

2024

# Flow tracking

## Présentation

Par : DEPRAZ **TRADER**



## **A propos de DEPRAZ TRADER**

*Une société d'investissement. Nous avons développé nos propres stratégies, nommées chacune par leurs créateurs, et seront à partir de 2024, exclusivement offertes par notre société.*

---

### **A propos du développeur**

Jonathan Dépraz a commencé dans le trading il y a plus de huit ans. Au fil du temps, il a exploré différentes approches et stratégies, enrichissant ses connaissances grâce à des rencontres avec des professionnels de la finance. En combinant ces expériences avec des recherches approfondies, il a développé la stratégie de suivi des flux, fondée sur l'analyse des transactions et la surveillance des tendances du marché. Cette méthode, devenue un pilier de l'approche de trading de Dépraz Trader, intègre une gestion de risque rigoureuse, l'intérêt composé et la couverture, visant à maximiser les rendements tout en limitant les pertes.

### **A propos de la stratégie**

La stratégie de Dépraz Trader associe une gestion de risque rigoureuse à l'intérêt composé et à la couverture. L'intérêt composé est utilisé pour augmenter progressivement la taille des transactions en réinvestissant les bénéfices, tandis que la couverture est utilisée avec des instruments financiers comme les contrats à terme ou les options pour protéger les positions contre les risques. Cette approche vise à maximiser les rendements tout en limitant les pertes, assurant ainsi une protection du capital à long terme.

“

**Enracinés dans l'innovation. Ancrés dans la fiabilité, notre stratégie incarne notre engagement envers l'excellence et notre passion pour la finance.**

**Dépraz Jonathan**

”

## Procédure d'analyse à la prise de position

La stratégie de flow tracking dans le contexte des marchés financiers concerne la surveillance et l'analyse des flux de transactions financières, généralement à grande échelle et souvent en temps réel. Cette stratégie est utilisée par les traders, les gestionnaires de fonds et d'autres acteurs du marché pour prendre des décisions d'investissement plus éclairées et pour mieux comprendre les tendances du marché.

Voici quelques aspects clés de la stratégie de flow tracking dans les marchés financiers :

- 1. Surveillance des flux de transactions :** Les transactions sur les marchés financiers génèrent un flux continu de données. La stratégie de flow tracking implique la surveillance de ces flux de transactions pour identifier les schémas, les volumes importants, les tendances émergentes et d'autres signaux pertinents.
- 2. Analyse des données :** Les données sur les flux de transactions sont analysées à l'aide d'algorithmes et d'outils d'analyse avancés pour extraire des informations utiles. Cela peut inclure l'identification des comportements des investisseurs, la détection des activités inhabituelles ou suspectes, et l'évaluation des conditions du marché.
- 3. Prise de décision d'investissement :** Les informations obtenues à partir de l'analyse des flux de transactions peuvent être utilisées pour prendre des décisions d'investissement plus éclairées. Par exemple, les traders peuvent ajuster leurs positions en fonction des tendances identifiées ou des signaux de trading générés par l'analyse des flux de transactions.
- 4. Gestion des risques :** La stratégie de flow tracking peut également être utilisée pour évaluer et gérer les risques. En surveillant les flux de transactions, les acteurs du marché peuvent identifier les risques potentiels liés à la liquidité, à la volatilité ou à d'autres facteurs et prendre des mesures pour les atténuer.

- 5. Optimisation des stratégies de trading : Les informations sur les flux de transactions peuvent être utilisées pour optimiser les stratégies de trading. Par exemple, les gestionnaires de fonds peuvent ajuster leurs allocations d'actifs en fonction des tendances du marché identifiées par l'analyse des flux de transactions.**

*En résumé, la stratégie de flow tracking dans les marchés financiers consiste à surveiller et à analyser les flux de transactions pour prendre des décisions d'investissement plus éclairées, gérer les risques et optimiser les stratégies de trading.*

## Gestion de risque

La gestion du risque par intérêt composé, combinée à la couverture lorsque c'est possible, est une stratégie clé utilisée par Dépraz Trader pour maximiser les rendements tout en limitant les pertes sur les marchés financiers.

L'intérêt composé est une technique qui consiste à réinvestir les bénéfices générés par une position profitable pour augmenter progressivement la taille des transactions. En utilisant cette approche, les gains sont réinvestis pour générer des rendements plus importants à long terme. Par exemple, si une position est rentable, les bénéfices réalisés sont ajoutés au capital de départ, ce qui permet d'accroître la taille des transactions suivantes. Cela peut conduire à une croissance exponentielle du capital sur une période prolongée.

En ce qui concerne la couverture, Dépraz Trader utilise des techniques de hedging quant (gestion quantitative du risque) pour se protéger contre les risques indésirables sur les marchés financiers. Le hedging quant consiste à utiliser des instruments financiers tels que les contrats à terme, les options ou d'autres dérivés pour compenser les risques associés à une position ou à un portefeuille. Par exemple, en utilisant des options de vente, ils peuvent se protéger contre les baisses de prix sur un actif particulier, limitant ainsi les pertes potentielles.

En combinant ces deux approches, Dépraz Trader vise à maximiser les rendements tout en réduisant les risques, offrant ainsi une protection contre les fluctuations du marché et contribuant à la préservation du capital sur le long terme.

## Conclusion

Notre stratégie de suivi des flux ne se limite pas à une seule approche ; elle intègre également une gestion de risque sophistiquée par intérêt composé et des hedge quant lorsque c'est possible.

L'intérêt composé est une stratégie puissante qui consiste à réinvestir les bénéfices générés par nos positions gagnantes pour augmenter progressivement la taille de nos transactions. Cela nous permet de capitaliser sur nos succès passés en augmentant notre exposition aux opportunités de trading rentables.

De plus, nous utilisons des hedge quant à la gestion des risques inhérents à nos positions. Les hedge quant sont des techniques qui nous permettent de se protéger contre les mouvements de prix indésirables en utilisant des instruments financiers tels que les options, les contrats à terme ou d'autres dérivés. Par exemple, en utilisant des options de vente, nous pouvons nous protéger contre les baisses de prix sur un actif particulier, limitant ainsi les pertes potentielles.

En combinant ces approches, notre stratégie vise à maximiser les rendements tout en limitant les risques, offrant ainsi une protection du capital et des performances durables sur le long terme pour nos investisseurs.

## **CLAUSE DE NON-RESPONSABILITÉ**

Peut inclure des annonces pour des instruments financiers/stratégies conformément à l'Article 68 de la Loi suisse sur les services financiers (FinSA) et est destiné uniquement aux clients professionnels tels que définis par la FinSA. Le contenu de cet e-mail est fourni à titre d'information uniquement et ne constitue ni un conseil en investissement, ni une offre, ni une recommandation d'achat ou de vente d'instruments financiers, ni une recommandation ou un conseil pour prendre des décisions concernant des investissements. La performance historique de tout instrument financier, de toute stratégie ou de tout portefeuille ne garantit pas la performance actuelle et future de cet instrument financier, stratégie ou portefeuille. La valeur du portefeuille peut augmenter ou diminuer à tout moment.



DEPRAZ TRADER