

SessionOverlapEA - Manuel d'utilisation

Version : 1.00

Auteur : Laurent Jarvis

Date : Février 2024

Table des matières

1. Présentation de la stratégie
 2. Installation et configuration
 3. Paramètres de l'Expert Advisor
 4. Fonctionnement détaillé
 5. Gestion des risques
 6. Optimisation et backtesting
 7. Dépannage
-

Présentation de la stratégie

Concept principal

Le **SessionOverlapEA** exploite la volatilité maximale créée par le chevauchement des sessions de trading de Londres et de New York (13:00-17:00 GMT). Cette période concentre la plus grande liquidité et les mouvements les plus prévisibles du marché des changes.

Avantages de cette approche

- **Haute liquidité** : Réduction des spreads et de la manipulation
- **Volatilité contrôlée** : Mouvements directionnels plus clairs
- **Fenêtre temporelle définie** : Évite les périodes de faible activité
- **Confirmation par le volume** : Validation des signaux d'entrée

Instruments recommandés

- **Principal** : EUR/USD (paire la plus liquide)
 - **Alternatifs** : GBP/USD, USD/JPY, AUD/USD
 - **Timeframe** : M5 (5 minutes) - optimal pour cette stratégie
-

Installation et configuration

Étape 1 : Installation de l'EA

1. Copiez le fichier SessionOverlapEA.mq5 dans le dossier :
[Dossier de données]/MQL5/Experts/
2. Redémarrez MetaTrader 5 ou rafraîchissez le navigateur (F5)
3. L'EA apparaît dans le navigateur sous "Experts Advisors"

Étape 2 : Configuration du graphique

1. Ouvrez un graphique EUR/USD en M5
2. Définissez le fuseau horaire sur GMT
3. Assurez-vous que l'historique est complet (minimum 1000 barres)

Étape 3 : Application de l'EA

1. Glissez-déposez l'EA sur le graphique
2. Dans l'onglet "Paramètres d'entrée", configurez selon vos besoins
3. Dans l'onglet "Commun", cochez :
 - ☒ Autoriser le trading automatisé
 - ☒ Autoriser les importations DLL (si nécessaire)
 - ☒ Autoriser les importations de bibliothèques externes

Paramètres de l'Expert Advisor

Paramètres principaux

Paramètre	Type	Défaut	Description
LotSize	double	0.01	Taille de position (0.01 = micro-lot)
ATRMultiplier	double	0.5	Multiplicateur ATR pour déclenchement
VolumeMultiplier	double	1.5	Multiplicateur de volume de confirmation
ATRPeriod	int	14	Période de calcul de l'ATR
VolumePeriod	int	20	Période pour la moyenne des volumes
UseTrailingStop	bool	true	Activer le trailing stop
MagicNumber	int	700075	Numéro magique (identifiant unique)

Configuration recommandée

Pour débutants : - LotSize : 0.01 (micro-lot) - ATRMultiplier : 0.5 (sensibilité standard) - VolumeMultiplier : 1.5 (confirmation modérée)

Pour traders expérimentés : - LotSize : 0.1 (mini-lot) - ATRMultiplier : 0.3-0.7 (ajustable selon volatilité) - VolumeMultiplier : 2.0 (confirmation plus stricte)

Fonctionnement détaillé

Phase 1 : Détection de session (13:00-17:00 GMT)

L'EA surveille en permanence l'heure GMT et active le trading uniquement pendant la fenêtre 13:00-17:00. En dehors de cette période : - Toutes les positions ouvertes sont fermées - Aucune nouvelle position n'est ouverte - L'EA reste en veille

Phase 2 : Attente du signal d'entrée (13:00-13:15 GMT)

Durant les **15 premières minutes** de la session :

1. **Calcul de l'ATR** : Mesure de la volatilité récente
2. **Analyse du mouvement** : Détection d'un mouvement directionnel
3. **Seuil de déclenchement** : Le mouvement doit dépasser $ATR \times ATRMultiplier$
4. **Confirmation volume** : Le volume tick doit être $> Volume\ moyen \times VolumeMultiplier$

Phase 3 : Ouverture de position

Une fois les conditions réunies :

1. **Détermination de la direction** :
 - LONG si le prix est plus proche du haut de la fourchette
 - SHORT si le prix est plus proche du bas de la fourchette
2. **Calculs des niveaux** :
 - **Stop Loss** : Extrémité opposée du mouvement initial
 - **Take Profit** : $2 \times$ le mouvement initial projeté dans la direction

Phase 4 : Gestion de position

Trailing Stop automatique : - Déclenché après un profit de 1R (Risk/Reward ratio) - Suit le mouvement en maintenant une distance équivalente au mouvement initial - Protection contre les retournements brusques

Sortie obligatoire : - Fermeture automatique de toutes les positions à 17:00 GMT - Évite les risques liés aux périodes de faible liquidité

Gestion des risques

Risque par transaction

- **Risque maximum** : Défini par la distance au Stop Loss
- **Recommandation** : Ne pas risquer plus de 1-2% du capital par trade
- **Calcul de la taille de position** :

$$\text{Lot Size} = (\text{Capital} \times \% \text{ Risque}) / (\text{Distance SL en pips} \times \text{Valeur du pip})$$

Protection du capital

1. **Stop Loss systématique** : Aucune position sans SL
2. **Take Profit automatique** : Ratio Risk/Reward 1:2 minimum
3. **Trailing Stop** : Protection des profits acquis
4. **Limite temporelle** : Fermeture obligatoire en fin de session

Monitoring recommandé

- Vérification quotidienne du journal de trading
 - Surveillance des performances hebdomadaires
 - Ajustement des paramètres selon les conditions de marché
-

Optimisation et backtesting

Périodes de test recommandées

- **Minimum** : 3 mois de données
- **Optimal** : 12 mois incluant différentes conditions de marché
- **Données** : Tick data ou M1 pour plus de précision

Paramètres à optimiser

1. **ATRMultiplicateur** (0.3 - 1.0)
 - Plus faible = Plus de signaux, plus de bruit
 - Plus élevé = Moins de signaux, plus de qualité
2. **VolumeMultiplicateur** (1.2 - 3.0)
 - Plus faible = Plus de confirmations
 - Plus élevé = Confirmations plus strictes
3. **LotSize** (selon le capital disponible)

Métriques d'évaluation

- **Profit Factor** : > 1.3 souhaitable
 - **Max Drawdown** : < 15% du capital
 - **Win Rate** : 45-60% acceptable avec RR 1:2
 - **Sharpe Ratio** : > 1.0 préférable
-

Dépannage

Problèmes courants

L'EA ne prend pas de positions : 1. Vérifiez que le trading automatique est activé 2. Confirmez que vous êtes dans la fenêtre 13:00-17:00 GMT 3. Vérifiez la connexion au serveur de trading 4. Contrôlez les paramètres de volume minimum du broker

Positions fermées prématurément : 1. Vérifiez les marges disponibles 2. Confirmez les paramètres du Stop Loss 3. Vérifiez les messages d'erreur dans le journal

Résultats différents du backtest : 1. Contrôlez les spreads variables en temps réel 2. Vérifiez la latence de connexion 3. Confirmez que le mode de remplissage est compatible

Messages d'erreur fréquents

Code	Signification	Solution
134	Volume insuffisant	Réduire LotSize
135	Prix invalide	Vérifier la connexion
136	Marché fermé	Attendre l'ouverture
146	Trading désactivé	Activer le trading auto

Support et maintenance

- **Logs** : Consultez régulièrement l'onglet "Journal"
- **Performance** : Surveillez l'onglet "Historique du compte"
- **Mises à jour** : Vérifiez périodiquement les nouvelles versions

Avertissement sur les risques

⚠ Important : Le trading sur le Forex comporte des risques significatifs de perte. Cette stratégie, bien que testée, ne garantit pas des profits. Utilisez uniquement du capital que vous pouvez vous permettre de perdre.

- Ne tradez jamais avec de l'argent emprunté
- Commencez avec un compte démo
- Respectez strictement votre plan de gestion des risques
- Ajustez les paramètres selon votre tolérance au risque

Bonne chance dans vos trades ! 📈

Pour toute question technique, consultez la documentation MQL5 officielle ou les forums de trading spécialisés.