

ChartNet.nl

Marktanalyse

1.01d

SYNOPSIS

ChartNet Marktanalyse presentatie.....	2
ProScreener commando's.....	3
Stock picking (aandelen uitkiezen).....	3
Top movers.....	4
Geextrapoleerde volumes.....	6
Dynamicsche verandering van de time unit.....	7
Gebruik van een van index- en valuta-koers.....	8
Instellingen.....	9
Resultaten.....	10
.....	10
Eenvoudige voorbeelden.....	11
RSI uurbasis: oversold.....	11
RSI uurbasis : overbought.....	13
Bullish moving average crossing over.....	15
Bearish moving average crossing over.....	16
Meest krachtige voorbeelden.....	17
RSI en bullish reversal.....	17
RSI en bearish reversal.....	18
Bullish engulfing.....	19
Bearish engulfing.....	20

ChartNet Marktanalyse presentatie

ChartNet Marktanalyse is de screening module van ChartNet. Het is een uitbreiding op de IBuilder taal.

ChartNet Marktanalyse is een BASIC-achtige taal waarmee u condities kunt bouwen die worden toegepast op alle aandelen van een markt of submarkt. U kunt daarmee uw eigen systemen maken gebruik makend van de koersen die door ChartNet worden verstrekt:

- Openings koers van elke bar/candle
- Slot koers van elke bar/candle
- Hoogste koers van elke bar/candle
- Laagste koers van elke bar/candle
- Volume van elke bar/candle

Beschikbare zijn de 128 meest recente bars, in verschillende periodes:

- 5 minuten
- 10 minuten
- 15 minuten
- 30 minuten
- uur
- 2 uren
- 3 uren
- 4 uren
- dag
- week

Conditie geschreven met de iBuilder taal worden door het systeem gebruikt om een lijst met de beste aan de criteria voldoende aandelen samen te stellen. U kunt zelfs criteria gebruiken op basis van uw zelfgebouwde indicatoren.

Alle condities worden real time gescreend ten opzichte van de meeste recente bar. Dat is uiteraard de huidige bar als de markt open is.

ProScreener commando's

Stock picking (aandelen uitkiezen)

SCREENER

SCREENER[conditie]

Het eerste doel van ChartNet marktanalyse bestaat uit het controleren van de condities van alle aandelen van een markt om degene die aan bepaalde criteria voldoen te kunnen weergeven.

Bij voorbeeld, het kan nuttig zijn om alle aandelen te vinden met een RSI >70. Dit is een veelvoorkomend criterium in de technische analyse. U kunt deze conditie eenvoudig schrijven dankzij ChartNet Marktanalyse

Voorbeeld SCREENER, RSI

```
REM Pick the stocks that have RSI > 70
```

```
SCREENER [RSI > 70]
```

You can also combine your conditions using the advanced functionalities of the ProBuilder language.

Voorbeeld SCREENER, RSI, STOCHASTIC, WILLIAMS

```
REM Pick the stocks that have RSI > 70
```

```
Filter1 = RSI > 70
```

```
REM and that have Stochastic > 80
```

```
Filter2 = STOCHASTIC > 80
```

```
REM and that have Williams %R > -50
```

```
Filter3 = WILLIAMS > -50
```

```
REM Combine these conditions :
```

```
SCREENER [Filter1 AND Filter2 AND Filter3]
```

Opmerking

De condities kunnen worden weggelaten. In dit geval worden geen aandelen uitgekozen, maar gesorteerd volgens een bepaald criterium. De volgende onderdeel legt deze functionaliteit uit.

Top movers

SCREENER

SCREENER[condition] **SORT BY** sorting criterion
SCREENER[condition](sorting criterion)

U kunt uw eigen « top movers » bouwen ; het enige dat u hoeft te doen is het schrijven van een sorteer criterium, wat bijvoorbeeld een indicator zou kunnen zijn.

We nemen als voorbeeld de RSI. Laten we kijken hoe eenvoudig het is om een ranking te bouwen op basis van deze indicator.

Voorbeeld SCREENER, RSI

REM Sorting criterion : RSI

SCREENER SORT BY RSI AS «RSI»

U hoeft alleen het sorteer criterium in te voeren en u kunt het benoemen met behulp van de bestaande iBuilder term **AS**

Uiteraard kunt u ook alleen kiezen voor de aandelen met een RSI >70.

Voorbeeld SCREENER, RSI

REM Sorting criterion : RSI

SCREENER [RSI > 70] SORT BY RSI AS «RSI»

De kracht van de iBuilder taal stelt u in staat om uw eigen criteria te bouwen. Laten we als voorbeeld eens kijken hoe we de 50grootste stijgers er uit kunnen halen op basis van de laatste 50 bars.

Voorbeeld SCREENER, LOWEST

REM Determine the lowest quote on the last 50 bars

lowerPoint = **LOWEST**[50](**LOW**)

REM Compute the increase of prices from this point to now

Advance = **CLOSE** * 100 / lowerPoint

REM Sorting criterion: RSI

SCREENER (Advance **AS** «Advance»)

Daarna kiest u voor het sorteren op hoogste of laagste waarden. Dit soort instellingen zijn niet geschreven in de iBuilder taal, maar zijn beschikbaar in het ChartNet marktanalyse venster. In het volgende onderdeel leggen we dit uit.

Geextrapoleerde volumes

ESTIMATEDVOLUME

ESTIMATEDVOLUME

U kunt al anticiperen op het volume van een bar voordat hij wordt afgesloten. Dit commando is zeer nuttig om bijvoorbeeld topaandelen gebaseerd op de variatie in volumes er uit te pikken.

Exemple ESTIMATEDVOLUME

REM Computes the theoretical volume of the current day

Vol0 = **ESTIMATEDVOLUME**

REM Get the volume of the day before

Vol1 = **VOLUME**[1]

REM Sorting criterion: variation of volume

SCREENER (Vol0 / Vol1 **AS** «Volume»)

Dynamicsche verandering van de time unit

TIMEFRAME

U kunt de time units waarop berekeningen zijn gemaakt dynamisch veranderen om condities te combineren in meerdere time units.

TIMEFRAME(default)

Dit is de time unit gedefinieerd in het selecteer vak van ChartNet Marktanalyse.

TIMEFRAME(1 minute|2 minutes|3 minutes|5 minutes|10 minutes|15 minutes|30 minutes)

TIMEFRAME(1 hour | 2 hours | 3 hours | 4 hours)

TIMEFRAME(daily | weekly)

De commando's dwingen de time unit stot het gebruik van de volgende commando's
Laten we kijken naar het volgende voorbeeld.

Voorbeeld TIMEFRAME

```
REM The following is computed in weekly
```

```
TIMEFRAME(WEEKLY)
```

```
REM Condition C1 : close > 20 week moving average
```

```
C1 = CLOSE > AVERAGE[20]
```

```
REM The following is computed in daily
```

```
TIMEFRAME(DAILY)
```

```
REM Condition C2 : close < 20 days moving average
```

```
C2 = CLOSE < AVERAGE[20]
```

```
REM Sorting criterion : C1 & C2
```

```
SCREENER [c1 AND c2]
```

Gebruik van een van index- en valuta-koers

EQUITYFRAME

EQUITYFRAME("market", "ticker")

U kunt ook dat laden van een index of valuta om deze te vergelijken met alle aandelen van een markt. U kunt bijvoorbeeld de topstocks van de « béta » bouwen.

EQUITYFRAME(DEFAULT)

Dit is het op dit moment gescande aandeel. In het voorbeeld geven we een voorbeeld :

Voorbeeld EQUITYFRAME

REM The following is computed on the current scanned stock

EQUITYFRAME(DEFAULT)

REM Get the rate of change

rdtSTK = **ROC**

REM The following is computed on the french index CAC40

EQUITYFRAME(« Euronext Paris », « CAC »)

REM Get the rate of change on the french index CAC40

rdtCAC = **ROC**

REM Calculate the beta between the current stock and the french index CAC40

Beta = **AVERAGE**(rdtSTK * rdtCAC) – **AVERAGE**(rdtSTK) * **AVERAGE**(rdtCAC)

Beta = Beta / **SQUARE**(STD(rdtCAC))

REM Sorting criterion: Beta

SCREENER (Beta)

Instellingen

U kunt eenvoudig alle parameters definiëren:

- Markt of groep aandelen vak n°2).
- Periode van data (vak n°3)
- Sorteervolgorde (vak n°4).

The screenshot shows the 'ChartNet Markt Analyse' window with the 'Programmeren' tab selected. The window title is 'ChartNet Markt Analyse' and the market name is 'Bullish engulging'. The interface is divided into several sections:

- 1 - Programmeer de Markt Analyse:** Contains a text area with the following code:

```
REM Compute the power of the bearish trend
// Find the highest quote on the last 8 bars
HighPoint = HIGHEST[8](HIGH)

// Compute the variation of price from this point to now
Decline = HighPoint - CLOSE

// Compute the usual volatility of the stock (median of True Range)
Norm = SUMMATION[3](TR) - HIGHEST[3](TR) - LOWEST[3](TR)

REM Stock picking: only the bullish engulging
Filter = CLOSE[1] < OPEN[1] AND OPEN < CLOSE[1] AND CLOSE > OPEN[1]

REM We keep the most serious declines
SCREENER [ Filter ] (Decline / Norm AS "Trend Power" )
```
- 2 - Markt selectie:** A dropdown menu showing 'NASDAQ'.
- 3 - Periode selectie:** A dropdown menu showing '15 Minuten'.
- 4 - Criterium selectie:** Two radio buttons: 'Toon hoogste waarden' (selected) and 'Toon laagste waarden'.
- 5 - Toon Markt Analyse:** A checkbox 'Laat dit venster open na validatie' is checked. Below it are 'Valideer programma' and 'Annuleren' buttons.
- Toon de code aan andere gebruikers:** Three checkboxes: 'Plaats deze Markt Analyse op het ChartNet Forum.', 'Verberg de code voor andere gebruikers', and 'Beveilig de code met een paswoord:' followed by a password input field.

Resultaten

Tenslotte. Klik op de "OK" knop en een venster verschijnt met de resultaten van ChartNet Marktanalyse

Dit is een reeks aandelen en een text veld die het aantal aandelen aangeeft dat voldoet aan de gestelde criteria. Dit aantal is belangrijk omdat ChartNet Marktanalyse nooit meer dan 30 aandelen toont, zelfs als er veel meer aandelen aan de condities voldoen. U ziet dus alleen de aandelen die het beste voldoen aan de gestelde sorteer criteria

De waarde van dit criterium wordt weer gegeven in de laatste kolom en de naam is wordt gegenereerd door het gebruik van het keyword AS van de iBuilder taal. Hier hebben we een sortering op Hoogste waarden. Maar, onthoudt dat deze "top movers" even krachtig zijn als de andere "top movers" in ChartNet. U kunt dus op elke kolom sorteren.

Zoals u kunt zien worden de aandelen real time en tick by tick ververst

	NAAM	LAATS	%	VOLUM	LAAG	HOOG	OPEN	VORIG	MONEY	Trend Pt
	Capital Title Group.	5,55(c)	+2,02%	69174	5,37	5,65	5,40	5,44	383915	2,50
	Waste Services, In	3,64(c)	-0,55%	89017	3,58	3,73	3,65	3,66	324021	2,00
	Alto Palermo S.A.	9,39(c)	+5,86%	13522	8,96	9,92	8,96	8,87	126971	1,51
	Chronimed, Inc.	6,94(c)	-0,72%	11273	6,88	7,00	6,95	6,99	78234	1,50
	Spectrum Pharmac	6,32(c)	-0,32%	15538	6,26	6,41	6,31	6,34	98200	1,39
	AFC Enterprises.	26,33(c)	+1,35%	152249	25,51	26,84	25,66	25,98	4008K	1,00
	Gentiva Health Ser	16,88(c)	+1,69%	174412	16,70	16,94	16,71	16,60	2944K	1,00
	Smith & Wollensky	5,02(c)	+0,60%	9785	4,85	5,13	5,00	4,99	49120	0,74
	Infosys Technologi	68,85(c)	+2,46%	255028	66,93	69,02	67,82	67,20	17,6M	0,61
	SIGA Technologies	1,63(c)	+3,82%	43000	1,57	1,65	1,57	1,57	70090	0,50
	DENTSPLY Internat	57,72(c)	+2,07%	126210	56,17	57,78	56,29	56,55	7284K	0,46
	Hansen Natural Co	45,89(c)	+3,17%	128330	44,52	45,96	44,67	44,48	5889K	0,35
	IONA Technologies	5,75(c)	+2,31%	167568	5,50	5,77	5,70	5,62	963516	0,25
	WORLD HEART CO	1,89(c)	-2,58%	99723	1,66	1,91	1,90	1,94	188476	0,25
	KMart Holding Corp	103,93(c)	+3,93%	861341	99,45	104,05	99,70	100,00	89,5M	0,23

Eenvoudige voorbeelden

RSI uurbasis: oversold

Omschrijving

RSI is een indicator die oversold en overbought kan aangeven. Dit kan een trend omslag aankondigen. In dit voorbeeld willen we alle oversold aandelen er uit pikken.

“Oversold” is gedefinieerd als **RSI < 30**.

We willen nu een scan maken die alle aandelen opleverd waarvan de **RSI < 30** en we willen degenen zien die de laagste waarden hebben.

Voorbeeld RSI : oversold

```
REM Calculate the RSI indicator on 14 hourly bars
```

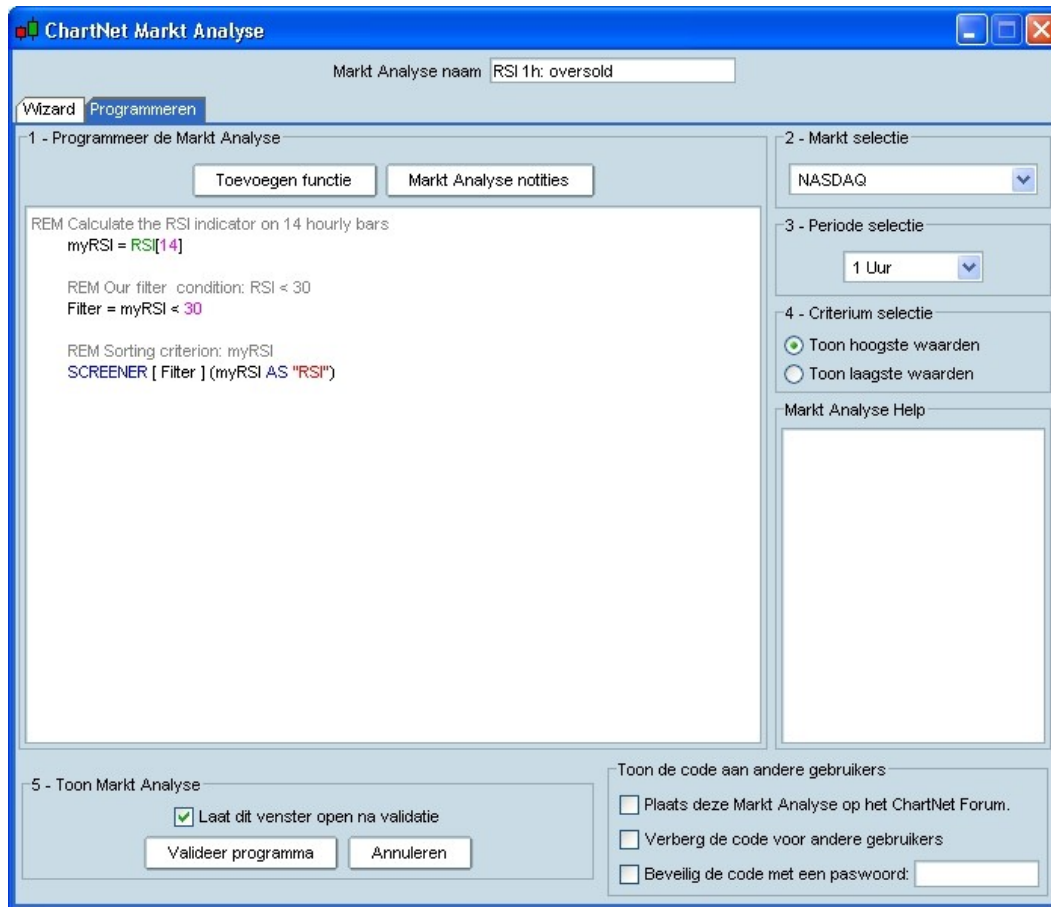
```
myRSI = RSI[14]
```

```
REM Our filter condition: RSI < 30
```

```
Filter = myRSI < 30
```

```
REM Sorting criterion: myRSI
```

```
SCREENER [ Filter ] (myRSI AS «RSI»)
```



RSI uurbasis : overbought

Omschrijving

RSI is een indicator die oversold en overbought kan aangeven. Dit kan een trend omslag aankondigen. In dit voorbeeld willen we alle oversold aandelen er uit pikken.

“Oversold” is gedefinieerd als **RSI > 70**.

We willen nu een scan maken die alle aandelen opleverd waarvan de **RSI > 70** en we willen degenen zien die de hoogste waarden hebben.

Voorbeeld RSI : overbought

```
REM Calculate the RSI indicator on 14 hourly bars
```

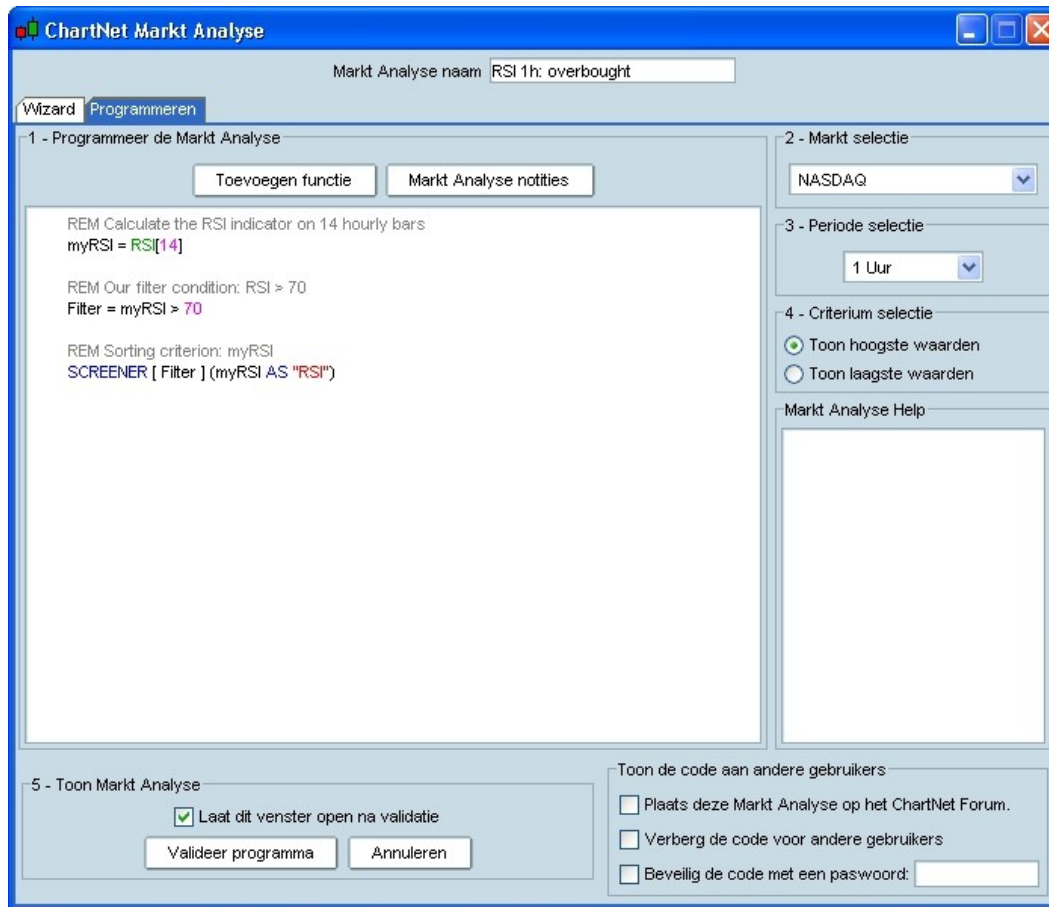
```
myRSI = RSI[14]
```

```
REM Our filter condition: RSI > 70
```

```
Filter = myRSI > 70
```

```
REM Sorting criterion: myRSI
```

```
SCREENER [ Filter ] (myRSI AS «RSI»)
```



Bullish moving average crossing over

Omschrijving

Het bullish moving average crossing over systeem is een van de meest bekendste. Het is gebaseerd op de waarneming dat een snelle moving average kruist over een langzame moving average wanneer een bullish trend begint.

We gaan in ChartNet Marktanalyse een marktanalyse bouwen die alle aandelen verzameld waarbij de MA20 over de MA50 kruist.

Verder willen we het momentum bepalen van het verschil tussen de twee moving averages om de kracht van de crossing te kunnen vaststellen. Als dit getal dicht bij 0 zit is de crossing traag en niet significant, maar hoe hoe hoger het getal, des te krachtiger is de de crossing.

Voorbeeld Bullish crossing over

```
REM Compute a simple moving average on the last 20 days
```

```
ma20 = AVERAGE[20]
```

```
REM Compute a simple moving average on the last 50 days
```

```
ma50 = AVERAGE[50]
```

```
REM Compute the differential speed between the short and the long moving averages
```

```
speed = MOMENTUM(ma50-ma20) * 100 / CLOSE
```

```
REM Select all the stocks on which that crossing over has just occurred
```

```
IF ma20 CROSSES OVER ma50 THEN
```

```
    SCREENER (speed AS «Speed»)
```

```
ENDIF
```

Bearish moving average crossing over

Omschrijving

Het bullish moving average crossing over systeem is een van de meest bekendste. Het is gebaseerd op de waarneming dat een snelle moving average kruist onder een langzame moving average wanneer een bearish trend begint.

We gaan in ChartNet Marktanalyse een marktanalyse bouwen die alle aandelen verzameld waarbij de MA20 onder de MA50 kruist.

Verder willen we het momentum bepalen van het verschil tussen de twee moving averages om de kracht van de crossing te kunnen vaststellen. Als dit getal dicht bij 0 zit is de crossing traag en niet significant, maar hoe hoe hoger het getal, des te krachtiger is de de crossing.

Voorbeeld Bearing crossing over

```
REM Compute a simple moving average on the last 20 days
```

```
ma20 = AVERAGE[20]
```

```
REM Compute a simple moving average on the last 50 days
```

```
ma50 = AVERAGE[50]
```

```
REM Compute the differential speed between the short and the long moving average
```

```
speed = MOMENTUM(ma20-ma50) * 100 / CLOSE
```

```
REM Select all the stocks on which that crossing over has just occurred
```

```
IF ma20 CROSSES UNDER ma50 THEN
```

```
    SCREENER (speed AS «Speed»)
```

```
ENDIF
```

Meest krachtige voorbeelden

RSI en bullish reversal

Omschrijving

Nu willen we het eenvoudige RSI systeem verbeteren om de aandelen die de beste technische configuratie hebben te laten stijgen.

Vroeger richtten analisten zich op een aantal indicatoren zoals de RSI zonder rekening te houden met al de karakteristieken van de technische situatie (omdat ze niet beter konden).

Nu zijn er, dankzij ChartNet Marktanalyse, geen beperkingen meer.. We zijn in staat om een zeer interessant systeem te bouwen op basis van de RSI. Het basis idee is eenvoudig: we willen de aandelen er uit filteren waarbij de RSI oversold staat, maar binnen een opwaartse trend.

Deze code kan in een regel iBuilder code worden geschreven:

```
Filter = RSI < 30 AND MOMENTUM[1](RSI) > 0
```

Nu sorteren we Aldus verkregen aandelen om alleen de meest interessante over te houden. Dit zijn diegene die grootste daling hebben gehad als we kijken naar hun normale volatiliteit. Het lijkt een eenvoudige voorwaarde, maar dit vereist serieus wat programmeerwerk. Maar schrik niet, met ChartNet Marktanalyse is dit erg eenvoudig te doen.

Voorbeeld RSI en bullish reversal

```
REM Filter the stocks on which RSI is oversold and in reversal
```

```
// Criterion: RSI < 30 and increasing
```

```
Filter = RSI < 30 AND MOMENTUM[1](RSI) > 0
```

```
REM Compute the power of the bearish trend
```

```
// Find the highest quote on the last 20 bars
```

```
HighPoint = HIGHEST[20](HIGH)
```

```
// Compute the variation of price from this point to now
```

```
Decline = HighPoint - CLOSE
```

```
// Compute the usual volatility of the stock (median of True Range)
```

```
Norm = SUMMATION[3](TR) - HIGHEST[3](TR) - LOWEST[3](TR)
```

```
REM We only keep the most serious declines
```

```
SCREENER [ Filter ] (Decline / Norm AS «Trend Power»)
```

RSI en bearish reversal

Omschrijvingf

Nu willen we het eenvoudige RSI systeem verbeteren om de aandelen die de beste technische configuratie hebben te laten stijgen.

Vroeger richtten analisten zich op een aantal indicatoren zoals de RSI zonder rekening te houden met al de karakteristieken van de technische situatie (omdat ze niet beter konden).

Nu zijn er, dankzij ChartNet Marktanalyse, geen beperkingen meer.. We zijn in staat om een zeer interessant systeem te bouwen op basis van de RSI. Het basis idee is eenvoudig: we willen de aandelen er uit filteren waarbij de RSI overbought staat, maar binnen een dalende trend.

Deze code kan in een regel iBuilder code worden geschreven:

```
Filter = RSI > 70 AND MOMENTUM[1](RSI) < 0
```

Nu sorteren we Aldus verkregen aandelen om alleen de meest interessante over te houden. Dit zijn diegene die grootste daling hebben gehad als we kijken naar hun normale volatiliteit. Het lijkt een eenvoudige voorwaarde, maar dit vereist serieus wat programmeerwerk. Maar schrik niet, met ChartNet Marktanalyse is dit erg eenvoudig te doen.

Voorbeeld RSI en bearish reversal

```
REM Filter the stocks on which RSI is overbought and in reversal
```

```
// Criterion: RSI < 30 and decreasing
```

```
Filter = RSI > 70 AND MOMENTUM[1](RSI) < 0
```

```
REM Compute the power of the bullish trend
```

```
// Find the lowest quote on the last 20 bars
```

```
LowPoint = LOWEST[20](LOW)
```

```
// Compute the variation of price from this point to now
```

```
Advance = CLOSE - LowPoint
```

```
// Compute the usual volatility of the stock (median of True Range)
```

```
Norm = SUMMATION[3](TR) - HIGHEST[3](TR) - LOWEST[3](TR)
```

```
REM We only keep the most serious advances
```

```
SCREENER [ Filter ] (Advance / Norm AS «Trend Power»)
```

Bullish engulfing**Omschrijving**

Op dezelfde wijze zullen we deze methode nu toepassen op een beroemde Candlestick configuratie: de bullish engulfing. Het is een van krachtigste patronen. Er moet echter wel een trend aanwezig zijn van waar uit de omkeer moet plaatsvinden.

Allereerst definiëren we de bearish engulfing:

- De voorgaande candlestick moet zwart zijn
- De huidige candlestick moet openen onder de body van de voorgaande candlestick
- De huidige candlestick moet sluiten boven de body van de voorgaande candlestick

De 3 condities noteren we als volgt:

Filter = CLOSE[1]<OPEN[1] AND OPEN<CLOSE[1] AND CLOSE>OPEN[1]

Om een trendomkeer te detecteren zullen we refereren aan de codes die we al geprogrammeerd hebben in de RSI.

Voorbeeld. Het verschil is dat het aantal hier benodigde bars is lager omdat de Candlestick patronen betrekking hebben op de korte termijn. Hier hoeven we slechts te kijken naar de 8 vooraf gaande bars.

Voorbeeld Bullish engulfing

```

REM Compute the power of the bearish trend

// Find the highest quote on the last 8 bars
HighPoint = HIGHEST[8](HIGH)

// Compute the variation of price from this point to now
Decline = HighPoint – CLOSE

// Compute the usual volatility of the stock (median of True Range)
Norm = SUMMATION[3](TR) – HIGHEST[3](TR) – LOWEST[3](TR)

REM Stock picking: only the bullish engulfing

Filter = CLOSE[1] < OPEN[1] AND OPEN < CLOSE[1] AND CLOSE > OPEN[1]

REM We only keep the most serious declines
SCREENER [ Filter ] (Decline / Norm AS «Trend Power»)

```

Bearish engulfing

Omschrijving

Op dezelfde wijze zullen we deze methode nu toepassen op een beroemde Candlestick configuratie: de bearish engulfing. Het is een van krachtigste patronen. Er moet echter wel een trend aanwezig zijn van waar uit de omkeer moet plaatsvinden.

Allereerst definiëren we de bearish engulfing:

- De voorgaande candlestick moet wit zijn
- De huidige candlestick moet openen boven de body van de voorgaande candlestick
- De huidige candlestick moet sluiten onder de body van de voorgaande candlestick

De 3 condities noteren we als volgt:

Filter = CLOSE[1]>OPEN[1] AND OPEN>CLOSE[1] AND CLOSE<OPEN[1]

Om een trendomkeer te detecteren zullen we refereren aan de codes die we al geprogrammeerd hebben in de RSI.

Voorbeeld. Het verschil is dat het aantal hier benodigde bars is lager omdat de Candlestick patronen betrekking hebben op de korte termijn. Hier hoeven we slechts te kijken naar de 8 vooraf gaande bars.

Voorbeeld Bearish engulfing

```
REM Compute the power of the bullish trend

// Find the lowest quote on the last 8 bars
LowPoint = LOWEST[8](LOW)

// Compute the variation of price from this point to now
Advance = CLOSE- LowPoint

// Compute the usual volatility of the stock (median of True Range)
Norm = SUMMATION[3](TR) – HIGHEST[3](TR) – LOWEST[3](TR)

REM Stock picking : only the bearish engulfing

Filter = CLOSE[1] > OPEN[1] AND OPEN > CLOSE[1] AND CLOSE < OPEN[1]

REM We only keep the most serious advances
SCREENER [ Filter ] (Advance / Norm AS «Trend Power»)
```