

## Recherche Expérimentale sur l'indicateur Momentum en trading

### Indicateur Momentum, Etude du niveau 100.5 en trading automatisé

#### Sur la paire forex EUR/USD

Par InvestdataSystems (Reuniware / Fintech OpenSource Projects sur GitHub)

<https://ichimoku-expert.blogspot.com>

<https://finance-conseil.blogspot.com>

<https://investdata.000webhostapp.com>

### Test initial d'une stratégie de trading automatisée basée uniquement sur le momentum

#### Test T1

Sans stoploss, avec prise de position à l'achat (long/buy) dès que le momentum passe de sous 100.5 à au-dessus de ou égal à 100.5 (sans tester le passage par 100.5) :

Backtest en unité de temps H1 avec takeprofit = prix d'achat + spread + 0.00100

Avec un spread initial d'environ 8 points (0.00008) sur la plateforme Darwinex

Dates du backtest du 01/01/2017 au 19/10/2017

Ouverture d'une position si aucune position n'est en cours

Solde initial de **10000**, solde au 08/10/2017 de **13657.42** (toutes positions fermées).

93 ordres d'achats (et 93 atteintes de takeprofit) sur 9 mois et demi.

Environ 10 ordres par mois en moyenne, **bénéfice de 36.57%**

#### Test T2

En augmentant le takeprofit = prix d'achat + spread (0.00008) + 0.00150

Donc en augmentant le risque par rapport au test T1 précédent

Au 08/09/2017, toutes positions fermées, solde de **14591.41**

**Bénéfice de 45.91%**

#### Test T3

En augmentant encore le takeprofit par rapport au test T2, avec  $tp = pa + s (0.00008) + 0.00200$

Donc en augmentant encore le risque par rapport au test T2 précédent

Au 08/09/2017, toutes positions fermées, solde = 14672.90

Soit un **bénéfice de 46.72%**

#### Test T4

En augmentant encore le takeprofit par rapport au test T3, avec  $tp = pa + s + 0.00300$

Au 08/09/2017, toutes positions fermées, solde = 15242.54

Soit un **bénéfice de 52.42%**

Est-il possible, en backtest d'obtenir mieux que ça ? Jusque là, l'unité de temps utilisée pour le backtest est H1, avec un calcul du momentum effectué aussi en H1. Le momentum, tout comme le RSI par exemple, n'est pas le même selon l'unité de temps utilisée. Voyons voir ce que ce même test T4 donne comme résultat si on effectue le backtest sur une unité de temps 15 minutes.

#### Test T5

Unité de temps 15m et tous les autres paramètres identiques à ceux du test T4

Au 08/09/2017, toutes positions fermées, solde = 12208.49

Soit un **bénéfice de 22.08%**

#### Test T6

Unité de temps 4H et tous les autres paramètres identiques à ceux du test T4

Au 19/09/2017, toutes positions fermées, solde = 16875.61

Avec un nombre de trades de 51

Et donc un **bénéfice de 68.75%**