

Explications Turtle Trading

Tien-Thinh

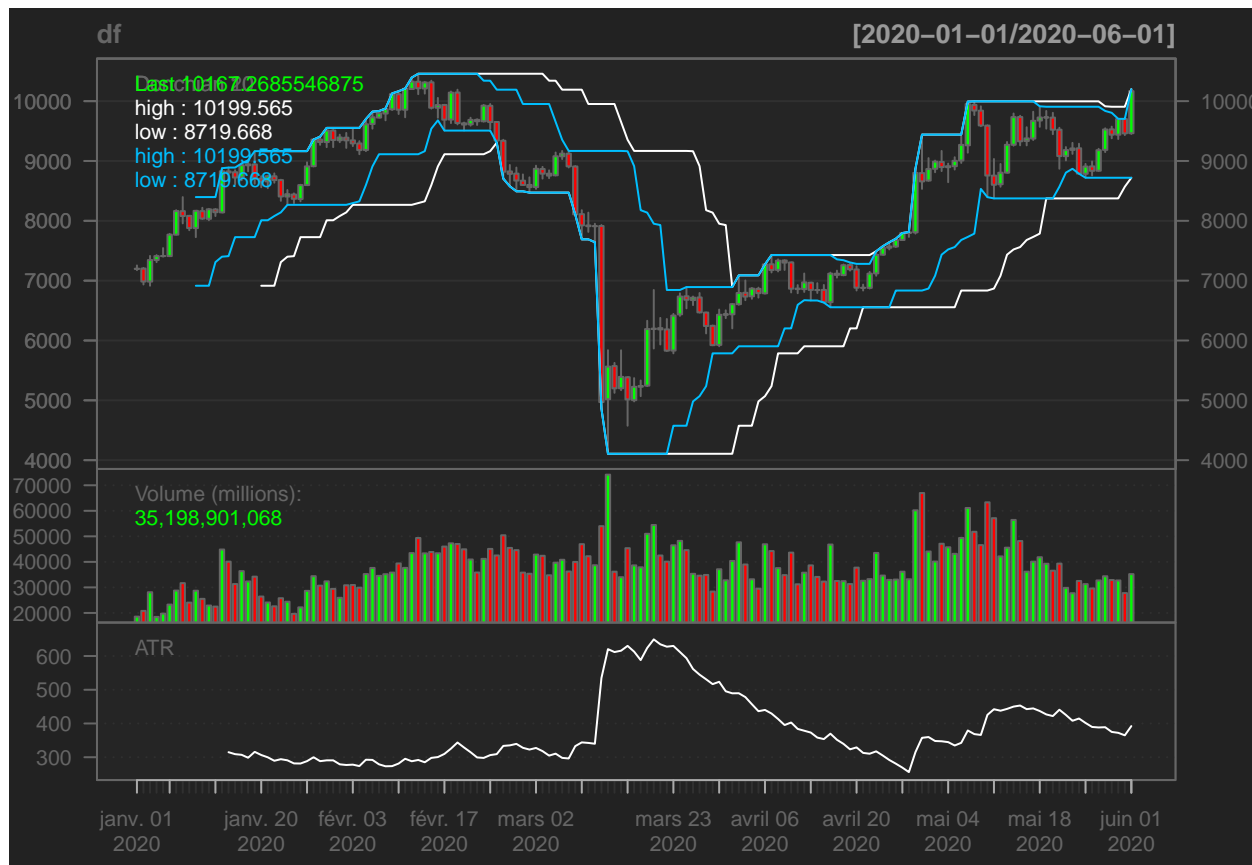
2023-04-22

Importation des données

Nous utilisons les données *BTC – USD* de *quantmod*.

Et pour appliquer la stratégie Turtle nous ajoutons :

- Les Chaines de Donchian 20 jours (blanc, signal d'ouverture)
- Les Chaines de Donchian 10 jours (bleu, signal de clôture)
- L'Average True Range (ATR) 10 jours



Création des ordres

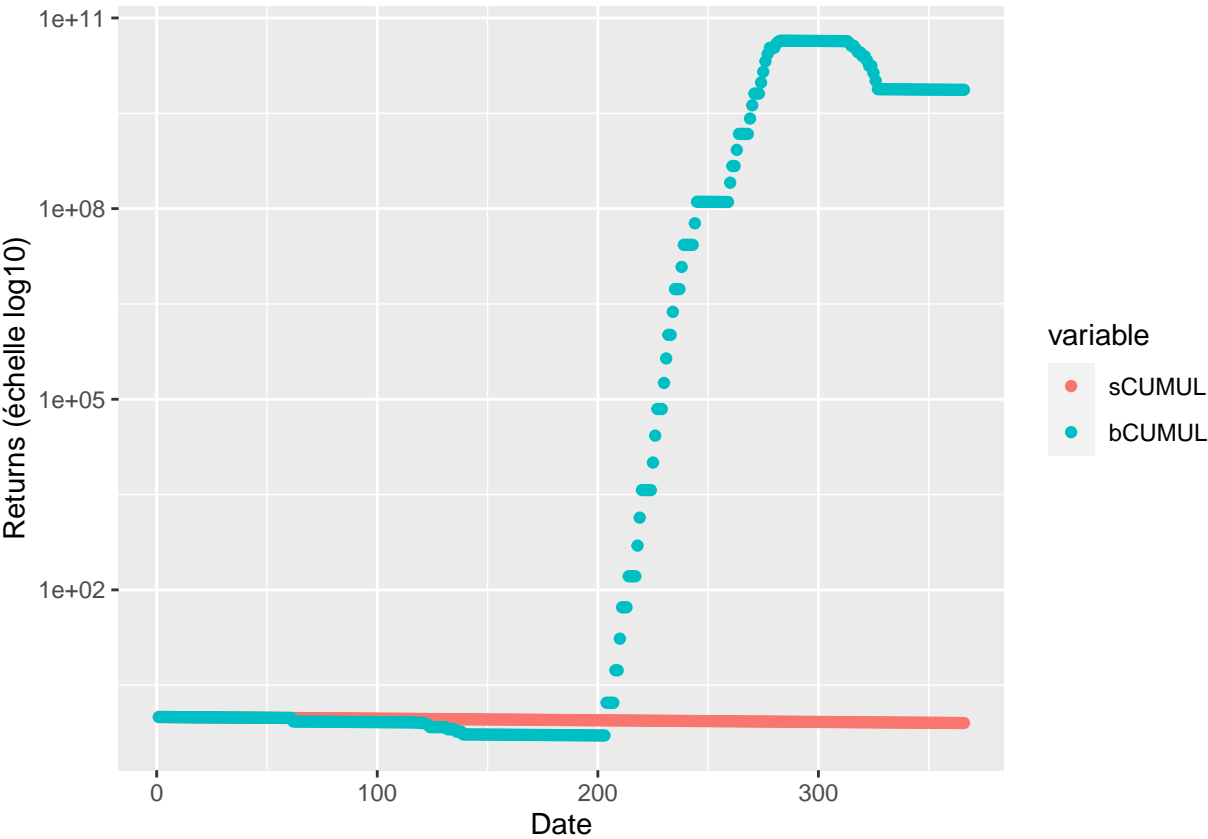
Nous travaillons sur les données entre janvier 2020 et janvier 2023.

```
## [1] "Au total 54 BUY"
```

```
## [1] "Au total 3 BUY distinct"
```

```
## [1] "Au total 0 SELL"
## [1] "Au total 0 SELL distinct"
```

Gains potentiels



x
Profit : 0.802786959178728
Profit : 7398744275.49458

Durée des trades

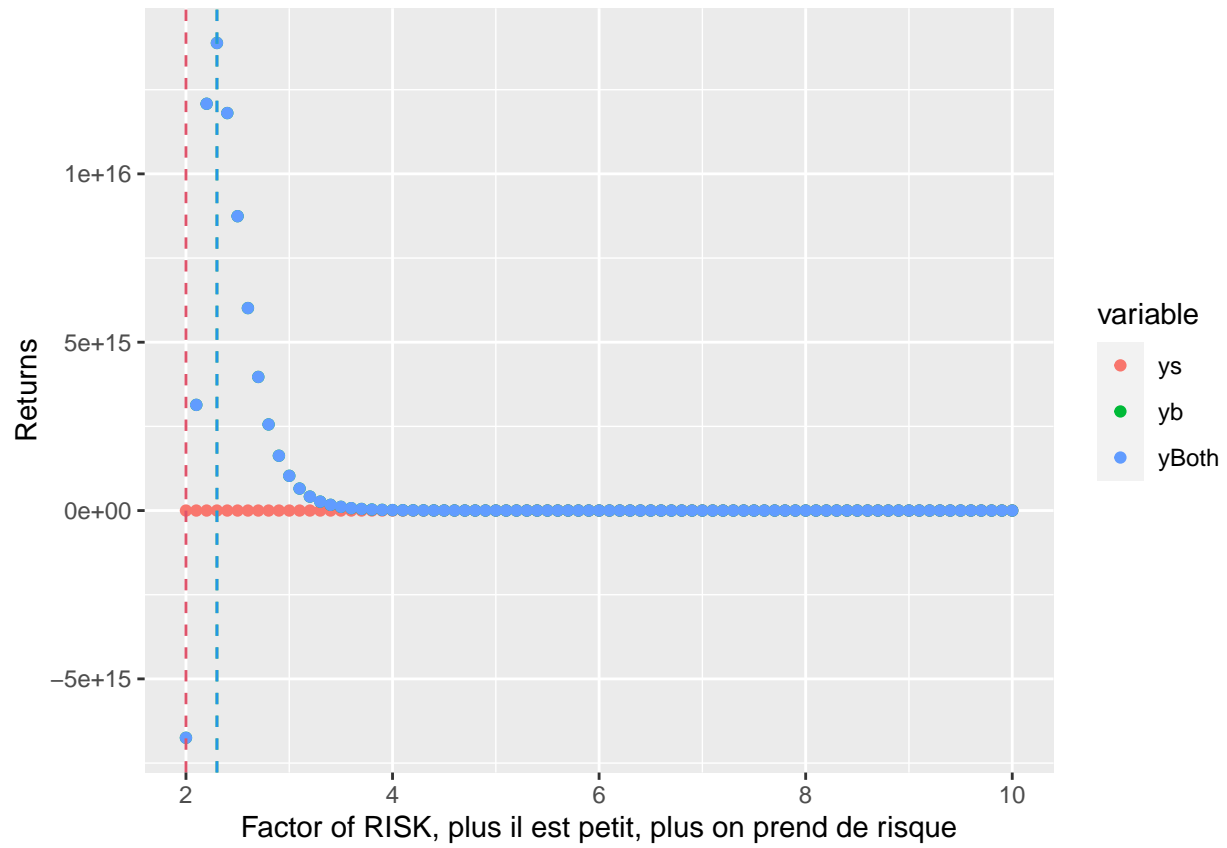
meanDuraSELL	minDuraSELL	maxDuraSELL	meanDuraBUY	minDuraBUY	maxDuraBUY
NaN	Inf	-Inf	63.2963	7	130

Nombre de trade simultanés

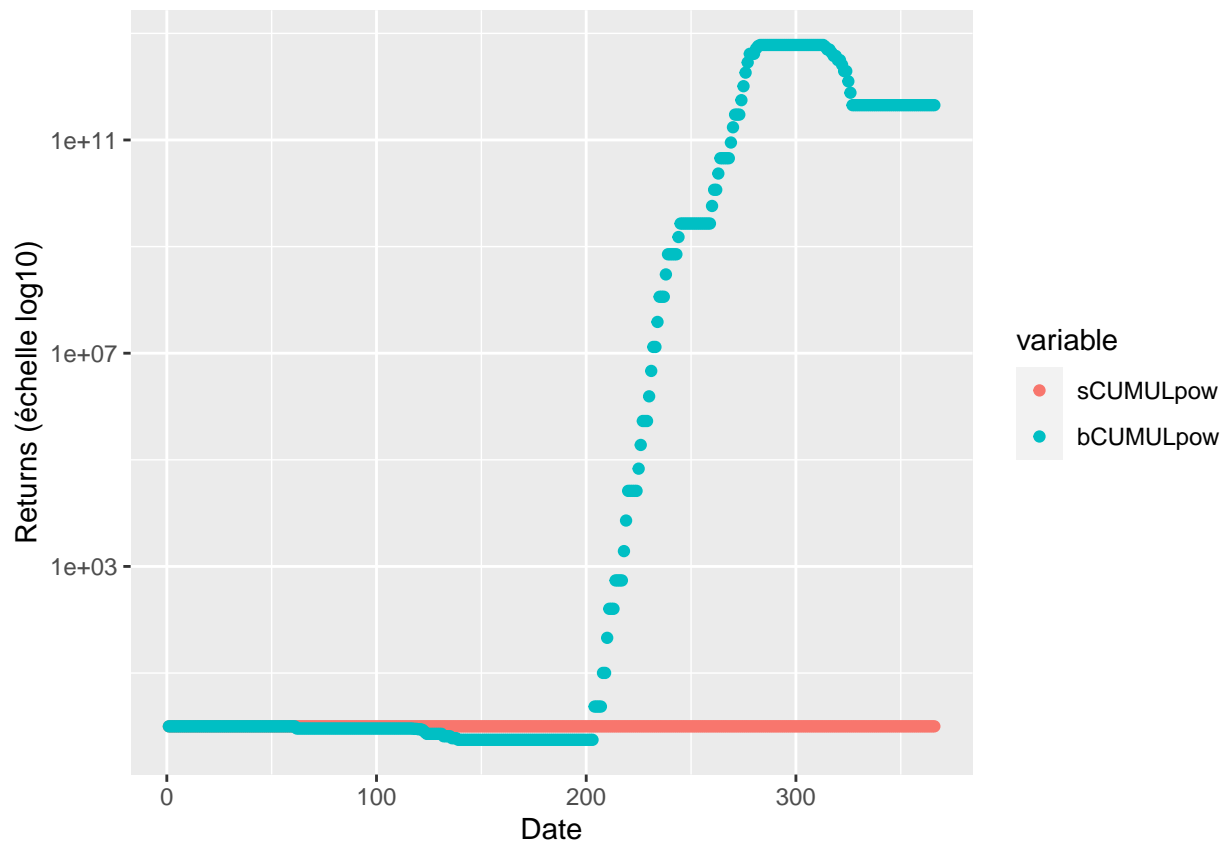
bMean	bMedian	bMax	bMin
18	8	45	1

sMean	sMedian	sMax	sMin
NaN	NA	-Inf	Inf

Choix du meilleur facteur risk 3



Gain potentiel à facteur risk 3



x

Profit : 1

Profit : 449978318069.869

Gain trade Unique

Gain trade simultanés additionnés

Alpha convexité

Perte maximale à supporter