

DrawdownControlEA - Manuel Utilisateur

Table des Matières

1. Introduction
 2. Principe de Fonctionnement
 3. Paramètres de Configuration
 4. Système de Contrôle du Drawdown
 5. Stratégie de Trading
 6. Installation et Configuration
 7. Surveillance et Maintenance
 8. Dépannage
 9. Exemples Pratiques
-

Introduction

DrawdownControlEA est un Expert Advisor (EA) avancé pour MetaTrader 5 qui implémente un système sophistiqué de contrôle du drawdown. Cet EA combine une stratégie de trading basée sur le croisement MACD avec un filtre de tendance EMA 200, tout en appliquant des mesures strictes de gestion des risques pour protéger votre capital.

Caractéristiques Principales

- **Stratégie de base** : Croisement MACD (12,26,9) + Filtre EMA 200
 - **Contrôle dynamique du drawdown** : Réduction automatique des lots selon le drawdown
 - **Limites de pertes** : Contrôle journalier et hebdomadaire des pertes
 - **Persistiance des données** : Sauvegarde du pic d'équité entre redémarrages
 - **Mode récupération** : Reprise graduelle après de fortes pertes
-

Principe de Fonctionnement

Vue d'Ensemble

L'EA surveille en permanence l'évolution de votre equity et ajuste automatiquement la taille des positions selon le niveau de drawdown atteint. Plus le drawdown est important, plus la taille des lots est réduite, jusqu'à l'arrêt complet du trading si nécessaire.

Cycle de Fonctionnement

1. **Surveillance continue** : Calcul du drawdown actuel par rapport au pic d'equity
 2. **Ajustement des lots** : Application du multiplicateur selon le niveau de drawdown
 3. **Vérification des limites** : Contrôle des pertes journalières et hebdomadaires
 4. **Analyse technique** : Recherche de signaux selon la stratégie MACD + EMA
 5. **Exécution** : Ouverture de positions avec la taille ajustée
-

Paramètres de Configuration

Paramètres de Trading

Paramètre	Type	Défaut	Description
InpLotSize	double	0.1	Taille de lot de base (100% de risque)
InpMagicNumber	int	700099	Numéro magique pour identifier les ordres
InpStopLoss	int	50	Stop Loss en points
InpTakeProfit	int	100	Take Profit en points
InpEnableTrading	bool	true	Active/désactive le trading

Paramètres de Gestion des Risques

Paramètre	Type	Défaut	Description
InpDailyMaxLoss	double	3.0	Perte maximale journalière (%)
InpWeeklyMaxLoss	double	5.0	Perte maximale hebdomadaire (%)

Paramètres Techniques

Paramètre	Type	Défaut	Description
InpMACDFastEMA	int	12	Période EMA rapide du MACD
InpMACDSlowEMA	int	26	Période EMA lente du MACD
InpMACDSignalSMA	int	9	Période SMA signal du MACD
InpEMAFastPeriod	int	200	Période de l'EMA de tendance

Système de Contrôle du Drawdown

Niveaux de Risque

L'EA applique 5 niveaux de contrôle du drawdown :

Niveau 1 : Drawdown < 5%

- **Multiplicateur de lot** : 100%
- **État** : Trading normal
- **Action** : Aucune restriction

Niveau 2 : Drawdown 5-10%

- **Multiplicateur de lot** : 50%
- **État** : Réduction modérée du risque
- **Action** : Réduction de moitié de la taille des positions

Niveau 3 : Drawdown 10-15%

- **Multiplicateur de lot** : 25%
- **État** : Réduction importante du risque
- **Action** : Réduction à un quart de la taille normale

Niveau 4 : Drawdown 15-20%

- **Multiplicateur de lot** : 10%
- **État** : Risque minimal
- **Action** : Trading avec lots très réduits

Niveau 5 : Drawdown > 20%

- **Multiplicateur de lot** : 0% (ARRÊT)
- **État** : Trading suspendu
- **Action** : Arrêt complet jusqu'à récupération

Mode Récupération

Lorsque l'equity se redresse et que le drawdown repasse sous 10%, l'EA active automatiquement le mode récupération :

1. **Réactivation** : Le trading reprend avec un lot à 25%
2. **Progression graduelle** : 25% → 50% → 100% selon l'amélioration
3. **Surveillance continue** : Retour aux niveaux de restriction si détérioration

Persistante des Données

Le pic d'equity est sauvegardé dans une variable globale MetaTrader, assurant la continuité du calcul même après : - Redémarrage de l'EA - Fermeture/réouverture de MetaTrader - Changement de timeframe

Stratégie de Trading

Signal d'Achat (BUY)

Conditions requises : 1. La ligne MACD principale croise au-dessus de la ligne de signal 2. Le prix actuel est supérieur à l'EMA 200 3. Aucune position ouverte existante

Exécution : - Ordre d'achat au prix Ask - Stop Loss = Prix d'entrée - (50 points × Point) - Take Profit = Prix d'entrée + (100 points × Point)

Signal de Vente (SELL)

Conditions requises : 1. La ligne MACD principale croise en dessous de la ligne de signal 2. Le prix actuel est inférieur à l'EMA 200 3. Aucune position ouverte existante

Exécution : - Ordre de vente au prix Bid - Stop Loss = Prix d'entrée + (50 points × Point) - Take Profit = Prix d'entrée - (100 points × Point)

Filtre de Tendance

L'EMA 200 sert de filtre de tendance majeur : - **Tendance haussière** : Prix > EMA 200 → Seuls les signaux d'achat sont pris - **Tendance baissière** : Prix < EMA 200 → Seuls les signaux de vente sont pris

Installation et Configuration

Étape 1 : Installation

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

MetaTrader 5/MQL5/Experts/

2. Redémarrez MetaTrader 5 ou actualisez le navigateur (F5)

Étape 2 : Configuration du Graphique

1. Ouvrez un graphique EURUSD H1 (recommandé)
2. Faites glisser l'EA sur le graphique
3. Dans l'onglet "Paramètres", ajustez les valeurs selon vos préférences

Étape 3 : Configuration Recommandée pour Débutants

Taille de lot de base : 0.01

Perte max journalière : 2.0%

Perte max hebdomadaire : 3.0%

Stop Loss : 30 points

Take Profit : 60 points

Étape 4 : Vérifications Pré-Trading

- Vérifiez que l'EA sourit (icône souriante dans le coin supérieur droit)
 - Confirmez que le trading automatique est activé
 - Vérifiez la connexion internet et au serveur
 - Assurez-vous d'avoir un capital suffisant
-

Surveillance et Maintenance

Informations Affichées

L'EA affiche en temps réel dans le coin du graphique : - **Niveau de risque actuel** (1 à 5) - **Pourcentage de drawdown** - **Multiplicateur de lot en cours** - **États spéciaux** (ARRÊT, RÉCUPÉRATION, LIMITES)

Vérifications Quotidiennes

1. **État général** : Vérifiez que l'EA fonctionne normalement
2. **Drawdown** : Surveillez l'évolution du drawdown
3. **Positions** : Contrôlez les positions ouvertes
4. **Logs** : Consultez l'onglet "Journal" pour les messages

Vérifications Hebdomadaires

1. **Performance** : Analysez les résultats de la semaine
2. **Paramètres** : Ajustez si nécessaire selon les conditions de marché
3. **Sauvegarde** : Exportez l'historique des trades

Maintenance Mensuelle

1. **Optimisation** : Testez différents paramètres sur données historiques
 2. **Mise à jour** : Vérifiez s'il existe une version plus récente
 3. **Analyse** : Évaluez les performances à long terme
-

Dépannage

Problème : L'EA ne trade pas

Causes possibles : - Trading automatique désactivé - Drawdown > 20% (arrêt automatique) - Limite journalière/hebdomadaire atteinte - Pas de signal technique valide - Taille de lot trop petite

Solutions : 1. Vérifiez le bouton “Trading Algorithmique” dans MetaTrader 2. Attendez une amélioration de l’equity si en mode arrêt 3. Attendez le lendemain/lundi suivant si limite atteinte 4. Vérifiez les conditions de marché pour les signaux 5. Augmentez la taille de lot de base

Problème : Lots trop petits

Cause : Drawdown élevé activant les réductions de lot

Solution : 1. Vérifiez le niveau de drawdown actuel 2. Si justifié, augmentez légèrement la taille de lot de base 3. Attendez une récupération naturelle de l’equity

Problème : Trop de pertes consécutives

Analyse : 1. Vérifiez les conditions de marché (volatilité, tendance) 2. Contrôlez si les paramètres MACD sont adaptés 3. Considérez un ajustement des niveaux de Stop Loss/Take Profit

Actions : 1. Arrêtez temporairement l’EA si nécessaire 2. Testez sur compte démo avec nouveaux paramètres 3. Reprenez progressivement le trading réel

Problème : Variables globales perdues

Symptôme : Le pic d’equity se remet à zéro après redémarrage

Solution : 1. Vérifiez l’onglet “Variables Globales” dans MetaTrader 2. Si nécessaire, définissez manuellement la variable : Nom : DrawdownControl_PeakEquity_EURUSD Valeur : [votre pic d’equity réel]

Exemples Pratiques

Exemple 1 : Début de Trading

Situation : Compte de 1000€, premier démarrage

Equity actuelle : 1000€
Pic d’equity : 1000€ (initialisé)
Drawdown : 0%
Niveau de risque : 1
Multiplicateur de lot : 100%
Lot effectif : 0.1 (si paramètre = 0.1)

Exemple 2 : Drawdown Modéré

Situation : Après quelques trades perdants

Equity actuelle : 925€
Pic d’equity : 1000€

Drawdown : 7.5%
Niveau de risque : 2
Multiplicateur de lot : 50%
Lot effectif : 0.05
Message : "Risk Level 2 – Drawdown: 7.50% – Lot: 50%"

Exemple 3 : Drawdown Critique

Situation : Série de pertes importantes

Equity actuelle : 780€
Pic d'equity : 1000€
Drawdown : 22%
Niveau de risque : 5
Multiplicateur de lot : 0%
Lot effectif : 0 (pas de trading)
Message : "TRADING STOPPED – Drawdown: 22.00%"

Exemple 4 : Mode Récupération

Situation : Equity remonte après arrêt

Equity actuelle : 920€
Pic d'equity : 1000€
Drawdown : 8%
Niveau de risque : Récupération
Multiplicateur de lot : 25%
Lot effectif : 0.025
Message : "RECOVERY MODE ACTIVATED – Drawdown: 8.00%"

Exemple 5 : Nouveau Pic d'Equity

Situation : Performance positive

Equity actuelle : 1150€
Pic d'equity : 1150€ (mis à jour)
Drawdown : 0%
Niveau de risque : 1
Multiplicateur de lot : 100%
Lot effectif : 0.1
Message : "Risk Level 1 – Drawdown: 0.00% – Lot: 100%"

Conseils d'Utilisation

Pour Débutants

1. **Commencez petit** : Utilisez une taille de lot de 0.01
2. **Testez d'abord** : Utilisez un compte démo pendant au moins 1 mois
3. **Surveillez activement** : Ne laissez pas l'EA sans surveillance au début

4. **Documentez** : Tenez un journal de vos observations

Pour Utilisateurs Expérimentés

1. **Optimisation** : Testez différents paramètres MACD selon les paires
2. **Diversification** : Utilisez sur plusieurs paires avec des Magic Numbers différents
3. **Backtesting** : Effectuez des tests approfondis sur données historiques
4. **Corrélations** : Attention aux corrélations entre paires tradées

Gestion du Capital

1. **Ne risquez jamais plus de 2% par trade** sur votre capital total
 2. **Diversifiez** vos stratégies de trading
 3. **Gardez une réserve** de liquidités pour les opportunités
 4. **Réévaluez régulièrement** vos objectifs et risques
-

Avertissements et Limitations

Risques du Trading Automatique

- **Risque de perte en capital** : Le trading comporte des risques de pertes
- **Conditions de marché** : Les performances passées ne garantissent pas les résultats futurs
- **Pannes techniques** : Connexions, électricité, serveurs peuvent poser problème
- **Changements de marché** : Les conditions peuvent rendre la stratégie moins efficace

Limitations Techniques

- **Une position à la fois** : L'EA n'ouvre qu'une position par signal
- **Timeframe fixe** : Optimisé pour H1, peut nécessiter ajustements sur d'autres périodes
- **Paires recommandées** : Principalement testé sur EURUSD
- **Spread** : Performance affectée par des spreads élevés

Recommandations Légales

- **Formation** : Assurez-vous de comprendre le trading forex avant utilisation
 - **Capital de risque** : N'investissez que l'argent que vous pouvez vous permettre de perdre
 - **Réglementation** : Respectez les lois de votre pays concernant le trading
 - **Conseil financier** : Consultez un conseiller financier si nécessaire
-

Support et Contact

Pour toute question concernant **DrawdownControlEA** :

1. **Documentation** : Relisez ce manuel attentivement
 2. **Tests** : Effectuez des tests approfondis sur compte démo
 3. **Logs MetaTrader** : Consultez l'onglet “Journal” pour les messages d'erreur
 4. **Communauté** : Participez aux forums de trading pour partager expériences
-

Version : 1.0

Date : Février 2024

Compatibilité : MetaTrader 5

Licence : Usage personnel uniquement

Avertissement : Ce manuel est fourni à titre informatif. L'utilisation d'Expert Advisors comporte des risques. Tradez de manière responsable.