

MonthEndRebalEA - Manuel d'Utilisation

Expert Advisor pour MetaTrader 5

Version : 1.00

Stratégie : Rééquilibrage de Fin de Mois - Flux FX Institutionnels

Table des Matières

1. Introduction
 2. Principe de la Stratégie
 3. Installation et Configuration
 4. Paramètres de l'EA
 5. Fonctionnement Détailé
 6. Gestion des Risques
 7. Optimisation et Backtesting
 8. FAQ et Dépannage
 9. Avertissements Légaux
-

Introduction

MonthEndRebalEA est un Expert Advisor sophistiqué conçu pour exploiter les flux de rééquilibrage institutionnels qui se produisent systématiquement en fin de mois sur le marché des changes. Cette stratégie s'appuie sur un phénomène bien documenté dans les marchés financiers : les institutions financières procèdent à des rééquilibrages de portefeuille prévisibles durant les derniers jours de trading de chaque mois.

Avantages Clés

- Stratégie basée sur des flux institutionnels prévisibles
 - Approche de mean reversion (retour à la moyenne)
 - Gestion automatique des risques avec SL/TP
 - Une seule position par mois pour limiter l'exposition
 - Compatible avec tous les timeframes (recommandé : D1)
-

Principe de la Stratégie

Le Phénomène de Rééquilibrage de Fin de Mois

Les institutions financières (fonds de pension, gestionnaires d'actifs, banques centrales) effectuent des rééquilibrages de portefeuille mensuels pour maintenir leurs allocations d'actifs cibles. Ce processus crée des flux FX prévisibles :

1. **Analyse du mouvement mensuel USD** : L'EA surveille la performance du dollar américain durant le mois
2. **Anticipation du rééquilibrage** : Si l'USD s'est affaibli, les institutions vont probablement acheter USD en fin de mois
3. **Positionnement contraire** : L'EA prend une position inverse au mouvement du mois (mean reversion)

Logique de Trading

Pour les paires avec USD en devise de cotation (EURUSD, GBPUSD, etc.) : - Si USD s'est renforcé durant le mois → **ACHAT** (anticipation d'un affaiblissement USD) - Si USD s'est affaibli durant le mois → **VENTE** (anticipation d'un renforcement USD)

Pour les paires avec USD en devise de base (USDCAD, USDCHF, etc.) :
- Si USD s'est renforcé durant le mois → **VENTE** (anticipation d'un affaiblissement USD) - Si USD s'est affaibli durant le mois → **ACHAT** (anticipation d'un renforcement USD)

Timing d'Exécution

- **Entrée** : 3 derniers jours ouvrables du mois
- **Sortie** : 1er ou 2e jour du nouveau mois (sortie temporelle) ou SL/TP

Installation et Configuration

Prérequis

- MetaTrader 5 (build 3600 ou supérieur)
- Compte de trading avec spread compétitif
- Connexion internet stable
- Autorisation du trading automatique activée

Installation

1. **Téléchargement** : Copiez le fichier MonthEndRebalance.mq5 dans le dossier :

MetaTrader 5/MQL5/Experts/

2. **Compilation** :

- Ouvrez MetaEditor (F4 dans MT5)

- Ouvrez le fichier MonthEndRebalEA.mq5
- Compilez (F7) - aucune erreur ne doit apparaître

3. Autorisation :

- Allez dans Outils → Options → Expert Advisors
- Cochez “Autoriser le trading automatique”
- Cochez “Autoriser l’import de DLL” si nécessaire

Configuration Initiale

1. **Graphique recommandé** : EURUSD D1
 2. **Glissez l’EA** depuis le Navigateur vers le graphique
 3. **Configurez les paramètres** selon vos préférences de risque
 4. **Cliquez OK** pour activer
-

Paramètres de l’EA

STRATEGY SETTINGS (Paramètres de Stratégie)

Paramètre	Valeur par Défaut	Description
InpMagicNumber	700061	Numéro magique unique pour identifier les positions de cet EA
InpLotSize	0.1	Taille de lot pour chaque position
InpStopLoss	100	Stop Loss en pips (protection large pour tenue multi-jours)
InpTakeProfit	50	Take Profit en pips
InpEntryDays	3	Nombre de jours avant la fin du mois pour entrer en position

TIME SETTINGS (Paramètres de Temps)

Paramètre	Valeur par Défaut	Description
InpUseTimeFilter	true	Activer le filtre horaire
InpStartTime	“08:00”	Heure de début des trades (heure serveur)
InpEndTime	“17:00”	Heure de fin des trades (heure serveur)

RISK MANAGEMENT (Gestion des Risques)

Paramètre	Valeur par Défaut	Description
InpUseMaxSpread	true	Utiliser le filtre de spread maximum
InpMaxSpread	3.0	Spread maximum autorisé en pips
InpOneTrade	true	Une seule position par mois

Fonctionnement Détaillé

Cycle de Trading Mensuel

Phase 1 : Analyse Mensuelle (1er - 25e jour)

- L'EA enregistre le prix de clôture du premier jour du mois
- Calcul continu du mouvement mensuel USD
- Aucune position n'est ouverte durant cette période

Phase 2 : Fenêtre d'Entrée (3 derniers jours ouvrables)

- L'EA surveille les conditions d'entrée
- Vérification des filtres (spread, horaires)
- Exécution du trade selon la logique de mean reversion

Phase 3 : Gestion de Position (Fin de mois)

- Surveillance des SL/TP
- Maintien de la position à travers la fin du mois
- Pas de nouvelles entrées tant qu'une position est active

Phase 4 : Sortie Temporelle (Début du nouveau mois)

- Clôture automatique les 1er ou 2e jours du nouveau mois
- Réinitialisation pour le cycle suivant

Calcul du Mouvement USD

L'EA utilise une logique adaptée selon le type de paire :

Paires USD/XXX (USD en base) :

Mouvement USD = Prix Actuel – Prix Début Mois

Paires XXX/USD (USD en cotation) :

Mouvement USD = Prix Début Mois – Prix Actuel

Interprétation : - Valeur positive = USD renforcé - Valeur négative = USD affaibli

Filtres de Sécurité

1. **Filtre de Spread** : Évite les trades pendant les périodes de volatilité extrême
 2. **Filtre Horaire** : Limite les trades aux heures de marché actif
 3. **Une Position par Mois** : Évite la sur-exposition
-

Gestion des Risques

Risques Principaux

1. **Risque de Marché** : Les flux institutionnels peuvent être imprévisibles
2. **Risque de Liquidité** : Spreads élargis en fin de mois
3. **Risque de Gap** : Ouvertures avec gaps le weekend
4. **Risque de Corrélation** : Événements macro imprévus

Mesures de Protection

Stop Loss Adaptatif

- **100 pips par défaut** : Suffisant pour les fluctuations multi-jours
- **Ajustement recommandé** : Selon la volatilité de la paire tradée

Take Profit Conservateur

- **50 pips par défaut** : Ratio risque/rendement de 1:0.5
- **Sortie temporelle** : Limite l'exposition au-delà du cycle mensuel

Gestion du Capital

- **Lot Size** : Ne risquez jamais plus de 2% du capital par trade
- **Diversification** : Testez sur plusieurs paires USD majeures
- **Drawdown Maximum** : Arrêtez l'EA si le drawdown dépasse 10%

Recommandations de Money Management

Taille du Compte	Lot Size Recommandé	Risque par Trade
\$1,000 - \$2,500	0.01	1-2%
\$2,500 - \$10,000	0.05	1.5-2%
\$10,000 - \$25,000	0.1	1-2%
\$25,000+	0.2+	1-1.5%

Optimisation et Backtesting

Paramètres à Optimiser

1. **InpEntryDays** : Testez 2-5 jours
2. **InpStopLoss** : Testez 80-150 pips
3. **InpTakeProfit** : Testez 30-80 pips
4. **Filtres horaires** : Adaptez à votre fuseau horaire

Période de Test Recommandée

- **Minimum** : 2 ans de données historiques
- **Optimal** : 5+ ans incluant différents cycles de marché
- **Timeframe** : D1 (recommandé) ou H4

Métriques Importantes

- **Profit Factor** : Cible > 1.5
- **Drawdown Maximum** : Cible < 15%
- **Pourcentage de Trades Gagnants** : Cible > 55%
- **Sharpe Ratio** : Cible > 0.8

Paires Recommandées pour le Backtesting

1. **EURUSD** - Paire principale, liquidité élevée
 2. **GBPUSD** - Volatilité intéressante
 3. **USDCAD** - Corrélations commodities
 4. **AUDUSD** - Sensibilité risk-on/risk-off
 5. **USDJPY** - Flows institutionnels importants
-

FAQ et Dépannage

Questions Fréquentes

Q : Pourquoi l'EA n'ouvre-t-il pas de position ? R : Vérifiez : - Que vous êtes dans la fenêtre des 3 derniers jours du mois - Le spread n'est pas trop élevé - Vous êtes dans les heures de trading configurées - Aucune position n'est déjà ouverte (si InpOneTrade = true)

Q : L'EA ferme-t-il automatiquement les positions ? R : Oui, les positions sont fermées automatiquement : - Au Stop Loss ou Take Profit - Les 1er ou 2e jours du nouveau mois - Si vous désactivez l'EA

Q : Puis-je utiliser plusieurs instances sur différentes paires ? R : Oui, mais utilisez des Magic Numbers différents pour chaque paire.

Q : La stratégie fonctionne-t-elle sur les comptes ECN ? R : Oui, l'EA est compatible avec tous les types de comptes.

Messages d'Erreur Courants

Erreur	Cause Probable	Solution
“Trade context is busy”	Autre EA ou trade manuel en cours	Attendez ou fermez les autres EAs
“Not enough money”	Insufficient funds	Réduisez la taille de lot
“Invalid stops”	SL/TP trop proches du prix	Augmentez les distances
“Market is closed”	Marché fermé	Attendez l'ouverture du marché

Optimisation des Performances

- 1. VPS Recommandé** : Pour éviter les déconnexions
- 2. Spread Faible** : Choisissez un broker avec spreads compétitifs
- 3. Latence Réduite** : Serveur proche de votre broker
- 4. Monitoring** : Surveillez les performances mensuellement

Avertissements Légaux

Clause de Non-Responsabilité

IMPORTANT : Le trading sur le Forex est hautement spéculatif et comporte un risque de perte significatif. Cet Expert Advisor est fourni uniquement à des fins éducatives et d'information. L'utilisation de cet outil de trading automatique est entièrement à vos risques et périls.

Risques Inhérents

- Perte de Capital** : Vous pouvez perdre tout ou partie de votre investissement
- Pas de Garantie** : Aucune performance passée ne garantit des résultats futurs
- Volatilité de Marché** : Les marchés peuvent être imprévisibles
- Risque Technologique** : Pannes techniques, déconnexions possible

Recommandations Prudentielles

- 1. Tests Approfondis** : Testez toujours sur compte démo avant utilisation réelle
- 2. Capital Limité** : N'investissez que ce que vous pouvez vous permettre de perdre
- 3. Surveillance Continue** : Monitorer régulièrement les performances
- 4. Formation Continue** : Comprendre les marchés avant d'automatiser
- 5. Conseil Professionnel** : Consultez un conseiller financier si nécessaire

Contact et Support

Pour toute question technique ou commerciale concernant MonthEndRebalEA, veuillez consulter la documentation complète ou contacter le développeur via les canaux officiels.

Développé avec ❤ pour la communauté MetaTrader 5

Dernière mise à jour : Février 2026

Version du manuel : 1.0

Compatible avec MT5 Build 3600+