

Le trading des devises avec TA

1. Introduction

Ce document vous propose une véritable méthode de trading sur l'euro/dollar (EUR/USD) et la sterling/dollar (GBP/USD), d'autres devises viendront s'ajouter plus tard. C'est une méthode au sens où il est indiqué, pour chaque séance, des niveaux d'entrée, de stop et des objectifs très précis. Le système ne souffre d'aucune approximation. S'il peut paraître un peu complexe au premier abord, il n'en est rien. Une fois les différents éléments assimilés, la technique s'avère être d'une simplicité extrême car les différents cas de figures sont peu nombreux. Une fois ceux-ci assimilés, le passage d'ordres devient automatique. Seuls changent les niveaux qui vous seront proposés pour chaque séance.

2. Quelques définitions de termes utilisés

Heure d'ouverture : c'est une heure dans la matinée qui est différente chaque jour. Elle vous sera donnée dans la feuille de route. C'est l'heure à partir de laquelle on commence à placer les ordres s'il y a lieu. On remarquera que, souvent, la volatilité augmente à partir de cette heure. C'est toujours l'heure de Paris (CET l'hiver et CEST l'été).

Une séance : les devises cotent 24h/24h du dimanche soir au vendredi soir. Il n'y a donc pas de séance à proprement parler. Dans cette méthode, une séance correspond à la période qui va de l'heure d'ouverture de la veille à l'heure d'ouverture du jour (soit environ 24h). Pour des raisons de commodités, tous les ordres sont soldés à 22h, quelle que soit la situation.

Cassure à la hausse d'un niveau : moment où l'on cote 30 pips au-dessus de ce niveau après avoir touché le dit niveau. *Par exemple, le niveau qui nous intéresse est à 1,4133\$. On cote cette valeur et 30 minutes plus tard, on cote 1,4163\$, on considère le niveau comme cassé à la hausse.* Cette notion de « cassure » est fondamentale à intégrer pour la compréhension de la suite du document. Chaque fois qu'il sera écrit « cassure à la baisse du niveau rouge » il faudra comprendre « 30 pips sous le niveau rouge ». C'est valable dans l'autre sens et également pour le niveau vert.

Cassure à la baisse d'un niveau : même chose mais 30 pips en dessous du niveau considéré.

Niveau S : c'est le sommet de la séance (relire définition d'une séance) qui précède celle du jour. Ce niveau n'est utilisé que pour les trades B.

Niveau C : c'est le point le plus bas de la séance qui précède celle du jour. Ce niveau n'est utile que pour les trades B.

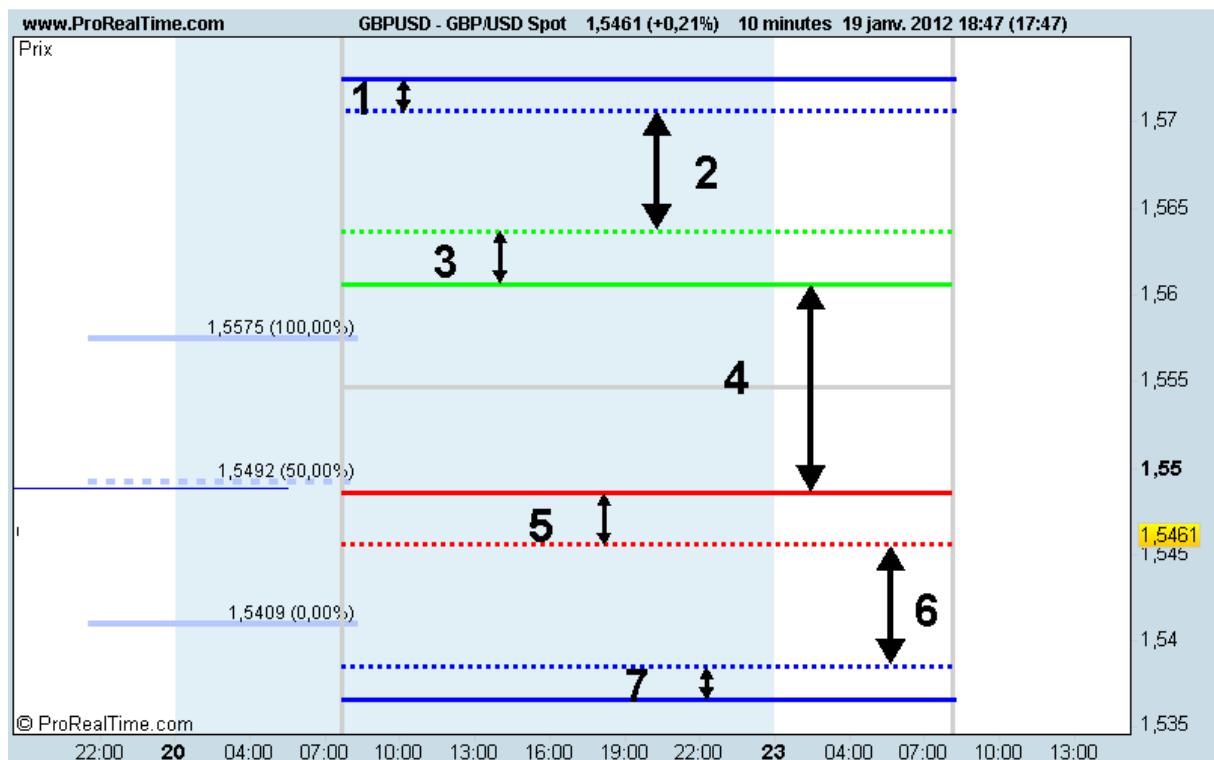
Niveau M : c'est le point médian entre S et C. Ces 3 points doivent rapidement être déterminés dès l'heure d'ouverture (ou parfois avant si S et C sont assez éloignés du cours peu avant l'ouverture). Ce niveau n'est utile que pour les trades A.

3. Comment préparer son espace de travail

Au début de chaque semaine, il vous sera remis un document vous indiquant différents niveaux avec une codification précise (niveaux rouges, niveaux verts, objectifs bleus et objectifs gris) ainsi que l'heure d'ouverture de chaque séance.

Avant l'heure d'ouverture, il faut donc placer les différents niveaux horizontaux de la feuille de route ainsi qu'une ligne verticale qui symbolisera le début de la séance. Placez également les points S, C et M. Il est préférable d'utiliser un graphique en unité de temps 10 minutes. Pour relever le cours de l'ouverture, il faut bien sûr passer en UT 1 minute pour être précis.

Votre graphique (graph 1) ressemblera alors à ceci :



Sur le graphique ci-dessus, les points S, C et M sont notés 100%, 0% et 50% (j'ai utilisé l'outil des retracements de Fibonacci sur le logiciel ProRealTime). J'ai également ajouté 4 lignes en traits interrompus. Les lignes interrompues vertes et rouges représentent la rupture des niveaux verts et rouges (30 pips). Les lignes bleues interrompues sont à 20 pips des lignes bleues, nous verrons leur utilité plus tard. Dans la pratique, on ne dessine pas les lignes interrompues.

L'espace de travail est divisé en 7 secteurs pour plus de clarté lors des explications et de l'analyse des différents cas de figure. Il n'y a aucune prise de position dans les secteurs 1, 3, 5 ou 7.

4. Préparer les ordres

Il existe 2 types de trades notés A et B. Nous allons commencer par étudier le plus simple, le type B.

a) Trade de type B (noté trade B)

Les trades B sont réalisables **uniquement** en cas d'ouverture dans le **secteur n°4**. On visera alors l'objectif gris.

On achète le niveau rouge, stop à 30 pips, objectif gris (à 60 pips le plus souvent)

Et/ou on vend le niveau vert, stop à 30 pips, objectif gris (à 60 pips le plus souvent).

Conditions : le niveau d'ouverture de position (rouge ou vert) se situe à moins de 30 pips de S, C ou M ou alors pour le niveau rouge en deçà de C, pour le niveau vert au-delà de S. Dans les autres cas, on ne fait pas de trades B.

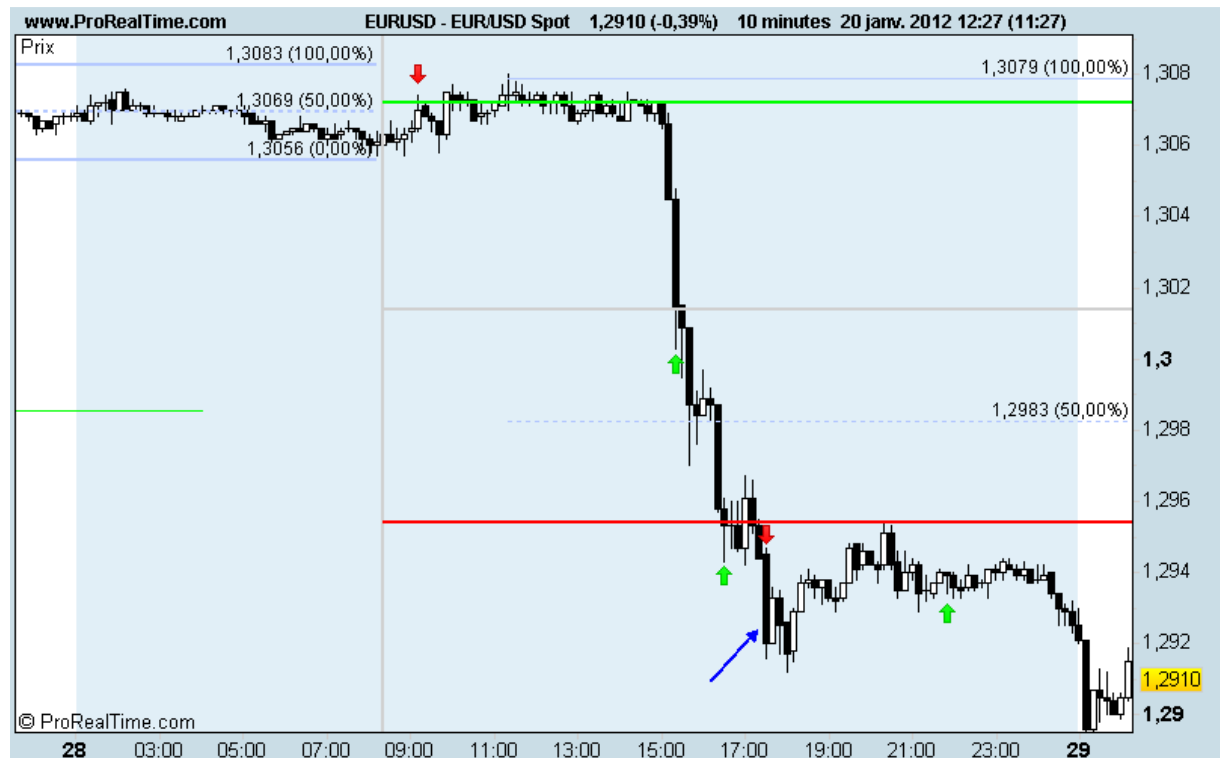
Les deux trades (achat du niveau rouge et vente du niveau vert) sont réalisables dans la même séance mais seulement une fois chacun (voir l'exemple du graph 10).

Quand on arrive à 10 pips de l'objectif gris, on abaisse le stop de 30 pips (perte potentielle réduite alors à 0).

Remarques :

- un trade B stoppé ouvre automatiquement un trade A (si les conditions pour initier un trade A sont réunies) sauf si le stop a été remonté comme précisé ci-dessus.
- une ouverture en dehors du secteur 4 élimine les trades B pour toute la séance.
- les niveaux S et C ne servent que pour ce type de trade.
- les trades B sont ceux qui proposent le meilleur rapport gain/risque. Il est de 2 la plupart du temps et pour certaines séances particulières de 4.

Exemple de trades B (graph 2) :



L'ouverture se fait en secteur 4. Le premier trade à tenter est donc de type B. Le niveau vert est à moins de 30 pips du niveau M (noté 50% sur ce graphique). Une position vendeuse sur l'euro est donc initiée peu après l'ouverture (première flèche rouge). Le stop est placé à 30 pips. La position est soldée dans l'après-midi sur l'objectif gris pour un gain de 60 pips (première flèche verte).

Plus tard, le niveau rouge est touché. Se trouvant sous le niveau C (noté 0% sur ce graphique), un nouveau trade B peut être tenté. On achète donc l'euro sur le niveau rouge (deuxième flèche verte) le stop est à 30 pips. Il est rapidement touché (deuxième flèche rouge au niveau de la flèche bleue). Au final, pour cette séance, les trades B auront rapporté 30 pips (60-30).

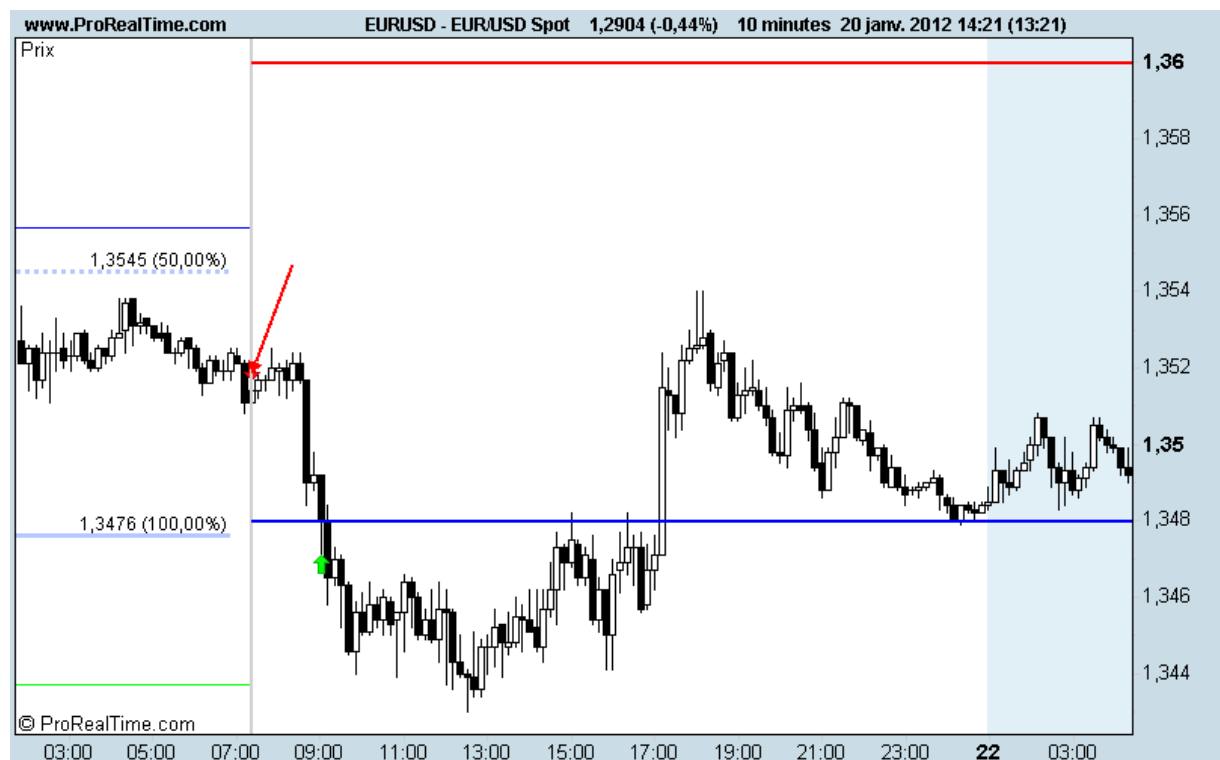
b) Trade de type A (noté trade A)

Les trades A sont réalisables dès l'ouverture ou sur rupture à la baisse d'un niveau rouge ou sur rupture à la hausse d'un niveau vert. On visera alors l'objectif bleu.

Pour initier un trade A dès l'ouverture, il faut que plusieurs conditions soient réunies.

A LA BAISSSE : si l'ouverture se fait dans le secteur 6, on jouera la baisse. On vend alors dès l'ouverture si et seulement si le cours d'ouverture se trouve sous le niveau M. Le stop est à 30 pips.

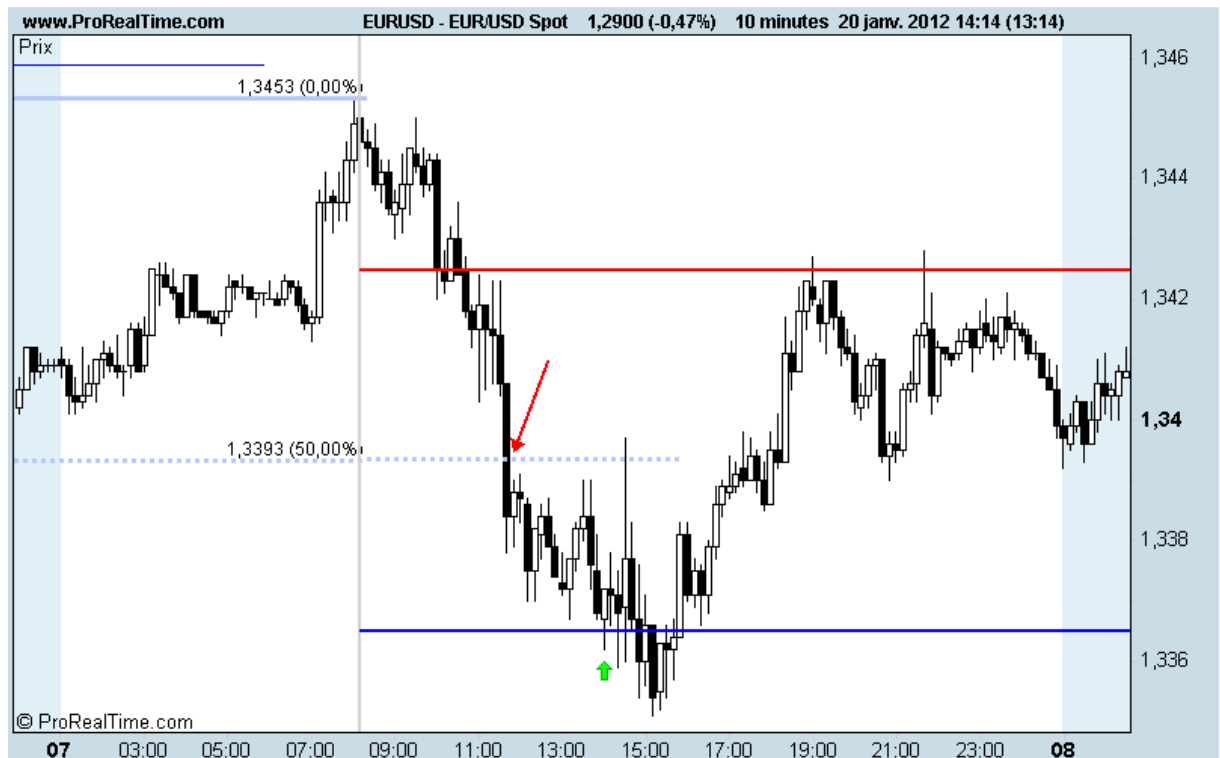
Exemple de vente dès l'ouverture (graph 3) :



L'ouverture se fait en secteur 6 sous le niveau M. On vend donc immédiatement (flèche rouge), stop à 30 pips, objectif bleu.

Si par contre on se trouve au-dessus du niveau M, on attendra le franchissement à la baisse de M pour vendre ce niveau (M) sauf s'il se trouve dans le secteur 7 (espérance de gain trop faible). Stop toujours à 30 pips.

Exemple de vente au passage du niveau M (graph 4) :



L'ouverture se fait en secteur 4. A la cassure à la baisse du niveau rouge, on se trouve au-dessus du niveau M (noté 50% sur le graphique), on ne peut donc pas vendre. On vend seulement au passage du niveau M (flèche rouge), stop à 30 pips, objectif bleu.

A LA HAUSSE : si l'ouverture se fait dans le secteur 2, on jouera la hausse. On achète alors dès l'ouverture si et seulement si le cours d'ouverture se trouve au-dessus de M. Le stop est à 30 pips. Tout est identique au paragraphe précédent sur la baisse, on change simplement de côté.

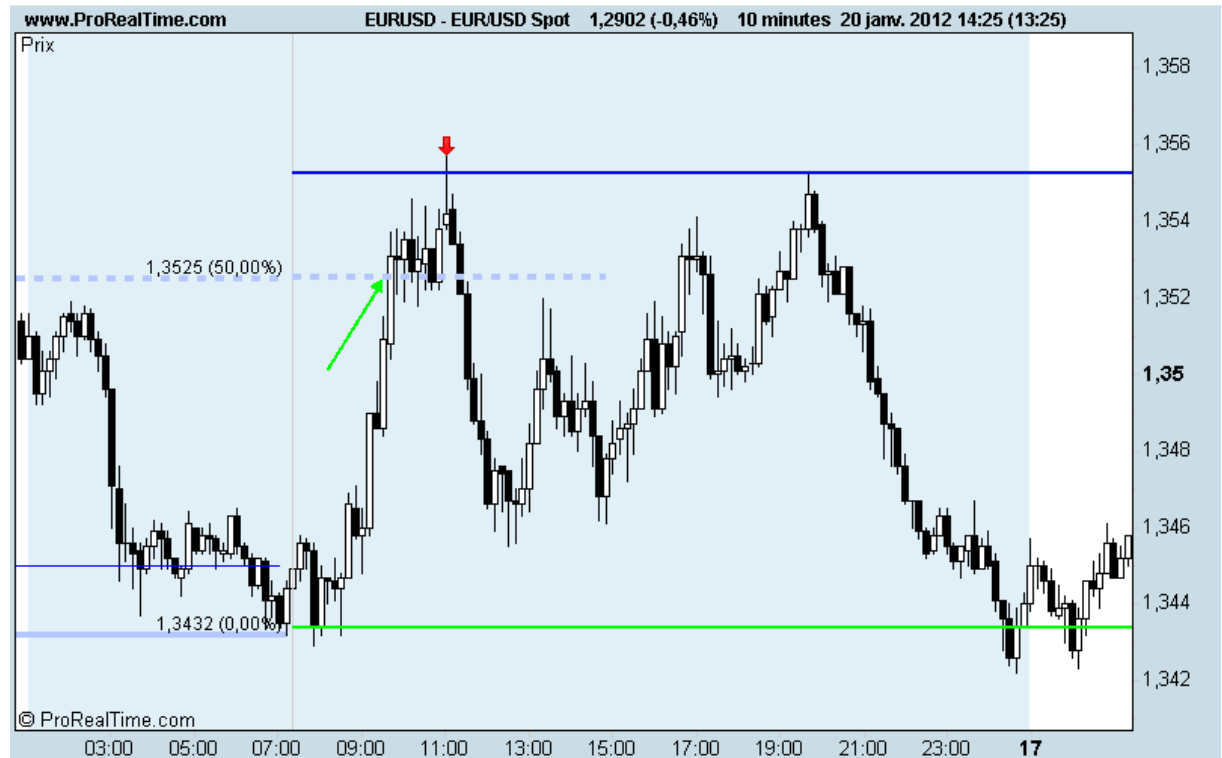
Exemple d'achat dès l'ouverture (graph 6) :



On ouvre en secteur 2, au-dessus de M (noté 50% sur ce graphique), on achète dès l'ouverture, stop à 30 pips, objectif bleu.

Si par contre on se trouve en-dessous du niveau M, on attendra le franchissement à la hausse de M pour acheter ce niveau (M) sauf s'il se trouve dans le secteur 1 (espérance de gain trop faible). Stop toujours à 30 pips.

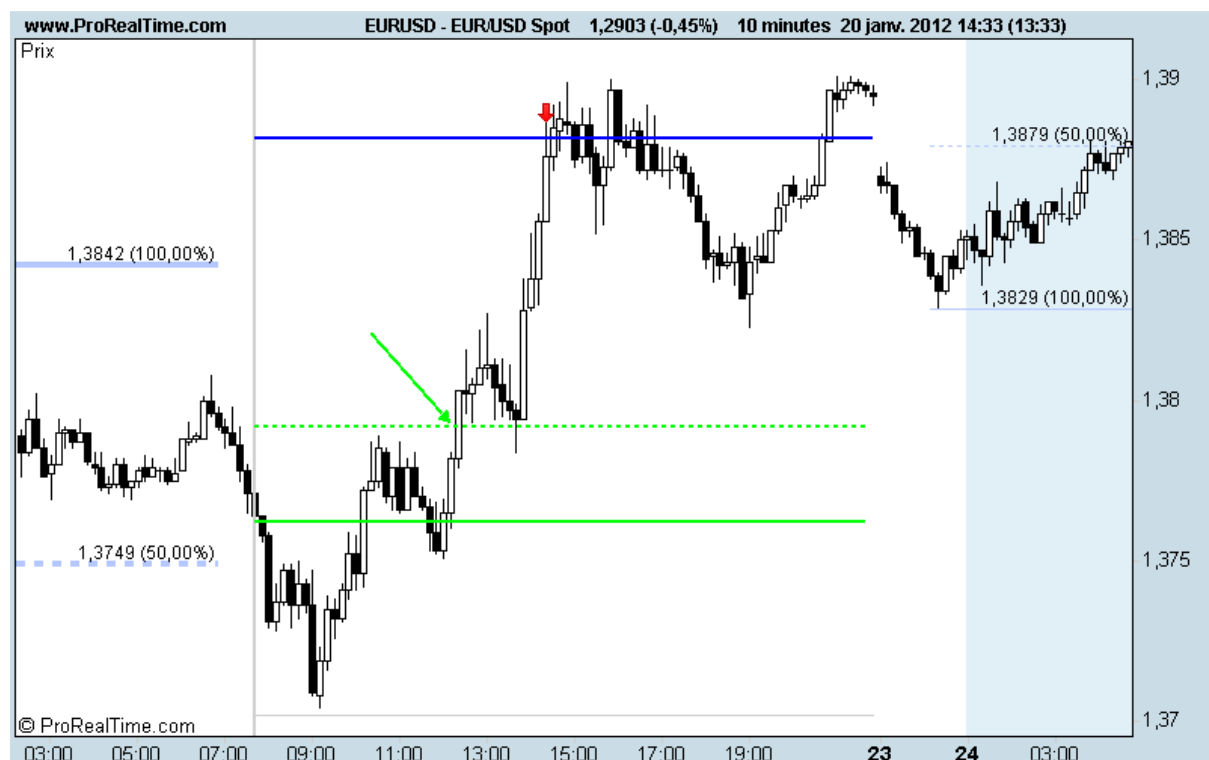
Exemple d'achat au passage du niveau M (graph 7) :



On ouvre en secteur 3. A la cassure du niveau vert à la hausse (passage en secteur 2), on se trouve sous le niveau M (noté 50% sur ce graphique). On attend le passage du niveau M pour acheter (flèche verte), stop à 30 pips, objectif bleu.

Cas particulier : si on ouvre dans le secteur 3, **on attendra la rupture du niveau (c'est-à-dire le passage en secteur 2) pour acheter** et on placera le stop à 60 pips (c'est-à-dire 30 pips sous le niveau vert). Il faut bien sûr toujours être au-dessus de M.

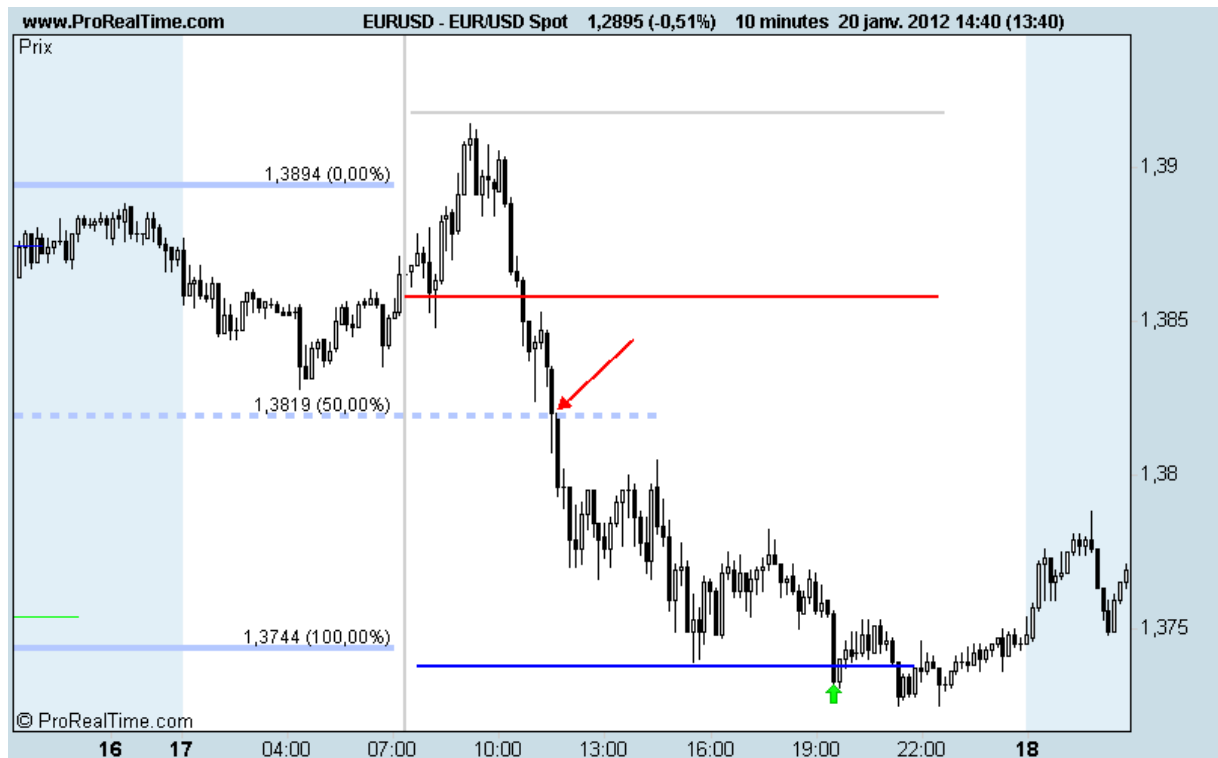
Exemple d'achat sur rupture du niveau vert (graph 8) :



On ouvre en secteur 3. On attend la cassure à la hausse du niveau vert (passage en secteur 2) pour acheter l'euro. Nous sommes au-dessus du niveau M (noté 50% sur ce graphique), l'achat est donc possible. Stop à 60 pips, objectif bleu (potentiel de 90 pips). Le stop est remonté de 30 pips lorsqu'on se trouve à 30 pips de l'objectif bleu.

Les trades A peuvent aussi être initiés à tout moment de la séance sur rupture à la hausse d'un niveau vert (objectif bleu visé à la hausse) ou sur rupture à la baisse d'un niveau rouge (objectif bleu visé à la baisse). Les conditions concernant le niveau M sont toujours les mêmes à savoir pas d'achat sous le niveau M et pas de vente au-dessus du niveau M.

Exemple de trade A initié après une ouverture en secteur 4 (graph 9) :



On ouvre en secteur 4. Pas de trade B, les conditions concernant les niveaux S, C et M ne sont pas remplies. On attend la cassure à la baisse du niveau rouge puis le passage du niveau M (qui est dans le secteur 6) pour initier une vente, stop à 30 pips, objectif bleu. Il y a un autre exemple dans le graph 2 (trade légèrement perdant à 22h).

Remarques (concernant les trades de type A uniquement) :

- Les stops à 60 pips ne sont placés que lorsque un trade est engagé lors du passage du secteur 3 au secteur 2 ou du passage du secteur 5 au secteur 6. Dans ces cas-là, le gain potentiel est à 90 pips. Dans tous les autres cas, le gain potentiel sera inférieur à 90 pips (au minimum 20 pips) et le stop à 30 pips.
- une fois l'objectif bleu touché, on ne tente plus de trade A pour ce même objectif (même si aucun trade A n'a été initié)
- si un trade A est initié à plus de 60 pips de l'objectif bleu, on abaisse le stop de 30 pips une fois l'objectif bleu approché à 30 pips. A l'inverse, quand un trade est initié à moins de 60 pips de l'objectif, on ne touche pas le stop (qui reste à 30 pips).
- le niveau M sert en quelque sorte de point pivot. **On n'achète jamais sous M et on ne vend jamais au-dessus de M.**

5. Que fait-on une fois le stop exécuté ?

- un trade B stoppé se transforme automatiquement en trade A si les conditions concernant le niveau M sont respectées.
- séparons les trades A en deux catégories : ceux dont le stop est à 30 pips (initiés à l'ouverture ou au passage du niveau M) et ceux dont le stop est à 60 pips (initiés sur rupture d'un niveau). Dans le premier cas, si on est stoppé, on attendra de toucher à nouveau le niveau vert (pour les trades initiés en secteur 2) ou le niveau rouge (pour les trades initiés en secteur 6) et de casser ce niveau (à la hausse pour le niveau vert et à la baisse pour le niveau rouge) pour initier à nouveau un trade A. Dans le deuxième cas, on attendra une nouvelle rupture du niveau (rouge ou vert) pour initier à nouveau le trade A. Après deux stops touchés, on abandonne ce trade.

Exemple de 2^{ème} tentative de trade A (graph 10)



Le niveau vert est cassé en début de séance. On se trouve au-dessus du niveau M, on passe donc à l'achat (1), le stop se trouve 60 pips plus bas (soit 30 pips sous le niveau vert). Le stop est touché (2) en milieu d'après-midi. Après 16h, le niveau vert est cassé à nouveau, on repasse à l'achat (3) pour solder la position à 22h (4).

Commentaires et cas particuliers

1. Les points S, C et M du lundi

La séance qui précède celle du lundi se déroule entre le dimanche minuit ou 23h (selon la période de l'année) et l'ouverture du lundi matin. Parfois, la volatilité est tellement faible que les points S, C et M n'ont pas vraiment de signification. Voici donc une règle : si le range de cette mini séance (du dimanche soir au lundi matin) est inférieur ou égal à 30 pips, on englobera la séance du vendredi pour le calcul des points S, C et M.

2. Ouverture exactement sur un niveau rouge ou vert

Quand l'ouverture se fait exactement (on prend une marge de 5 pips de part et d'autre) sur un niveau rouge ou un niveau vert, on est en droit de se demander s'il faut initier immédiatement un trade B ou alors attendre la rupture du niveau pour un trade A. Dans ces cas litigieux, on privilégie le trade B et donc, si les conditions des niveaux S, C ou M le permettent, on entre à l'achat sur le niveau rouge ou à la baisse sur le niveau vert pour viser l'objectif gris.

3. Les jours sans trading et les jours particuliers

Certains jours, aucun niveau ne vous sera proposé. Ce sont des types de journées pour lesquelles, généralement, en suivant les instructions, les pertes sont plus importantes que les gains sur le long terme.

Dans d'autres journées de trading, l'écart entre les niveaux rouge et vert et les objectifs sont inversés. Un trade B peut alors rapporter 120 pips alors qu'un trade A n'en rapportera que 30 au maximum. Les stops sont placés toujours au même endroit. Les stops seront par contre abaissés de 30 pips selon un autre principe : quand on sera à 10 pips de l'objectif bleu ou à 30 pips de l'objectif gris.

4. Prévisions vs trading

Ceux qui ont déjà fait du trading le savent bien : il y a un gouffre entre faire une prévision et la transformer en monnaie sonnante et trébuchante. Un trader peut être excellent en disposant de mauvaises prévisions et inversement. La méthode qui vous est proposée ici permet de mettre en application une technique qui n'était que prédictive au départ. Cela implique qu'il faut faire des choix dans le moment où l'on prend position, la distance du stop, etc. Vous verrez que la plupart du temps, les niveaux fournis chaque semaine fonctionnent à merveille mais parfois, en fin de séance, cela ne se traduit pas par un gain car, par exemple, on s'est approché de l'objectif sans le toucher avant de renverser la tendance, ou alors le stop a été exécuté pour 1 pip. Dans un trading automatique, c'est obligatoire et dans cette méthode, le trader ne prend aucune décision, c'est salutaire pour les opérateurs trop sensibles mais parfois, cela peut devenir frustrant. Vous pouvez donc bien sûr adapter la méthode et prendre vos bénéfices plus tôt ou reculer vos stops ou alors

jouer un trade sans que les conditions ne soient réunies mais alors vous n'obtiendrez pas les mêmes résultats que ci-dessous (ce sera peut-être mieux mais peut-être moins bien). Vous verrez aussi que si de nombreuses journées fonctionnent « comme sur des roulettes », parfois, on enchaîne 3 trades perdants pour -120 pips. Il faut toutefois ne pas se laisser impressionner et suivre scrupuleusement la méthode pour chaque séance, on revient vite dans le vert.

5. Les types d'ordre à utiliser

Pour pouvoir trader comme le modèle le propose, il vous faudra placer vos ordres à l'avance pour ne pas attendre d'atteindre les niveaux pour intervenir. Vous devrez également utiliser des ordres « intelligents » comme les ordres OCO (Order Cancel the Other). Par exemple, une ouverture en secteur 4 vous fera placer un ordre d'achat limite sur le niveau rouge, qui entraînera automatiquement un ordre de vente limite sur l'objectif gris et un ordre stop 30 pips sous le niveau rouge. Si l'objectif est touché, l'ordre stop sera annulé et inversement.

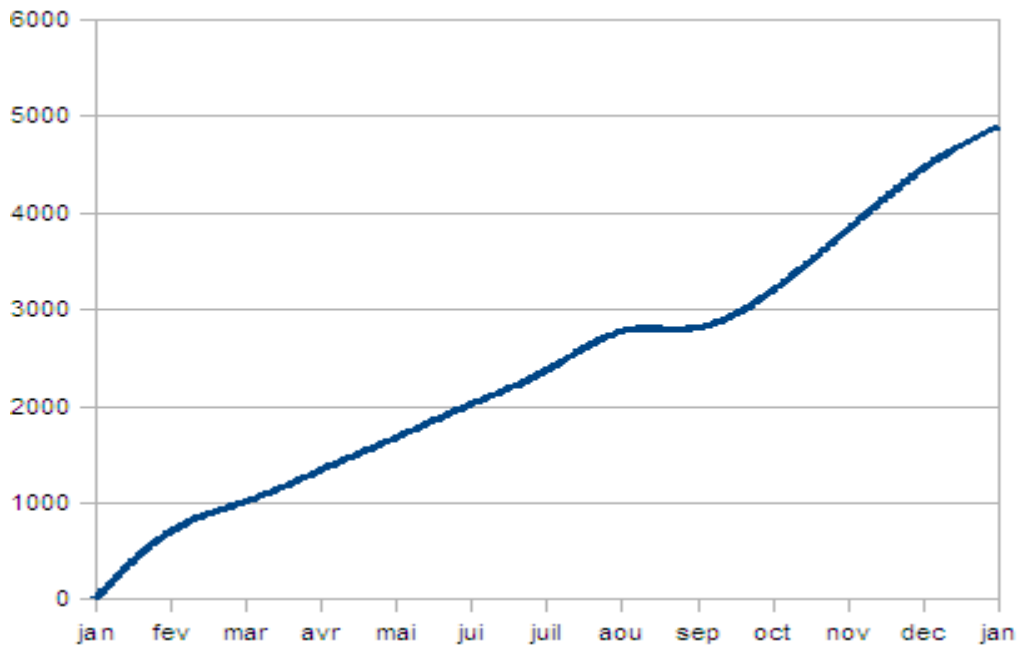
Pour les trades A initiés sur rupture de niveaux, il faut utiliser des ordres stop pour initier la position. Ce sont des ordres qui se transforment en ordre « au marché » dès que le niveau indiqué est touché. Par exemple, pour jouer la rupture du niveau rouge, on placera un ordre de vente stop 30 pips sous le niveau, puis un ordre d'achat limite (OCO) sur l'objectif bleu et enfin un ordre d'achat stop (OCO) 60 pips au-dessus de la prise de position.

6. Pour comprendre le Forex

Si vous ne comprenez rien à tout ce qui est écrit dans ce document, je peux vous conseiller ce site web très bien fait (je n'ai aucun lien avec ce site) :

www.strategie-forex.com/presentation-forex.php

Backtesting 2011



Voici ce que donne la méthode scrupuleusement appliquée sur toutes les séances de l'année 2011 jusqu'au lundi 25 janvier 2012. La courbe bleue représente l'accumulation des pips.

On arrive à un total de **4900 pips** (soit 49000\$ pour un seul contrat joué sur deux devises : EURUSD et GBPUSD). On remarque qu'il n'y a aucun mois perdant. Le mois le plus faible étant le mois d'août avec seulement 36 pips de gains, il y a peut-être un lien de saisonnalité (peu d'opérateurs sur le marché), c'est à creuser.

La plus grosse perte en une séance pour les deux devises réunies est de 120 pips. Le plus gros gain est de 211 pips.

La plus grande série de séances perdantes consécutives a été de 4, c'est arrivé une fois en février et une fois en août, ce sont les deux mois les moins rémunérateurs.