

PROGRAMME DE FORMATION

« CONSTRUIRE UN SYSTÈME COMPLET DE TRADING »

I-Comprendre l'écosystème du marché

- Une barrière à l'entrée quasi-nulle
- Un jeu à somme négative
- Une majorité de perdants
- Un univers contrarien
- ✓ **Application 1 : analyse de l'asymétrie entre pertes et recoupement des pertes.**
- ✓ **Application 2: mise en situation en réduisant le marché à deux participants**

II-Caractéristiques communes aux gagnants et aux perdants

- Ce que font les gagnants
- Ce que font les perdants

III-Le maillon faible c'est vous !

- La psychologie en trading : individuelle et collective
- Les principaux biais cognitifs et comportementaux

- Ce que vous ne contrôlez pas : l'issue de chaque trade
- Ce que vous pouvez contrôler : le risque
- L'importance de la discipline

IV-La gestion des risques en trading

- Typologie des risques en trading
- La gestion du risque par trade : les stops ou comment éviter le risque de ruine
 - ✓ **Application : savoir bien placer un stop**
 - ✓ **Cas pratiques à partir de graphiques (base de données de trades)**
- La gestion du risque global du portefeuille
 - ✓ **Application : méthode pour gérer la volatilité et le drawdown**
- La gestion de la taille des positions : variable ou constante ?

V-Définir son avantage...et l'appliquer

- Comprendre l'espérance de gain et ses composantes : win-loss ratio, risk -reward ratio et taille de position
 - ✓ **Application : calcul de l'espérance d'une stratégie de trading**
- Les outils du trader performant : backtesting , screening, tableaux de bord et journal de trading
 - ✓ **Application : constitution d'un tableau de bord du trader sur excel**
- Choisir son broker
- Lire un carnet d'ordres

- Connaître les différents types d'ordres
- ✓ **Application : découvrir les différents ordres**

- Définir une stratégie robuste qui vous convient: « keep it simple » : le prix dit tout
- ✓ **Application : La stratégie de suivi de tendance. Etude des graphiques de plusieurs actifs et de la performance de grands traders**

- Etablir une stratégie d'entrée et de sortie : le swing trading
- Les différents types de configuration prix/volumes qui président à de fortes avancées
- ✓ **Application : apprendre à reconnaître un « double bottom », une « cup with handle », une « flat base », une « cassure de ligne de tendance », etc.**

- Définir et appliquer une stratégie rigoureuse d'entrée et de sortie : point-pivot, sorties sur force, sur faiblesse, entrées et sorties partielles, pyramidage
- ✓ **Application : comprendre et reconnaître le point-pivot**
- ✓ **Application : construction d'un trade avec entrées séquentielles et sorties fractionnées**
- ✓ **Application : analyse de trades récents et passés à partir d'une base de données d'une centaine de trades caractéristiques (actions US)**