

Intérêt de l'indicateur graphique Heikin Ashi

Approche 2

Graphique bougies



Graphique Heikin Ashi

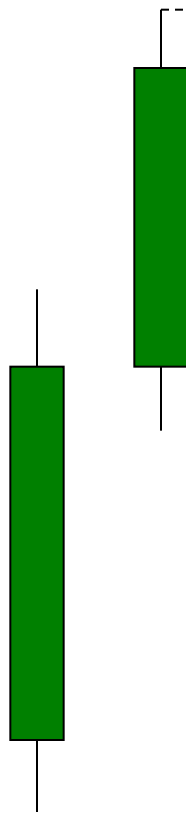


- Il identifie les tendances en les coloriant
- Il détecte les renversements de tendance en changeant de couleur
- Il s'applique à tout instrument, tout intervalle de temps

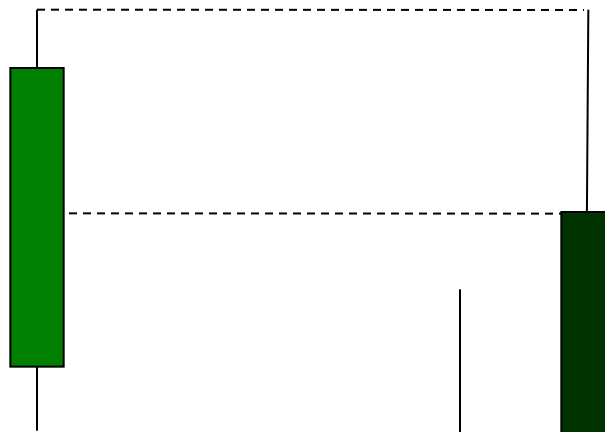
Formation d'une bougie sur Heikin Ashi

Approche 2

Graphique bougies

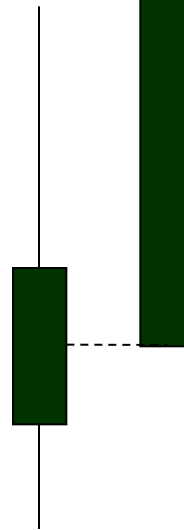


t-1



t

Graphique Heikin Ashi



t-1



t

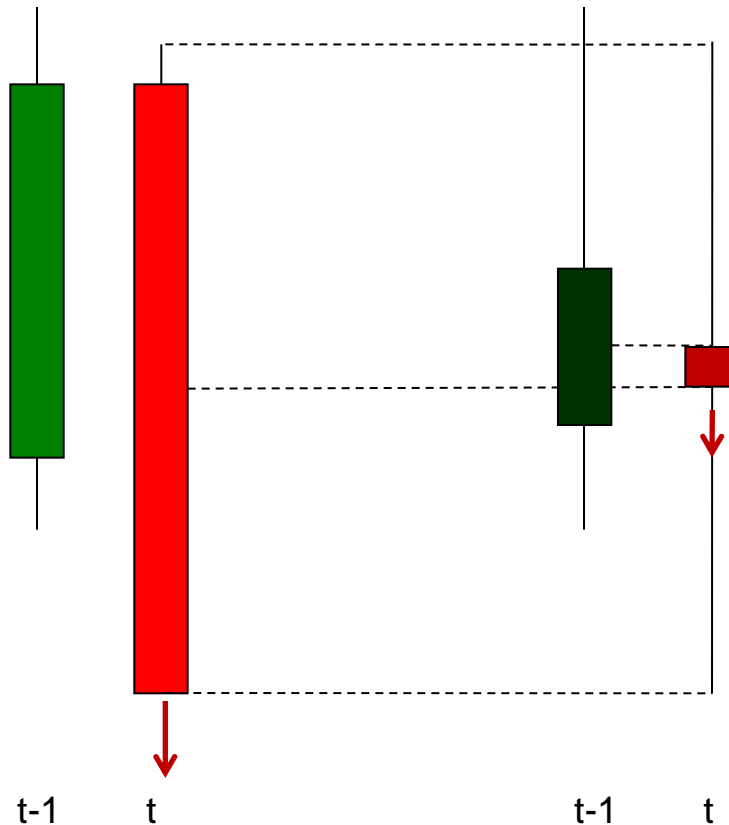
$$xH_t = \max(H_t, xO_t, xC_t)$$

$$xC_t = (O_t + H_t + L_t + C_t)/4$$

$$xO_t = (xO_{t-1} + xC_{t-1})/2$$

$$xL_t = \min(L_t, xO_t, xC_t)$$

Graphique bougies



Graphique Heikin Ashi

Règle:

Pour qu'une bougie Heikin Ashi change de couleur, il faut qu'il y ait, sur le graphique bougies, un très grand mouvement opposé au sens de la bougie précédente.

Approche 2

Une approche basée sur Heikin Ashi

Principes

- On utilise deux charts Heikin Ashi
- On choisit deux périodes de temps différentes
- Le 1^{er} chart Heikin Ashi est utilisé comme filtre (période longue)
- Le 2^{ième} chart Heikin Ashi génère des signaux d'achat et de vente (période courte)
- On utilise un stop basé sur le plus bas ou le plus haut d'un nombre donné de bougies

Renversement de tendance

- Si au moins deux bougies consécutives changent de couleur
- Tant que Heikin Ashi alterne entre rouge et vert, il n'y a pas de signaux



Chart HA n°1: Filtre hebdomadaire

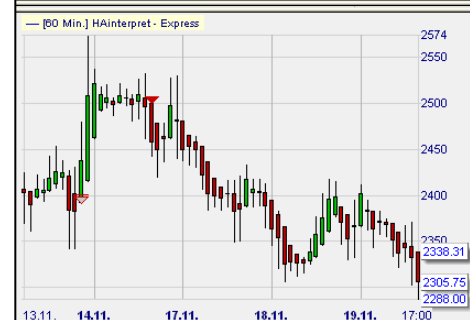
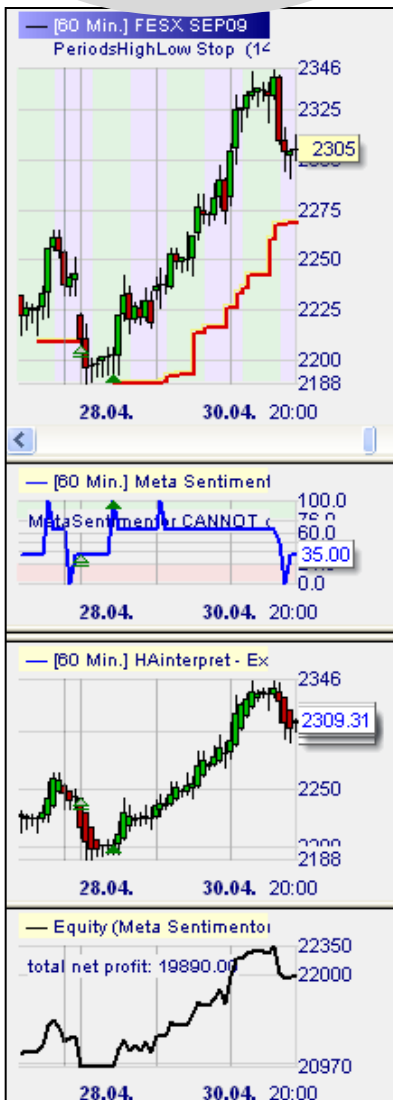


Chart HA n°2: Générateur de signaux

Test réalisé sur le future EuroStoxx50

Approche 2

- Les résultats sont intéressants
- Ils mettent en évidence l'intérêt de l'indicateur Heikin Ashi pour identifier des tendances et des renversements de tendance
- Attention: rien ne garantit que ces résultats s'appliquent à une période plus longue ou qu'ils se reproduiront dans le future



Données

Instrument	EuroStoxx50
Chart HA1	1 h
Chart HA2	5 x14x1 hrs
Stop H/B	14
Filtres Bloc	08-11h, 18-22h
Unité temps	1 h
Période	26/09/09 – 04/09/2009

Statistiques

Item	Optimization ...
total net profit:	19790.00
total # of trades:	293
winning trades:	107
losing trades:	184
percent profitable:	36.52%
profit factor:	1.48
avg win/avg loss:	2.54
Avg trade (win & loss):	67.54
percent in the market:	52.25%
RegCoeff*100/StdDev E...	-0.0000
gross profit:	61290.00
gross loss:	41500.00
largest winning trade:	3560.00
max drawdown:	4360.00

P/L cumulé*



WHS FutureStation
* Hors commissions

WHS FutureStation