

SYNAPX ALGORITHMIC CAPITAL

Livre Blanc & Spécifications Officielles des 7 PAMMs

Audit de performance, gestion du risque et backtests historiques (2 à 5 ans de données réelles)

Infrastructure de Courtage Partenaire : Vantage Markets (Comptes ségrégués, ECN Raw Spread, exécution ultra-basse latence).

Portail Unique d'Accès & Souscription : synapx-algo.com

Objectif du Document : Détailler les spécifications mathématiques, algorithmiques et quantitatives des 3 moteurs de trading automatisés déclinés en 7 profils de gestion PAMM (Percent Allocation Management Module).

1 Matrice Comparative des 7 Formules PAMM

Bot	Profil	Cible Rendement	Drawdown Max	Marge Moy./Max	Probabilité Risque
v1	Modéré	$\leq 2,5\%$ / jour	30% (Hard SL)	$\leq 15\%$ max	2,0% proba DD/j
v1	Casino	Jusqu'à 10% / jour	100% (Perte tot.)	$\leq 15\%$ max	0,1% proba DD/j
v2	Safe	Jusqu'à 10% / mois	20% max	$\approx 5\%$ en séance	0,15% (5 ans tick)
v2	Normal	Jusqu'à 30% / mois	30% max	$\approx 5\%$ en séance	0,50% (5 ans tick)
v2	Débridé	Jusqu'à 100% / mois	50% max	$\approx 5\%$ en séance	1,00% (5 ans tick)
TP/SL	Safe	Moy. 15% / mois	12% max	Ordres différés	Faible volatilité
TP/SL	Normal	Moy. 30% / mois	24% max	Ordres différés	Profil équilibré

2 Moteur 1 : SynapX « v1 » — Asian Trend Surfing & Controlled Grid

Le modèle **SynapX v1** exploite l'efficacité statistique des plages de consolidation et de micro-tendances observées spécifiquement lors de la **session asiatique** (Tokyo / Sydney).

2.1 Fondements Techniques

- **Fenêtre Horaire Stricte :** Prise de position circonscrite aux creux de volatilité institutionnelle de nuit (session asiatique), neutralisant l'impact des ouvertures de Londres et de New York.
- **Filtrage Algorithmique des Annonces :** Fermeture ou gel des entrées en cas de publications monétaires majeures (Banque du Japon, RBA, etc.).
- **Grille Dynamique à Ratios Contrôlés :** L'allocation par niveau de prix est régulée de manière à restreindre formellement l'utilisation maximale de la marge à **15% du capital total**, même dans les phases de stress de marché les plus intenses.
- **Horizon de Données :** Validé sur un historique de 2 à 5 années de données de carnet réelles.

2.2 Profils PAMM Actifs du Bot v1

1. Version « Modéré »

- **Objectif de Performance** : Ciblage dynamique plafonné à 2,5% maximum par journée effective de trading.
- **Protection Maximale du Capital** : Coupe-circuit (Hard Stop) programmé à 30% de perte maximale sur la valeur liquidative du compte.
- **Métrique de Risque** : La probabilité empirique d'atteindre le drawdown plancher sur une journée de négociation est calibrée à 2%.

2. Version « Casino » (Hyper-Agressif)

- **Objectif de Performance** : Rendement asymétrique maximal pouvant atteindre jusqu'à 10% **par journée de trading**.
- **Tolérance de Risque Plafond** : Stop-Loss absolu à 100% **du capital** (exposition totale acceptée en cas de décalage extrême).
- **Fréquence Empirique d'Atteinte** : Probabilité statistique d'invalidation complète du compte mesurée à seulement 0,1% par jour de négociation selon les simulations de stress test.
- **Profil d'Investisseur** : Destiné exclusivement à des capitaux spéculatifs et à des stratégies de retraits ultra-rapides des bénéfices générés.

3 Moteur 2 : SynapX « v2 » — Advanced Institutional TrendSurfer

Le modèle **SynapX v2** est un algorithme quantitatif de positionnement de tendance long terme (Swing Trading & Multi-Day Momentum). Conçu pour préserver les portefeuilles institutionnels et les encours élevés, il privilégie la pertinence statistique au volume de transactions.

3.1 Fondements Techniques

- **Sélectivité d'Entrée Élevée** : Le robot n'ouvre que très peu de positions par semaine, après convergence de signaux de rupture volumique et d'inertie de prix.
- **Trailing Stop Actif Multi-Paliers** : Dès que le trade évolue en zone de profit, le stop est continuellement remonté de manière dynamique pour verrouiller les gains latents sans couper prématurément la tendance.
- **Exposition de Marge Réduite** : L'algorithme ne mobilise en moyenne que **5% de la marge utilisable** lors des sessions actives, laissant 95% du compte disponible face aux soubresauts imprévus.
- **Supervision Humaine Continue (Human-in-the-Loop)** : Une équipe de gestionnaires de risque et d'experts surveille l'infrastructure de manière ininterrompue en arrière-plan.
- **Validation Empirique** : Backtesté et éprouvé sur **5 ans d'historique continu en conditions réelles**.

3.2 Déclinaisons PAMM du Bot v2

1. Version « Safe » (Grands Capitaux)

- **Rendement Visé** : Jusqu'à 10% par mois.
- **Drawdown Plafond** : Limité strictement à 20%.
- **Facteur de Robustesse** : Probabilité statistique d'atteinte du niveau de drawdown mesurée à seulement 0,15% sur 5 années consécutives de données de ticks.

2. Version « Normal »

- **Rendement Visé** : Jusqu'à 30% par mois.
- **Drawdown Plafond** : Calibré à 30% maximum.
- **Facteur de Robustesse** : Probabilité d'occurrence du drawdown historique de 0,50%.

3. Version « Débridé »

- **Rendement Visé** : Jusqu'à 100% par mois selon l'amplitude des tendances macroéconomiques.
- **Drawdown Plafond** : Tolérance de perte maximale fixée à 50%.
- **Facteur de Robustesse** : Probabilité d'atteinte du palier d'invalidation calculée à 1,00%.

4 Moteur 3 : SynapX « TP/SL » — Consensus Multi-Stratégies 12-en-1

Le modèle **SynapX TP/SL** est une matrice algorithmique qui synthétise et confronte simultanément **12 méthodologies professionnelles éprouvées** (Cassures de volatilité, réversion à la moyenne, flux d'ordres institutionnels, zones d'offre et demande, etc.).

4.1 Fondements Techniques

- **Positionnement par Ordres en Attente (Pending Orders)** : L'algorithme ne poursuit jamais le cours au marché. Il positionne des ordres d'achat et de vente programmés (Buy/Sell Limits et Stops) calculés selon 12 prismes analytiques indépendants.
- **Filtrage d'Agrégateurs d'Actualités** : Connexion continue aux flux d'actualités financières pour neutraliser les dérapages lors des chocs de liquidité.
- **Ordres Définis avec TP et SL Réels** : Chaque position intègre des niveaux précis de Take-Profit et de Stop-Loss.
- **Profil de Distribution des Gains** : Certains mois de faible amplitude peuvent présenter une stagnation ou un repli passager, mais la décorrélation des 12 approches assure une régularité robuste à long terme (validée sur 3 ans de données réelles).

4.2 Déclinaisons PAMM du Bot TP/SL

1. Version « Safe »

- **Rendement Moyen Attendu** : 15% par mois.
- **Drawdown Historique Maximum** : 12%. Profil régulier et protecteur.

2. Version « Normal »

- **Rendement Moyen Attendu** : 30% par mois.
- **Drawdown Historique Maximum** : 24%. Profil d'équilibre rendement / risque.

5 Modalités d'Accès & Intégration Vantage

Les 7 modules PAMM présentés dans ce document sont accessibles exclusivement via le portail officiel de SynapX.

1. **Inscription & Validation** : Rendez-vous sur le site officiel synapx-algo.com pour initialiser votre accès investisseur.
2. **Ouverture de Compte Investisseur Vantage** : Création de votre sous-compte PAMM dédié auprès du courtier partenaire **Vantage Markets**. Vos capitaux restent ségrégués sous votre identité propre.
3. **Sélection du ou des Profils PAMM** : Possibilité d'allouer son capital sur un ou plusieurs profils (ex. 50% v2 Safe, 25% TP/SL Normal, 25% v1 Modéré) pour optimiser la diversification.
4. **Synchronisation Automatisée** : Les ordres s'exécutent en temps réel au prorata de vos fonds sans action manuelle requise.

6 Avertissement sur les Risques (Disclaimer)

Mentions Légales & Réglementaires : La négociation d'instruments financiers sur marge (Forex, CFD, matières premières) comporte un niveau de risque élevé et peut ne pas convenir à tous les investisseurs. Les performances passées, les résultats issus de simulations et les backtests historiques réalisés sur 2 à 5 ans de cotations réelles présentés ici ont une valeur d'information statistique et ne constituent pas une garantie de gains futurs. Avant de souscrire à une offre PAMM via Vantage sur synapx-algo.com, assurez-vous de bien comprendre les risques inhérents à l'effet de levier et n'investissez que des capitaux dont la perte n'altère pas votre stabilité financière. SynapX fournit des outils technologiques et quantitatifs et n'agit pas en qualité de conseiller en investissement financier.