Les 7 pièges du backtest

Pourquoi une stratégie « qui gagne » sur le papier perd en vrai — et comment le vérifier avant de risquer un euro.

Un **backtest** consiste à rejouer une règle de trading sur des prix passés. C'est un outil précieux… s'il est honnête. Voici les 7 façons les plus courantes de se tromper soi-même.

Piège 1 — Le regard vers le futur

Ton test utilise une information qui n'existait pas encore au moment de la décision : la clôture de la bougie en cours, un sommet « confirmé » seulement après coup, une ligne d'indicateur décalée vers le passé (la ligne Chikou d'Ichimoku utilise le futur par construction).

> **Règle :** le signal naît à la clôture de la bougie i, l'ordre s'exécute à l'ouverture de la bougie i+1. Pour vérifier : coupe les données futures et contrôle que l'indicateur ne change pas.

Piège 2 — Les frais et le glissement oubliés

Chaque transaction coûte (commission, écart achat/vente, glissement). Une stratégie qui trade souvent peut paraître rentable sans frais et perdante avec.

> **Exemple :** 200 trades par an avec 0,2 % de coût aller-retour = 40 % du capital engagé en frais cumulés. Le « petit avantage » disparaît.

Piège 3 — La sur-optimisation

À force d'essayer des paramètres (RSI 13, 14, 15… moyenne 47, 48…), tu finis par trouver une combinaison qui colle au passé par hasard. Elle ne tiendra pas à l'avenir.

> **Règle :** note le nombre de combinaisons testées. Plus il est grand, plus le meilleur résultat est suspect. Préfère peu de paramètres et des zones de valeurs

> qui marchent (pas un seul chiffre magique).

Piège 4 — Trop peu de trades

10 trades gagnants d'affilée ne prouvent rien : c'est de la chance possible. Il faut un échantillon assez grand, sur plusieurs conditions de marché (hausse, baisse, range).

Piège 5 — Des données trop belles

Données avec trous, doublons, bougies incohérentes (haut inférieur au bas), ou seulement les actifs qui ont « survécu ». Valide toujours tes données avant de tester.

Piège 6 — Pas de test hors échantillon

Si tu règles ta stratégie sur toute la période puis la juges sur cette même période, tu te notes toi-même. Utilise le **walk-forward** : tu règles sur une tranche, tu testes sur la suivante, et tu répètes. Un **Monte Carlo** sur l'ordre des trades montre aussi si le résultat dépend d'une séquence chanceuse.

Piège 7 — Ignorer le risque et la taille de position

Le rendement moyen ne dit pas combien tu peux perdre d'affilée. Calcule le **drawdown** maximal et la plus longue série de pertes, et dimensionne ta position selon un risque fixe par trade.

> **Exemple :** avec 40 % de trades gagnants et un gain moyen égal à la perte moyenne, tu es perdant ; avec un ratio gain/risque de 2 pour 1, le seuil de rentabilité tombe à environ 33 % de gagnants (avant frais). Le calcul décide, pas l'intuition.

Check-list avant de croire un backtest

- Signal à la clôture, exécution à l'ouverture suivante ?
- Frais et glissement inclus ?
- Nombre de paramètres essayés noté ?
- Assez de trades, sur plusieurs régimes de marché ?

- Données validées ?
- Walk-forward et Monte Carlo réalisés ?
- Drawdown et série de pertes acceptables pour toi ?

Aller plus loin : *Trading Lab* applique ces règles dans un kit Python éducatif : backtest avec frais, walk-forward, Monte Carlo, gestion du risque, 41 fiches et 21 exercices auto-corrigés.
[LIEN VERS LA PAGE DE VENTE]

Avertissement : contenu éducatif, pas un conseil en investissement. Le trading comporte un risque élevé de perte en capital ; la majorité des traders particuliers perdent de l'argent. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.
Pour en faire un PDF : ouvre ce fichier dans Chrome → Ctrl+P → « Enregistrer au format PDF ».