



II/ Apprendre à construire une stratégie

+ Qu'est-ce qu'une stratégie de trading ?

- Nous allons définir des conditions précises à respecter avant d'ouvrir ou de fermer une position.
- Pour donner une image, nous pouvons prendre l'exemple d'un joueur de football. Les conditions d'entrée d'une stratégie de trading peuvent être basées sur des indicateurs techniques tels que le RSI, le MACD ou la moyenne mobile afin de déterminer les opportunités d'investissement à fort potentiel.

+ Pourquoi est-il important d'élaborer une stratégie ?

1. En ayant des règles définies, nous aurons des points précis pour l'ouverture et la fermeture des positions.
2. Ces règles élimineront les décisions sentimentales, telles que : "voilà que j'ouvre une position parce que j'en ai envie".
3. Ces règles vous feront gagner du temps dans votre cycle d'apprentissage, et vous limiterez le risque réel de perte.
4. Enfin, le plus important est qu'en ayant une stratégie, nous aurons des résultats à analyser, et nous pourrons savoir lesquels sont intéressants et lesquels sont mauvais.

Entrons dans le vif du sujet !

Il existe deux grands types de stratégies : celle qui suit les tendances et celle qui revient à la moyenne.

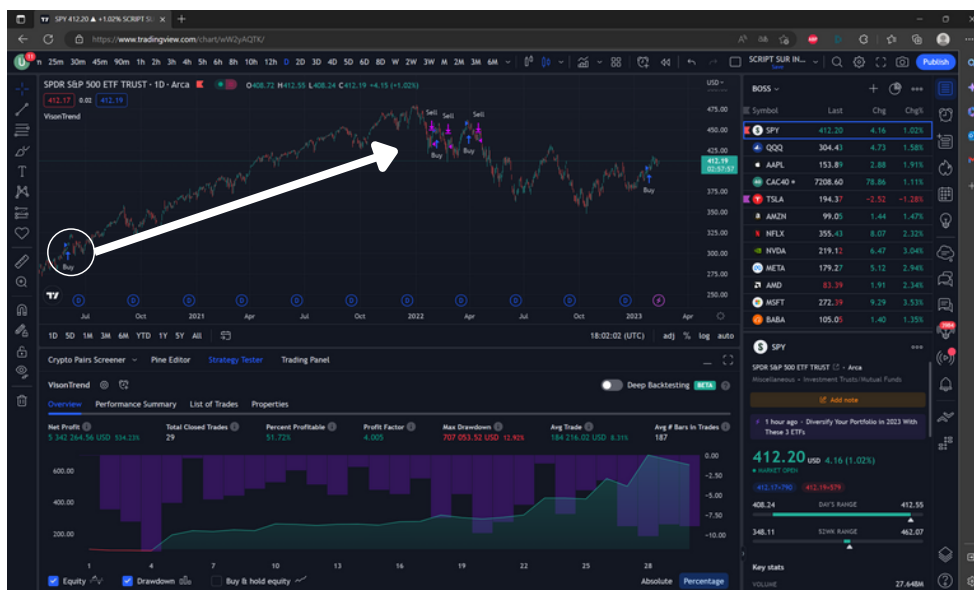
- Suivre la tendance consiste à investir dans une direction particulière du marché, en se basant sur l'idée que les prix continueront à évoluer dans la même direction. Par exemple, si le prix d'une action a augmenté régulièrement au cours des derniers mois, une stratégie de suivi de tendance consisterait à acheter cette action en partant du principe que le prix continuera à augmenter.
- La stratégie de retour à la moyenne, quant à elle, consiste à revenir à la moyenne des prix d'un actif. Cette stratégie part du principe que les prix extrêmes sont temporaires et qu'à long terme, ils reviendront à une moyenne historique. Par exemple, si le prix d'une action a fortement augmenté dans le passé, une stratégie de retour à la moyenne consisterait à vendre cette action en partant du principe que les prix reviendront à leur niveau moyen à long terme.



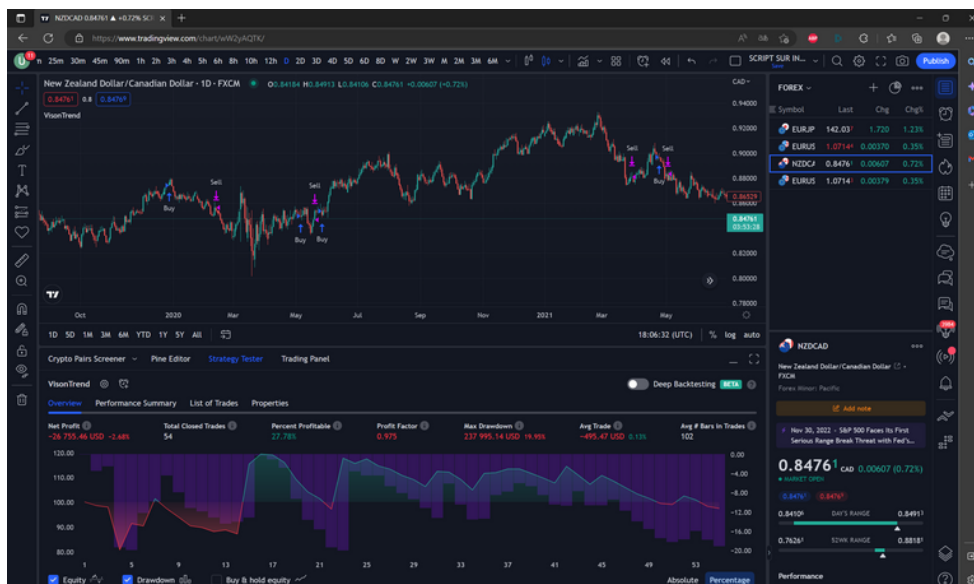
- Si vous cherchez à savoir lequel est le meilleur, la réponse est qu'il n'y en a pas un meilleur que l'autre. Tout dépend de l'action que vous négociez.
- Il n'existe pas de stratégie miracle qui permette de négocier n'importe quel actif sur n'importe quel horizon temporel.

+ Exemple de stratégie de tendance :

Nous constatons que la stratégie est conçue pour tirer profit lors des grands mouvements de tendance.



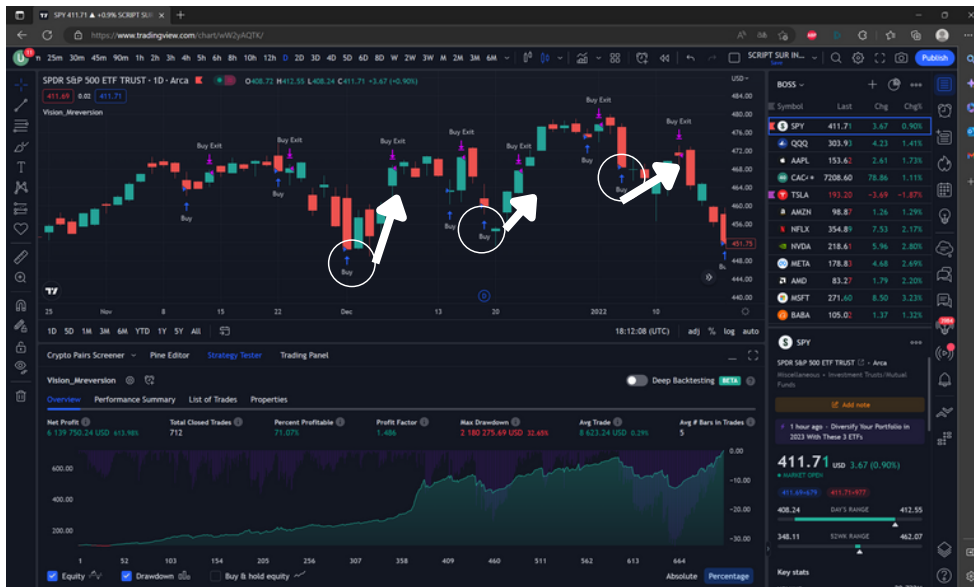
Dans un autre cas, cette stratégie est beaucoup moins efficace lorsque l'évolution du prix n'indique pas une tendance claire :



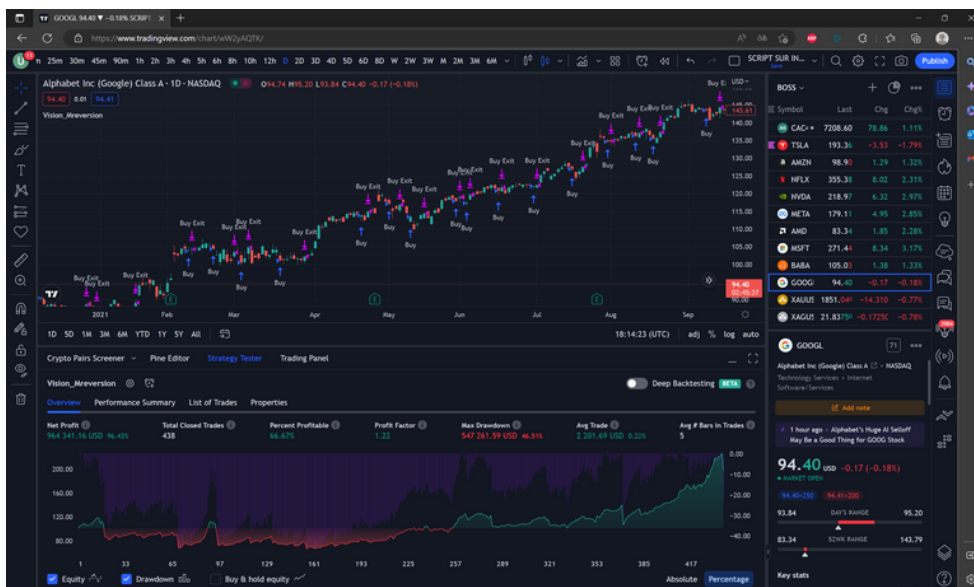


+ Exemple de stratégie de retour à la moyenne :

Nous constatons que la stratégie est faite pour tirer profit des petits mouvements.



Dans un autre cas, cette stratégie est beaucoup moins efficace lorsque l'évolution du prix indique une tendance claire :



C'est pourquoi il n'existe pas d'algorithme parfait capable de négocier n'importe quel actif.