

Expert Advisor EhlersFisherEA

Manuel d'Utilisation Complet

Version : 1.00

Auteur : Claude Code

Date : Février 2025

Copyright : 2025, Claude Code

Table des Matières

1. Introduction
2. Théorie de la Fisher Transform d'Ehlers
3. Stratégie de Trading
4. Installation et Configuration
5. Paramètres de l'Expert Advisor
6. Gestion des Risques
7. Signaux de Trading
8. Optimisation
9. Dépannage
10. Avertissements et Disclaimer

Introduction

L'Expert Advisor **EhlersFisherEA** est un système de trading automatisé basé sur l'indicateur **Fisher Transform** développé par John F. Ehlers. Cet oscillateur transforme les prix en une distribution quasi-normale, permettant d'identifier plus facilement les extrêmes de marché et les points de retournement.

Caractéristiques principales :

- **Algorithme** : Fisher Transform d'Ehlers avec période 10
- **Magic Number** : 700014
- **Paire recommandée** : EURUSD
- **Timeframe recommandé** : H1 (1 heure)
- **Gestion du risque** : Stop Loss basé sur l'ATR, Take Profit à 2R

Théorie de la Fisher Transform d'Ehlers

Principe Mathématique

La Fisher Transform est basée sur la formule suivante :

$$\text{Fisher} = 0.5 \times \ln((1+x)/(1-x))$$

Où x est le prix normalisé dans une plage de [-1, +1].

Normalisation du Prix

Le prix est normalisé selon la formule :

$$\text{Prix Normalisé} = 2 \times ((\text{Prix Typique} - \text{Plus Bas}) / (\text{Plus Haut} - \text{Plus Bas})) - 1$$

Le **Prix Typique** est calculé comme : $(\text{Haut} + \text{Bas} + \text{Clôture}) / 3$

Avantages de la Fisher Transform

1. **Distribution Normale** : Transforme les prix en distribution quasi-gaussienne
 2. **Identification des Extremes** : Les valeurs > 2.5 ou < -2.5 indiquent des extrêmes
 3. **Signaux Précoces** : Déetecte les retournements avant les autres oscillateurs
 4. **Moins de Faux Signaux** : Filtrage naturel des mouvements insignifiants
-

Stratégie de Trading

Principe de Base

L'EA utilise le croisement de la Fisher Transform avec sa ligne de déclenchement (valeur précédente) pour générer les signaux d'entrée.

Signaux d'Achat (Long)

Condition 1 : Signal classique - La Fisher Transform croise **au-dessus** de sa ligne de déclenchement - **ET** la valeur précédente était **inférieure à -1.0**

Condition 2 : Signal de retournement extrême - La Fisher Transform passe **au-dessus de -2.5** (zone de survente extrême)

Signaux de Vente (Short)

Condition 1 : Signal classique - La Fisher Transform croise **en-dessous** de sa ligne de déclenchement - **ET** la valeur précédente était **supérieure à +1.0**

Condition 2 : Signal de retournement extrême - La Fisher Transform passe en-dessous de +2.5 (zone de surachat extrême)

Gestion des Positions

- **Une seule position** à la fois
 - **Stop Loss** : $2 \times \text{ATR}$ sous/au-dessus du prix d'entrée
 - **Take Profit** : $4 \times \text{ATR}$ (ratio risque/récompense 2:1)
 - **Sortie** : Uniquement par SL ou TP
-

Installation et Configuration

Étape 1 : Installation du Fichier

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

MetaTrader 5/MQL5/Experts/

2. Redémarrez MetaTrader 5 ou appuyez sur F4 pour actualiser

Étape 2 : Compilation

1. Ouvrez MetaEditor (F4)
2. Ouvrez le fichier EhlersFisherEA.mq5
3. Compilez avec F7 ou cliquez sur "Compile"
4. Vérifiez qu'il n'y a pas d'erreurs

Étape 3 : Attachement au Graphique

1. Ouvrez un graphique EURUSD H1
 2. Glissez-déposez l'EA depuis le Navigator
 3. Configurez les paramètres (voir section suivante)
 4. Activez "Allow algorithmic trading"
 5. Cliquez sur "OK"
-

Paramètres de l'Expert Advisor

Fisher Transform Settings

Paramètre	Défaut	Description
FisherPeriod	10	Période de calcul de la Fisher Transform
EntryLevel	1.0	Niveau d'entrée (+/-) pour les signaux classiques
ExtremeLevel	2.5	Niveau extrême (+/-) pour les signaux de retournement

Risk Management

Paramètre	Défaut	Description
ATR_Period	14	Période de l'Average True Range
ATR_Multiplier	2.0	Multiplicateur ATR pour le Stop Loss
RiskReward	2.0	Ratio Risque/Récompense (2 = TP = 2xSL)
LotSize	0.1	Taille fixe du lot

Trading Settings

Paramètre	Défaut	Description
MagicNumber	700014	Numéro magique unique
TradeComment	“Fisher EA”	Commentaire des ordres

Gestion des Risques

Calcul du Stop Loss

Le Stop Loss est calculé selon la formule :

$$SL \text{ Long} = \text{Prix d'Entrée} - (\text{ATR} \times \text{ATR_Multiplier})$$

$$SL \text{ Short} = \text{Prix d'Entrée} + (\text{ATR} \times \text{ATR_Multiplier})$$

Calcul du Take Profit

Le Take Profit utilise le ratio risque/récompense :

$$TP \text{ Long} = \text{Prix d'Entrée} + (\text{ATR} \times \text{ATR_Multiplier} \times \text{RiskReward})$$

$$TP \text{ Short} = \text{Prix d'Entrée} - (\text{ATR} \times \text{ATR_Multiplier} \times \text{RiskReward})$$

Recommandations de Risque

- Lot Size** : Ne jamais risquer plus de 2% du capital par trade
- ATR_Multiplier** : 2.0 offre un bon équilibre (ajustable selon la volatilité)
- RiskReward** : 2.0 minimum pour compenser les faux signaux
- Diversification** : Ne pas utiliser sur plus de 3 paires simultanément

Signaux de Trading

Interprétation des Valeurs Fisher

Valeur Fisher	Interprétation	Action
> +2.5	Surachat extrême	Signal de vente potentiel
+1.0 à +2.5	Surachat	Zone de vigilance

Valeur Fisher	Interprétation	Action
-1.0 à +1.0	Zone neutre	Attendre confirmation
-2.5 à -1.0	Survente	Zone de vigilance
< -2.5	Survente extrême	Signal d'achat potentiel

Exemples de Signaux

Signal d'Achat Valide : 1. Fisher[2] = -1.5 (en zone de survente) 2. Fisher[1] = -0.8 (croise au-dessus de la ligne de déclenchement) 3. → Ouverture position LONG

Signal de Vente Valide : 1. Fisher[2] = +1.3 (en zone de surachat) 2. Fisher[1] = +0.9 (croise en-dessous de la ligne de déclenchement) 3. → Ouverture position SHORT

Optimisation

Paramètres Recommandés par Paire

Paire	FisherPeriod	ATR_Multiplier	Notes
EURUSD	10	2.0	Configuration standard
GBPUSD	8	2.5	Plus volatile
USDJPY	12	1.8	Moins volatile
AUDUSD	10	2.2	Volatilité moyenne

Paramètres par Timeframe

Timeframe	FisherPeriod	ATR_Period	ATR_Multiplier
M15	8	10	1.5
M30	10	12	1.8
H1	10	14	2.0
H4	12	16	2.5

Conseils d'Optimisation

1. **Backtest sur 1 an minimum** avec données de qualité
 2. **Forward test 3 mois** avant trading réel
 3. **Optimiser par étapes** (d'abord Fisher, puis ATR, puis lots)
 4. **Éviter l'over-optimization** (max 3 paramètres simultanés)
-

Dépannage

Problèmes Courants

- 1. L'EA ne génère pas de signaux** - Vérifiez que "Allow algorithmic trading" est activé - Contrôlez les paramètres EntryLevel et ExtremeLevel - Assurez-vous que les données historiques sont suffisantes
- 2. Erreur "Invalid stops"** - Le spread est trop important - L'ATR_Multiplier est trop faible - Vérifiez les stops minimum du broker
- 3. L'EA s'arrête de fonctionner** - Redémarrez MetaTrader 5 - Vérifiez la connexion Internet - Contrôlez les logs dans l'onglet "Expert"
- 4. Positions non ouvertes** - Vérifiez le solde disponible - Contrôlez la marge libre - Assurez-vous que le trading est autorisé sur le compte

Messages d'Erreur Typiques

Code Erreur	Description	Solution
10006	No money	Solde insuffisant
10016	Off quotes	Spread trop élevé
10018	Market closed	Marché fermé
10019	Not enough money	Marge insuffisante

Avertissements et Disclaimer

Avertissement sur les Risques

! ATTENTION : Le trading sur le Forex comporte des risques élevés de perte. Cet Expert Advisor est un outil d'assistance et ne garantit pas de profits.

Recommandations Importantes

- Test en Demo** : Testez toujours en compte démo avant utilisation réelle
- Capital de Risque** : N'investissez que l'argent que vous pouvez vous permettre de perdre
- Surveillance** : Surveillez régulièrement les performances de l'EA
- Conditions de Marché** : L'EA peut mal performer en période de forte volatilité ou d'annonces économiques importantes

Limitation de Responsabilité

L'auteur de cet Expert Advisor décline toute responsabilité pour les pertes financières résultant de son utilisation. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.

Support et Mises à Jour

Pour le support technique et les mises à jour : - Consultez les logs MetaTrader pour diagnostiquer les problèmes - Documentez précisément les conditions du problème - Sauvegardez régulièrement vos paramètres optimaux

Copyright © 2025 Claude Code - Tous droits réservés

Ce manuel constitue la documentation officielle de l'Expert Advisor EhlersFisherEA. Toute reproduction partielle ou totale est interdite sans autorisation.