

SwapDiffEA - Manuel d'utilisation

Expert Advisor pour l'exploitation des différentiels de swap
Version 1.0 | MQL5 | MetaTrader 5

Table des matières

1. [Introduction](#)
2. [Stratégie de trading](#)
3. [Installation](#)
4. [Paramètres de configuration](#)
5. [Fonctionnement détaillé](#)
6. [Gestion des risques](#)
7. [Optimisation](#)
8. [Dépannage](#)
9. [Avertissements](#)

Introduction

SwapDiffEA est un Expert Advisor sophistiqué conçu pour exploiter les différentiels de taux de swap sur le marché des changes. Cette stratégie tire parti des coûts de financement asymétriques entre les positions longues et courtes pour générer des profits tout en respectant des confirmations techniques strictes.

Principe fondamental

Les taux de swap représentent le coût ou le gain de maintenir une position ouverte pendant la nuit. Lorsqu'un sens de trading présente un swap positif significatif, cela peut créer une opportunité d'arbitrage, particulièrement sur les timeframes longs.

Avantages clés

- **Exploitation des inefficiencies du marché** : Profite des déséquilibres de taux d'intérêt
- **Confirmation technique** : Combine analyse fondamentale (swap) et technique (EMA)
- **Gestion progressive des positions** : Système de scaling intelligent
- **Protection robuste** : Stop-loss basés sur l'ATR et sorties conditionnelles

Stratégie de trading

1. Analyse des taux de swap

L'EA surveille en continu les taux de swap long et short du symbole tradé :

- **Swap Long** : Coût/gain pour maintenir une position acheteuse
- **Swap Short** : Coût/gain pour maintenir une position vendeuse

Critère de sélection : - Le swap doit être positif ET supérieur à 1 point minimum - La direction privilégiée est celle avec le swap le plus favorable

2. Confirmation technique

Une fois la direction de swap favorable identifiée, l'EA attend une confirmation technique basée sur l'EMA 100 :

- **Position longue** : Prix au-dessus de l'EMA 100
- **Position courte** : Prix en-dessous de l'EMA 100

3. Gestion des positions

Entrée initiale

- Ouverture d'une position dans la direction favorable au swap
- Lot de base configurable
- Stop-loss fixé à 3x ATR de distance

Scaling (Ajouts de positions)

- Maximum 3 positions simultanées
- Ajout sur retournements favorables (pullbacks)
- Distance minimum entre entrées : 50 points par défaut
- Multiplication des lots : 1.5x par défaut

4. Sorties

L'EA ferme toutes les positions dans les cas suivants :

- **Swap défavorable** : Le taux de swap devient négatif
- **Cassure technique** : Prix croise l'EMA 100 contre la position
- **Stop-loss individuel** : Chaque position a sa protection ATR

Installation

1. Prérequis

- MetaTrader 5 (build 3440 ou supérieur)
- Compte de trading avec accès aux données de swap
- Connexion internet stable

2. Installation de l'EA

1. Copier le fichier SwapDiffEA.mq5 dans le dossier :

MetaTrader 5/MQL5/Experts/

2. Compiler l'EA :

- Ouvrir MetaEditor
- Ouvrir le fichier SwapDiffEA.mq5
- Appuyer sur F7 ou cliquer sur “Compiler”
- Vérifier l'absence d'erreurs

3. Attacher à un graphique :

- Ouvrir le graphique du symbole désiré (EURUSD recommandé)
- Glisser-déposer l'EA depuis le Navigator
- Configurer les paramètres
- Cliquer sur “OK”

3. Permissions requises

Vérifier que les permissions suivantes sont activées : - Autoriser les trades automatiques - Autoriser les modifications de positions - Autoriser l'accès aux données de marché

Paramètres de configuration

Paramètres de trading

Paramètre	Valeur par défaut	Description
InpSymbol	“EURUSD”	Symbol à trader
InpTimeframe	D1	Période d'analyse
InpLotSize	0.1	Taille de lot de base
InpMagicNumber	700060	Numéro magique unique
InpMinSwapPoints	1.0	Swap minimum significatif

Indicateurs techniques

Paramètre	Valeur par défaut	Description
InpEmaPeriod	100	Période de l'EMA
InpAtrPeriod	14	Période de l'ATR
InpAtrMultiplier	3.0	Multiplicateur pour stop-loss

Gestion des positions

Paramètre	Valeur par défaut	Description
InpMaxPositions	3	Nombre maximum de positions

Paramètre	Valeur par défaut	Description
InpScaleDistance	50.0	Distance de scaling (points)
InpScaleMultiplier	1.5	Multiplicateur de lots

Gestion des risques

Paramètre	Valeur par défaut	Description
InpMaxRiskPercent	2.0	Risque maximum par position (%)
InpUseFixedLots	true	Utiliser des lots fixes

Fonctionnement détaillé

1. Cycle d'analyse

À chaque tick, l'EA effectue les vérifications suivantes :

1. Mise à jour des taux de swap
2. Calcul des indicateurs (EMA, ATR)
3. Vérification des conditions de sortie
4. Évaluation des opportunités d'entrée
5. Analyse des conditions de scaling

2. Logique de décision

Détermination de la direction privilégiée

```
if (swapLong > 1.0 && swapLong > abs(swapShort))
    Direction = LONG
else if (swapShort > 1.0 && swapShort > abs(swapLong))
    Direction = SHORT
else
    Direction = AUCUNE
```

Confirmation d'entrée

```
if (Direction == LONG && Prix > EMA100)
    OUVRIR_POSITION_LONGUE()
else if (Direction == SHORT && Prix < EMA100)
    OUVRIR_POSITION_COURTE()
```

3. Calcul des niveaux

Stop-loss basé sur l'ATR

```
SL_Distance = ATR_actuel × 3.0
SL_Long = Prix_entrée - SL_Distance
SL_Short = Prix_entrée + SL_Distance
```

Sizing des positions

- **Mode fixe** : Lot × Multiplicateur^{nombre_positions}
 - **Mode risque** : (Capital × %Risque) / (Distance_SL × Valeur_tick)
-

Gestion des risques

1. Contrôles intégrés

- **Stop-loss automatique** : 3x ATR sur chaque position
- **Limitation du nombre de positions** : Maximum 3 simultanées
- **Surveillance des swaps** : Fermeture si swap devient négatif
- **Confirmation technique obligatoire** : EMA 100

2. Risques spécifiques aux swaps

⚠ **Attention** : Les taux de swap peuvent changer : - **Mercredi soir** : Triple swap (weekend) - **Événements économiques** : Modifications des taux directeurs - **Volatilité de marché** : Impact sur les spreads bid/ask

3. Recommandations

1. **Capital** : Ne pas risquer plus de 2% du capital par position
 2. **Diversification** : Tester sur plusieurs symboles
 3. **Surveillance** : Vérifier régulièrement les taux de swap
 4. **Backtesting** : Tester sur données historiques avec swaps réalistes
-

Optimisation

1. Paramètres à optimiser

Paramètres principaux

- **InpMinSwapPoints** : Entre 0.5 et 2.0
- **InpEmaPeriod** : Entre 50 et 200
- **InpAtrMultiplier** : Entre 2.0 et 4.0

Paramètres de scaling

- **InpScaleDistance** : Entre 20 et 100 points

- **InpScaleMultiplier** : Entre 1.2 et 2.0

2. Méthode d'optimisation

1. **Données historiques** : Minimum 1 an avec swaps réalistes
2. **Métriques** :
 - Profit Factor > 1.5
 - Drawdown < 15%
 - Sharpe Ratio > 1.0
3. **Validation** :
 - Test sur période out-of-sample
 - Forward testing en réel (micro-lots)

3. Symboles recommandés

Paire	Timeframe	Volatilité	Swaps typiques
EURUSD	D1	Modérée	Variables
GBPJPY	D1	Élevée	Souvent favorables
AUDUSD	D1	Modérée	Dépend des taux RBA
NZDUSD	D1	Modérée	Généralement positifs

Dépannage

1. Erreurs communes

“Invalid stops”

- **Cause** : Stop-loss trop proche du prix
- **Solution** : Augmenter **InpAtrMultiplier**

“Not enough money”

- **Cause** : Lot size trop élevé
- **Solution** : Réduire **InpLotSize** ou activer le mode risque

“Trade context busy”

- **Cause** : Trop de requêtes simultanées
- **Solution** : Attendre et réessayer

2. Problèmes de swap

Swaps négatifs inattendus

1. Vérifier les spécifications du symbole
2. Contacter le broker pour confirmation
3. Adapter **InpMinSwapPoints**

Positions fermées prématurément

- Vérifier la stabilité des taux de swap
- Analyser l'historique des modifications

3. Performance dégradée

Réduction des profits

1. Analyser les changements de marché
2. Ré-optimiser les paramètres
3. Vérifier la stabilité des swaps

Augmentation du drawdown

1. Réduire **InpLotSize**
 2. Augmenter **InpAtrMultiplier**
 3. Limiter le nombre de positions simultanées
-

Avertissements

⚠ Risques financiers

- **Trading automatisé** : Pertes rapides possibles
- **Effet de levier** : Amplification des gains ET des pertes
- **Volatilité** : Conditions de marché changeantes

⚠ Limitations techniques

- **Dépendance aux swaps** : Strategy inutile si swaps neutres
- **Slippage** : Écarts d'exécution possibles
- **Déconnexions** : Risque de positions non gérées

⚠ Responsabilités

- **Tests obligatoires** : Backtesting et forward testing requis
- **Surveillance continue** : Monitoring des performances nécessaire
- **Capital approprié** : Utiliser uniquement des fonds risquables



Clause de non-responsabilité

Cet Expert Advisor est fourni à des fins éducatives et de recherche. L'auteur décline toute responsabilité concernant les pertes financières pouvant résulter de son utilisation. Le trading automatisé comporte des risques significatifs et doit être pratiqué avec prudence.

Support et maintenance

Contact

- **Documentation** : Ce manuel
- **Code source** : Commenté et lisible
- **Tests** : Backtesting recommandé avant utilisation réelle

Mises à jour

- Vérification périodique des taux de swap
- Adaptation aux changements de marché
- Optimisation continue des paramètres

SwapDiffEA v1.0 - Expert Advisor pour MetaTrader 5
“*Exploitez les inefficiencies des taux de swap avec rigueur et discipline*”

Document généré le 16 février 2025 / Tous droits réservés