MACD : simple différence entre deux moyennes exponentielles rapides et lentes (12 et 26 généralement)

Awesome osxillator : simple différence entre deux moyennes simple rapides et lentes (5 et 34 généralement)

ADX par defaut window = 14

|  |  |
| --- | --- |
| **ADX Value** | **Trend Strength** |
| 0-25 | Absent or Weak Trend |
| 25-50 | Strong Trend |
| 50-75 | Very Strong Trend |
| 75-100 | Extremely Strong Trend |
|  |  |

On considère <20 comme peu volatile et >25 comme volatile

Qd on augmente la window, devient plus selectif, moins de points sont considérés comme vo :;latiles

RSI 20 80 les limites, oscillateur de force d’achat et de vente

Stoch rsi 0.2 et 0.8

Williams R -80 oversold et -20 overbought a quel pourcentage du prix

L'indicateur indique au trader où le prix actuel est par rapport au plus haut des 14 dernières période

CCI

Le CCI repose sur le principe que le cours d’une valeur évolue selon deux configurations distinctes : les zones de tendance et les zones de congestion.  
Généralement on assiste à une augmentation de la volatilité lorsqu’une valeur sort d’une zone de congestion et entame un mouvement directionnel (tendance). Cette hausse de volatilité peut être mesurée par un éloignement des cours par rapport à leur moyenne mobile.

Lorsque l’indicateur fluctue entre +100 et -100, nous sommes dans une phase de congestion. Lorsque l’indicateur évolue dans sa zone d’achat (au dessus de +100), nous sommes en présence d’une tendance haussière sur la valeur.  
Inversement nous sommes en présence d’une tendance baissière, lorsque les cours évoluent dans sa zone de vente (en dessous de -100).

Pvo comme macd mais suyr le volume

Ajouter supertrend, vix

<https://pythonrepo.com/repo/bukosabino-ta-python-finance>

formulaic alphas

<https://arxiv.org/ftp/arxiv/papers/1601/1601.00991.pdf>

outliers

https://github.com/stefan-jansen/machine-learning-for-trading/blob/main/24\_alpha\_factor\_library/01\_sample\_selection.ipynb

faire des tests avec adj close aussi

CAC 40 comparaison

Euronext

Variables, modes de calcul, utilité