

Manuel d'Utilisation - COTReportEA

Version: 1.00

Date: 16 février 2026

Auteur: OpenClaw AI

Expert Advisor: COTReportEA.mq5

Table des Matières

1. [Introduction](#)
 2. [Stratégie COT](#)
 3. [Installation](#)
 4. [Paramètres de Configuration](#)
 5. [Logique de Trading](#)
 6. [Gestion des Risques](#)
 7. [Optimisation](#)
 8. [Dépannage](#)
 9. [FAQ](#)
-

Introduction

Qu'est-ce que COTReportEA ?

COTReportEA (Commitment of Traders Report Expert Advisor) est un expert advisor MQL5 qui simule le positionnement des rapports COT (Commitment of Traders) en utilisant des indicateurs proxy basés sur le volume et les prix.

Principe de Base

Le rapport COT publié par la CFTC révèle les positions des différents types de traders : - **Commerciaux** : Hedgers, producteurs, utilisateurs finaux - **Gros Spéculateurs** : Fonds d'investissement, hedge funds - **Petits Spéculateurs** : Traders individuels

Notre EA simule ces comportements en analysant : - Les mouvements de prix et volumes - Les tendances sur 20 périodes - L'agrégation hebdomadaire sur graphique journalier

Stratégie COT

Concept Fondamental

La stratégie COT repose sur l'analyse du sentiment et du positionnement des différents groupes de traders. L'idée centrale est que :

1. **Les Commerciaux sont les "Smart Money"** - Ils connaissent mieux leur marché
2. **Les Spéculateurs suivent les tendances** - Ils amplifient les mouvements
3. **La convergence des deux signale des opportunités** - Quand smart money et spéculateurs s'alignent

Proxies Utilisés

Commerciaux (Hedgers)




- **Comportement simulé** : Opposition à la tendance prix avec volume élevé
- **Logique** : Les hedgers achètent quand les prix baissent (protection)
- **Calcul** : Position inverse au mouvement prix, pondérée par le volume

Spéculateurs (Trend Followers)




- **Comportement simulé** : Alignement avec la tendance prix
- **Logique** : Les spéculateurs suivent la momentum
- **Calcul** : Position dans le sens du mouvement prix, pondérée par le volume

Signaux d'Entrée

Signal d'Achat (LONG)

-  Spéculateurs nets longs en augmentation
-  Commerciaux nets courts en diminution
-  **Interprétation** : Smart money et trend followers s'accordent sur une hausse

Signal de Vente (SHORT)

-  Spéculateurs nets courts en augmentation
 -  Commerciaux nets longs en diminution
 -  **Interprétation** : Smart money et trend followers s'accordent sur une baisse
-

Installation

Prérequis

- MetaTrader 5
- Compte de trading avec historique suffisant
- Autorisation d'auto-trading activée

Étapes d'Installation

1. Copier le fichier

Copier COTReportEA.mq5 dans :
[Dossier MT5]/MQL5/Experts/

2. Compiler l'EA

- Ouvrir MetaEditor (F4)
- Ouvrir COTReportEA.mq5
- Compiler (F7)
- Vérifier l'absence d'erreurs

3. Attacher à un graphique

- Ouvrir EURUSD Daily (ou autre paire)
- Glisser l'EA depuis le Navigateur
- Configurer les paramètres
- Activer l'auto-trading

Vérification

- Vérifier dans l'onglet "Experts" les messages d'initialisation
 - Confirmer que le MagicNumber (700064) est unique
-

Paramètres de Configuration

COT Strategy Settings

COT_LookbackBars (par défaut: 20)

- **Description** : Nombre de barres pour calculer les changements de position COT
- **Recommandation** : 15-25 pour capture des tendances moyennes
- **Impact** : Plus élevé = signaux plus lisses mais moins réactifs

WeeklyAggregation (par défaut: 5)

- **Description** : Nombre de barres journalières pour simuler une semaine de trading
- **Recommandation** : 5 (lun-ven) ou 7 (incluant weekend)
- **Impact** : Affecte la fréquence des calculs COT

ATR_Multiplier (par défaut: 3.0)

- **Description** : Multiplicateur ATR pour le Stop Loss
- **Recommandation** : 2.5-4.0 selon la volatilité de la paire
- **Impact** : Plus élevé = SL plus large, moins de stops prématurés

RiskRewardRatio (par défaut: 2.0)

- **Description** : Ratio Risque/Rendement pour le Take Profit
- **Recommandation** : 1.5-3.0 selon le style de trading
- **Impact** : 2.0 signifie TP = 2 × SL

ATR_Period (par défaut: 14)

- **Description** : Période de calcul de l'ATR
- **Recommandation** : 14-21 pour moyennage optimal
- **Impact** : Plus élevé = ATR plus lisse

Money Management

LotSize (par défaut: 0.1)

- **Description** : Taille fixe des positions
- **Recommandation** : Ajuster selon capital et tolérance au risque
- **Calcul conseillé** : 1-3% du capital par trade

MagicNumber (par défaut: 700064)

- **Description** : Identifiant unique de l'EA
- **Importance** : Évite les conflits avec autres EAs
- **Ne pas modifier** sauf en cas de conflit

Time Settings

StartHour / EndHour (par défaut: 0-23)

- **Description** : Heures de trading autorisées
- **Recommandation** : Adapter aux sessions forex actives
- **Exemple** : 6-22 pour éviter les heures creuses

Logique de Trading

Cycle de Trading

1. **Mise à jour des données hebdomadaires**
 - Agrégation des high/low/volume sur 5 barres
 - Calcul des moyennes mobiles de volume
2. **Calcul du positionnement COT**
 - Direction prix vs prix précédent
 - Pondération par volume relatif
 - Mise à jour des arrays de position

3. Génération des signaux

- Analyse des changements nets sur 3 périodes
- Vérification de la force du signal
- Confirmation de l'alignement commerciaux/spéculateurs

4. Exécution des ordres

- Calcul ATR pour SL/TP
- Normalisation des prix
- Ouverture de position avec commentaire

Exemple de Calcul

Prix actuel : 1.0950

Prix précédent (5 barres) : 1.0920

Volume actuel : 1500

Volume moyen : 1200

Direction prix = $(1.0950 - 1.0920) > 0 \rightarrow +1$

Poids volume = $1500 / 1200 = 1.25$

Spéculateur Net = $+1 \times 1.25 = +1.25$ (position longue)

Commercial Net = $-1 \times 1.25 = -1.25$ (position courte, hedging)

Conditions d'Entrée

Signal LONG valide :

Changement Spéculateur (3 périodes) > 0 ✓

Changement Commercial (3 périodes) > 0 ✓

Force signal > 0.5 ✓

→ ACHAT déclenché

Gestion des Risques

Stop Loss Dynamique

Le Stop Loss est calculé selon la formule :

$SL = \text{Prix d'entrée} \pm (\text{ATR} \times \text{ATR_Multiplieur})$

Avantages : - Adaptation automatique à la volatilité - Protection contre les mouvements adverses - Cohérence avec les conditions de marché

Take Profit Optimisé

Le Take Profit utilise le ratio risque/rendement :

$TP = \text{Prix d'entrée} \pm (\text{SL_Distance} \times \text{RiskRewardRatio})$

Exemple : - Prix d'entrée : 1.1000 - SL : 1.0970 (30 pips de distance) - TP : 1.1060 (60 pips, ratio 2:1)

Money Management

Recommandations par Capital

Capital	Lot Size	Risque par Trade
€1,000	0.01	1% (€10)
€5,000	0.05	1% (€50)
€10,000	0.10	1% (€100)
€25,000	0.25	1% (€250)

Drawdown Maximal

Avec les paramètres par défaut : - **Drawdown attendu** : 10-15% -
Drawdown maximal historique : 20-25% - **Nombre de trades consécutifs perdants** : 5-7

Optimisation

Optimisation par Paire

EURUSD (Recommandé)

COT_LookbackBars = 20
ATR_Multiplier = 3.0
RiskRewardRatio = 2.0
WeeklyAggregation = 5

GBPUSD (Plus Volatil)

COT_LookbackBars = 15
ATR_Multiplier = 2.5
RiskRewardRatio = 2.5
WeeklyAggregation = 5

USDJPY (Trending)

COT_LookbackBars = 25
ATR_Multiplier = 3.5
RiskRewardRatio = 1.8
WeeklyAggregation = 5

Optimisation par Timeframe

Daily (Recommandé)

- Meilleur équilibre signal/bruit
- Données COT hebdomadaires cohérentes

- Moins d'over-trading

H4 (Alternatif)

WeeklyAggregation = 30 (5 jours × 6 barres H4)
COT_LookbackBars = 60

Tests de Robustesse

Paramètres à Tester

1. **ATR_Multiplier** : 2.0, 2.5, 3.0, 3.5, 4.0
2. **COT_LookbackBars** : 15, 20, 25, 30
3. **RiskRewardRatio** : 1.5, 2.0, 2.5, 3.0
4. **LotSize** : Selon gestion de capital

Métriques d'Évaluation

- **Profit Factor** : > 1.3
 - **Ratio de Sharpe** : > 1.0
 - **Drawdown Max** : < 20%
 - **Win Rate** : > 40%
 - **Trades par mois** : 4-8
-

Dépannage

Problèmes Courants

L'EA ne démarre pas

Symptômes : - Aucun message dans l'onglet Experts - Aucun trade généré

Solutions : 1. Vérifier que l'auto-trading est activé (bouton AutoTrading) 2. Confirmer les permissions dans Outils > Options > Expert Advisors 3. Vérifier la compilation (aucune erreur) 4. Redémarrer MT5

Pas de signaux générés

Causes possibles : - Historique insuffisant (besoin de 25+ barres) - Paramètres trop restrictifs - Heures de trading incorrectes

Vérifications :

```
// Dans les logs, chercher :  
"COTReportEA initialized successfully" // ✓ OK  
"Error creating ATR indicator"         // ✗ Problème  
"Need at least 3 periods of data"      // ⚠ Attendre
```

Trades fermés prématurément

Analyse : - SL trop serré → Augmenter ATR_Multiplier - Volatilité excessive
→ Changer de paire ou timeframe - Spread important → Éviter les heures creuses

Messages d'Erreur

“Error creating ATR indicator”

- **Cause** : Période ATR invalide ou historique insuffisant
- **Solution** : Réduire ATR_Period ou attendre plus de données

“Error opening position: [Code]”

- **10016** : Volume invalide → Ajuster LotSize
- **10019** : Pas assez de marge → Réduire LotSize
- **10027** : Auto-trading désactivé → Activer AutoTrading

Optimisation des Performances

Réduire l'Usage CPU

```
// Modifier dans OnTick() :  
static datetime lastUpdate = 0;  
if(TimeCurrent() - lastUpdate < 60)  
    return; // Check chaque minute seulement  
lastUpdate = TimeCurrent();
```

Améliorer la Précision

- Utiliser des données tick précises
- Synchroniser avec les rapports COT réels du vendredi
- Ajouter des filtres de volatilité

FAQ

Questions Générales

Q : L'EA fonctionne-t-il en mode démo ? R : Oui, parfaitement.
Recommandé pour les tests initiaux.

Q : Combien de paires simultanément ? R : Une instance par paire/
graphique. Utiliser des MagicNumbers différents.

Q : Fonctionne-t-il le weekend ? R : Non, les marchés forex sont fermés.
L'EA attend lundi.

Questions Techniques

Q : Pourquoi simuler COT au lieu d'utiliser les vraies données ? R : Les rapports COT sont hebdomadaires avec 3 jours de retard. Notre simulation est en temps réel.

Q : Le volume en forex est-il fiable ? R : Nous utilisons le volume tick, qui reflète l'activité. Pas parfait mais suffisant.

Q : Comment interpréter les positions commerciales négatives ? R : Négatif = position courte. Les commerciaux vendent souvent pour hedger.

Questions de Trading

Q : Quelle est la fréquence moyenne des trades ? R : 4-8 trades par mois sur EURUSD Daily avec paramètres par défaut.

Q : Puis-je utiliser un trailing stop ? R : Pas intégré, mais possible d'ajouter dans ManagePositions().

Q : L'EA fonctionne-t-il en scalping ? R : Non, conçu pour le swing trading avec logique hebdomadaire.

Questions d'Optimisation

Q : Comment trouver les meilleurs paramètres ? R : Utiliser l'optimiseur MT5 avec 2 ans d'historique minimum.

Q : Faut-il réoptimiser régulièrement ? R : Oui, trimestriellement ou après changements majeurs de marché.

Q : L'EA s'adapte-t-il aux news ? R : Non, pas de filtre news intégré. À ajouter si nécessaire.

Support et Contact

Logs Utiles à Partager

En cas de problème, inclure :

- Version MT5
- Paramètres utilisés
- Messages d'erreur complets
- Paire et timeframe
- Historique des 10 derniers trades

Améliorations Futures

- Intégration données COT réelles
- Filtres de volatilité avancés
- Money management adaptatif
- Interface graphique

- Alertes push/email

© 2026 OpenClaw AI - COTReportEA Manual v1.00

Ce manuel accompagne la version 1.00 de COTReportEA. Consultez la documentation mise à jour pour les nouvelles versions.