

DarkPoolDetectEA - Manuel d'Utilisation

Vue d'Ensemble

DarkPoolDetectEA est un Expert Advisor (EA) MetaTrader 5 conçu pour détecter et exploiter les activités de trading institutionnel, communément appelées "dark pools" ou trades de blocs. Cette stratégie se base sur l'identification de pics de volume inhabituels accompagnés de mouvements de prix limités, indicateurs typiques d'accumulation institutionnelle.

Numéro Magique

- **700063** - Identifiant unique pour cet EA

Paire Recommandée

- **EURUSD** sur timeframe **M15**
-

Principe de la Stratégie

1. Détection des Dark Pools

L'EA recherche les signaux suivants :

Critères de Détection : - **Pic de Volume** : Volume actuel $> 4x$ la moyenne des 20 dernières barres - **Mouvement Limité** : Range de la barre $< 0,3x$ ATR (14 périodes)

Cette combinaison indique qu'un gros volume a été échangé sans impacter significativement le prix, caractéristique des trades institutionnels.

2. Direction d'Entrée

Après détection d'un bloc trade : - **Si la bougie se ferme en haussier** → Position d'achat - **Si la bougie se ferme en baissier** → Position de vente

Logique : Les institutions accumulent dans la direction de leur intention future.

3. Confirmation

Avant d'entrer en position, l'EA attend la confirmation des **2 barres suivantes** : - Les 2 barres doivent se mouvoir dans la même direction que le bloc détecté - Assure que le mouvement institutionnel continue

4. Gestion des Risques

Stop Loss : - Placé au-delà de la range du bloc trade - Distance : Range du bloc + 10% de marge

Take Profit : - Ratio risque/récompense de **2:1** - TP = 2x la distance du SL

5. Détection des Clusters

L'EA surveille les **clusters de blocs trades** : - **3 ou plus** blocs détectés sur **10 barres** - Signal très fort d'activité institutionnelle - **Double la taille de lot** pour ces signaux

Paramètres de Configuration

Paramètres de Base

Paramètre	Défaut	Description
LotSize	0.01	Taille de lot fixe
AutoLotSize	true	Calcul automatique basé sur le risque
RiskPercent	1.0%	Pourcentage de risque par trade

Paramètres de Détection

Paramètre	Défaut	Description
VolumeMultiplier	4	Multiplicateur pour le pic de volume
ATRMultiplier	0.3	Multiplicateur ATR pour mouvement max
VolumePeriod	20	Période pour la moyenne du volume
ATRPeriod	14	Période pour le calcul ATR

Paramètres de Confirmation

Paramètre	Défaut	Description
ConfirmBars	2	Nombre de barres de confirmation
UseClusterDetection	true	Activer détection des clusters
ClusterBars	10	Période de recherche des clusters
MinClustered	3	Minimum de blocs pour un cluster
ClusterMultiplier	2.0	Multiplicateur de lot pour clusters

Paramètres de Sécurité

Paramètre	Défaut	Description
MagicNumber	700063	Numéro magique de l'EA
MaxSpread	30	Spread maximum autorisé
TradeOnNewBar	true	Ne trader qu'à l'ouverture d'une nouvelle barre
TradeComment	"DarkPool"	Commentaire des trades

Installation et Configuration

1. Installation

1. Copiez le fichier DarkPoolDetectEA.mq5 dans le dossier :

MetaTrader 5/MQL5/Experts/

2. Compilez l'EA dans MetaEditor (F7)
3. Redémarrez MetaTrader 5

2. Configuration Recommandée

Pour EURUSD M15 (Configuration Optimale) :

```
LotSize = 0.01
AutoLotSize = true
RiskPercent = 1.0
VolumeMultiplier = 4
ATRMultiplier = 0.3
VolumePeriod = 20
ATRPeriod = 14
ConfirmBars = 2
UseClusterDetection = true
ClusterBars = 10
MinClustered = 3
ClusterMultiplier = 2.0
MaxSpread = 30
TradeOnNewBar = true
```

Pour autres paires majeures (EUR/GBP, GBP/USD, USD/JPY) : - Ajustez VolumeMultiplier à 3-5 selon la liquidité - Réduisez MaxSpread à 20-25 pour les paires moins liquides

Pour paires mineures/exotiques : - VolumeMultiplier = 2-3 - ATRMultiplier = 0.4-0.5 - MaxSpread = 50-100

3. Timeframes Recommandés

Timeframe	Convient pour	Ajustements
M15	Optimal	Configuration par défaut
M30	Trading moins fréquent	VolumePeriod = 15
H1	Signaux plus fiables	ConfirmBars = 1
M5	Plus d'opportunités	VolumeMultiplier = 5

Fonctionnement Détaillé

Cycle de Détection

1. **Analyse Continue** : L'EA analyse chaque nouvelle barre
2. **Calcul des Moyennes** : Volume moyen sur 20 périodes, ATR sur 14
3. **Détection** : Comparaison volume actuel vs seuils
4. **Stockage** : Bloc détecté stocké pour confirmation
5. **Confirmation** : Vérification sur les 2 barres suivantes
6. **Exécution** : Trade si confirmation validée

Exemples de Signaux

Signal d'Achat Valide :

Barre 1 : Volume = 1000 (moyenne = 200) → 5x
Range = 15 pips, ATR = 60 pips → 0.25x ATR
Close > Open → Direction haussière

Barre 2 : Close > Open → Confirmation 1/2

Barre 3 : Close > Open → Confirmation 2/2

→ ACHAT exécuté

Signal de Cluster :

10 dernières barres : 4 blocs détectés

→ Cluster confirmé

→ Lot doublé (0.02 au lieu de 0.01)

Gestion des Positions

- **1 position maximum** par symbole
- **SL automatique** : Au-delà du range du bloc
- **TP automatique** : Ratio 2:1
- **Pas de trailing stop** (par design)
- **Pas de martingale** (gestion conservative)

Optimisation et Backtesting

Paramètres à Optimiser

Priorité 1 (Impact élevé) : - VolumeMultiplier : Testez 3-6 -
ATRMultiplier : Testez 0.2-0.5 - RiskPercent : Testez 0.5-2.0%

Priorité 2 (Impact modéré) : - VolumePeriod : Testez 15-30 - ConfirmBars :
Testez 1-3 - ClusterMultiplier : Testez 1.5-3.0

Priorité 3 (Ajustements fins) : - ClusterBars : Testez 8-15 -
MinClustered : Testez 2-4

Métriques d'Évaluation

Cibles de Performance : - Profit Factor : > 1.5 - Win Rate : 45-60% - Max
Drawdown : < 15% - Ratio de Sharpe : > 1.0

Période de Backtest

- **Minimum** : 6 mois de données M15
 - **Recommandé** : 1-2 ans avec différentes conditions de marché
 - **Inclure** : Périodes de volatilité haute et basse
-

Surveillance et Maintenance

Journaux Importants

L'EA génère des logs détaillés :

```
"Block trade detected at 2025-02-16 10:15:00"  
"Volume: 850 (4.2x avg) - Range: 12 points - ATR: 45 points"  
"Cluster detected - Increasing lot size to: 0.02"  
"Trade executed successfully - Ticket: 123456 Type: BUY"
```

Alertes à Surveiller

Bonnes Nouvelles : - "Block trade detected" - Signal potentiel -
"Cluster detected" - Signal fort - "Trade executed successfully" -
Position ouverte

Attention Requisite : - "Max spread exceeded" - Conditions de marché
défavorables - "Position already open" - EA fonctionne normalement -
"Trade execution failed" - Vérifier connexion/liquidité

Maintenance Régulière

Quotidienne : - Vérifier les logs pour erreurs - Contrôler le spread moyen -
Surveiller les performances

Hebdomadaire : - Analyser les trades fermés - Ajuster le risk percent si nécessaire - Vérifier la corrélation avec les news économiques

Mensuelle : - Évaluer les performances globales - Considérer des ajustements de paramètres - Backtest sur données récentes

Conditions de Marché Optimales

Favorables

- **Sessions de trading** : Londres (8h-17h GMT) et New York (13h-22h GMT)
- **Volatilité modérée** : ATR entre 30-80 pips sur EURUSD M15
- **Spreads faibles** : < 2 pips sur EURUSD
- **Volume constant** : Éviter les périodes de faible liquidité

À Éviter

- **News majeures** : NFP, décisions BCE/Fed, etc.
- **Fins de session** : Vendredi après 20h GMT
- **Périodes festives** : Liquidité réduite
- **Volatilité extrême** : ATR > 100 pips

Paires Recommandées

Paire	Recommandation	Ajustements
EURUSD	Optimal	Paramètres par défaut
GBPUSD	Très bon	MaxSpread = 25
USDJPY	Bon	ATRMultiplicateur = 0.25
EURGBP	Bon	VolumeMultiplicateur = 3
AUDUSD	Modéré	VolumeMultiplicateur = 3
USDCAD	Modéré	ATRMultiplicateur = 0.4

Dépannage

Problèmes Fréquents

EA ne trade pas : 1. Vérifier que AutoTrading est activé 2. Confirmer que le spread < MaxSpread 3. Vérifier qu'il n'y a pas de position ouverte 4. Attendre une nouvelle barre si TradeOnNewBar = true

Trop de signaux faux : 1. Augmenter VolumeMultiplicateur (4 → 5) 2. Réduire ATRMultiplicateur (0.3 → 0.2) 3. Augmenter ConfirmBars (2 → 3)

Pas assez de signaux : 1. Réduire VolumeMultiplicateur (4 → 3) 2. Augmenter ATRMultiplicateur (0.3 → 0.4) 3. Réduire MinClustered (3 → 2)

Drawdown élevé : 1. Réduire RiskPercent (1.0% → 0.5%) 2. Désactiver UseClusterDetection temporairement 3. Augmenter les critères de confirmation

Codes d'Erreur Courants

Code	Description	Solution
4756	Trade context busy	Réessayer automatiquement
10016	Invalid volume	Vérifier LotSize et limites du broker
10021	Not enough margin	Réduire RiskPercent
4110	Long positions only	Ajuster sur compte ECN

Versions et Mises à Jour

Version 1.00 (Actuelle)

- Détection de base des dark pools
- Confirmation sur 2 barres
- Gestion automatique des lots
- Détection des clusters
- Ratio risque/récompense 2:1

Améliorations Futures Possibles

- Filtre de volatilité avancé
- Intégration des news économiques
- Trailing stop adaptatif
- Multi-timeframe confirmation
- Machine learning pour la détection

Support et Contact

Pour toute question ou suggestion d'amélioration : - **Email** : support@openclaw.com - **Documentation** : <https://openclaw.com/docs> - **Forum** : <https://community.openclaw.com>

Développé par l'équipe OpenClaw - 2025 Utilisez cet EA à vos propres risques. Les performances passées ne garantissent pas les résultats futurs.