s'intéresser aux obligations?
- A quelles heures sont-elles les plus volatiles?
- Trader les obligations est moins cher avec les futures qu'avec les CFDs
- Qu'est ce qu'un graphique Heikin Ashi?
- Le signal Heikin Ashi et ses 3 avantages
-  ■ Exemple de stratégie Heikin Ashi sur le Bund
- Ouvrir un compte

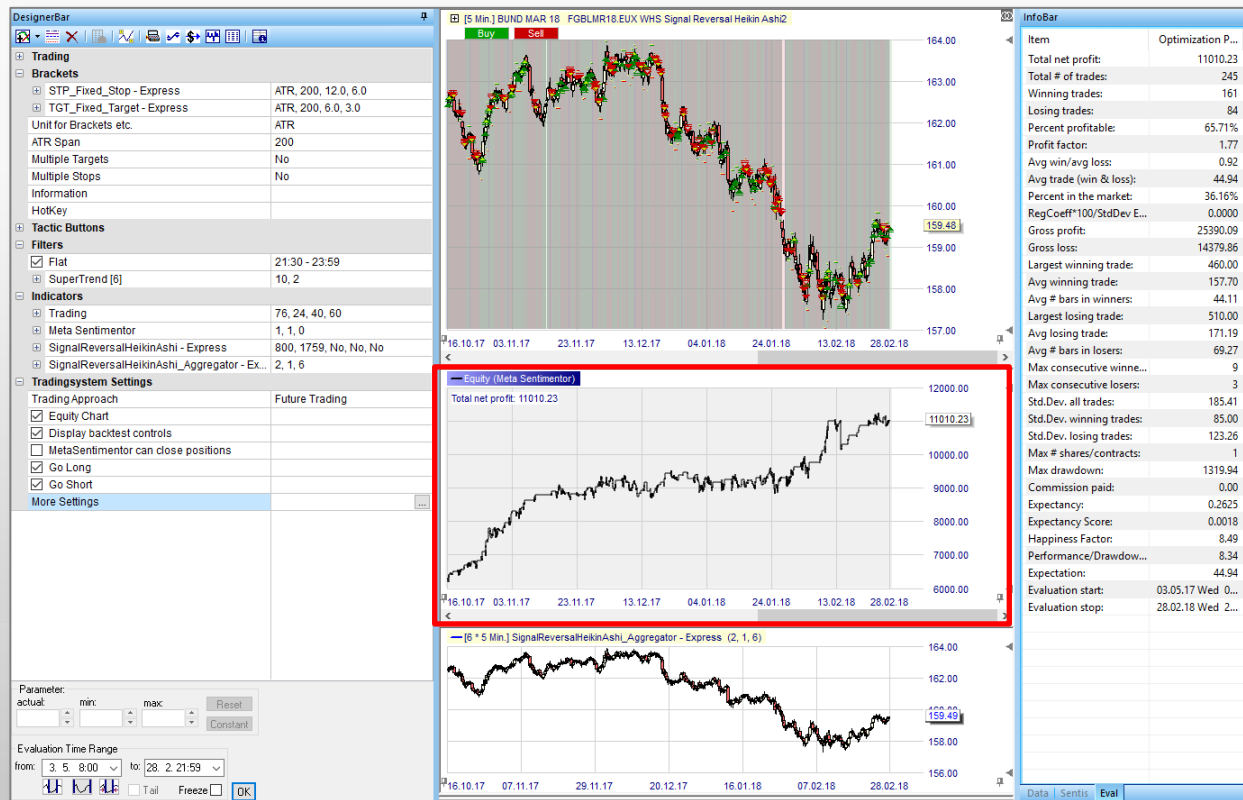
- Graphe 5 mn
- 08:00 – 17:59
- Stop et objectif fixes
- Filtre flat 21:00
- Signal HA:
 - agrégé 6x
 - combinaison 2,1
- Filtre de tendance:
 - SuperTrend 10,2
 - agrégé 6x




Bien sûr, on ne sait pas si elle continuera de performer

On peut l'adapter à d'autres futures sur obligations, à condition de trouver le bon réglage!

Elle peut aussi servir de base à une stratégie semi-automatique: entrée automatique et gestion manuelle de la position



- Pourquoi s'intéresser aux obligations?
- A quelles heures sont-elles les plus volatiles?
- Trader les obligations est moins cher avec les futures qu'avec les CFDs
- Qu'est ce qu'un graphique Heikin Ashi?
- Le signal Heikin Ashi et ses 3 avantages
- Exemple de stratégie Heikin Ashi sur le Bund
-  ■ Ouvrir un compte



N°1 SERVICE CLIENT

N°1 PLATEFORME

N°1 EDUCATION

- Plateforme de trading puissante: **NanoTrader**
- Adaptée au **scalping**, **day** trading et **swing** trading
- 50+ **stratégies**, 10 **signaux**, 200+ **indicateurs**, 50+ **stops** et **filtres** ...
- **Formations** sur la mise en œuvre de stratégies, **automatisables** ou non, dans NanoTrader ... accessibles sur Youtube/WHS FR
- **Devenez client de WHS pour devenir un meilleur trader!**