
COURS GRATUIT · QUANTINANO

Du Chart au Bot

La méthode pour transformer ce que tu sais déjà lire sur un graphique en une stratégie que tu peux tester, mesurer et exécuter sans émotion.

Un guide en 7 étapes — analyse technique, trading systématique, gestion du risque, exécution automatisée.
quantinano.com

Ce que tu vas apprendre

1

Le constat

Pourquoi même un bon lecteur de graphique perd de l'argent

2

Les fondations du systématique

Transformer un avis en règle testable

3

Construire ta première stratégie

De l'indicateur à la règle exécutable, pas à pas

4

Backtester et lire les résultats

Les 4 chiffres qui comptent, et le piège de l'overfitting

5

Gestion du risque et sizing

Pourquoi la taille de position décide de tout

6

De la stratégie à l'exécution réelle

Ce que l'automatisation doit reprendre à ta place

7

Ton plan d'action

La checklist pour passer du discrétionnaire au systématique

Un mot sur les risques

Ce guide est un contenu pédagogique. Il explique une méthode de construction et de test de stratégies, pas une martingale, un signal à copier ou une promesse de gain.

Le trading, discrétionnaire ou systématique, expose à un risque de perte en capital. Les données de marché utilisées dans les exemples de ce guide sont illustratives : elles servent à expliquer une méthode, pas à démontrer la performance d'une stratégie réelle. Une bonne méthode réduit les erreurs d'exécution ; elle n'élimine jamais le risque de marché.

À faire avant tout

Teste toujours une stratégie en paper trading avant d'engager du capital réel, et ne risque jamais plus que ce que tu peux te permettre de perdre.

Le constat

Pourquoi tu perds de l'argent (même en sachant lire un graphique)

Tu sais identifier une tendance. Tu sais tracer un support, reconnaître un breakout, lire un RSI. Le problème n'est pas là.

Le problème, c'est ce qui se passe entre le moment où tu vois le signal et le moment où tu appuies sur le bouton. Tu hésites à l'entrée parce que « ça peut encore baisser ». Tu sors trop tôt parce que tu as peur de rendre le gain. Tu ne coupes pas ta perte parce que « ça va remonter ». Et après une mauvaise série, tu doubles la mise pour te refaire.

Ce ne sont pas des erreurs d'analyse. Ce sont des erreurs d'exécution — humaines, pas techniques.

Un chiffre à retenir

Selon l'ESMA (l'autorité européenne des marchés financiers), **entre 74 % et 89 % des comptes particuliers sont perdants sur les CFD** — un produit pourtant accessible à quiconque sait lire un graphique.

Le trading systématique ne remplace pas ton analyse. Il retire l'humain du moment précis où l'humain fait le plus de dégâts : l'exécution.

MODULE 1 / 7 — Est-ce que ça te parle ?

Avant de continuer, sois honnête avec toi-même sur ces trois points. Si tu réponds « oui » à au moins deux, ce guide s'adresse directement à toi.

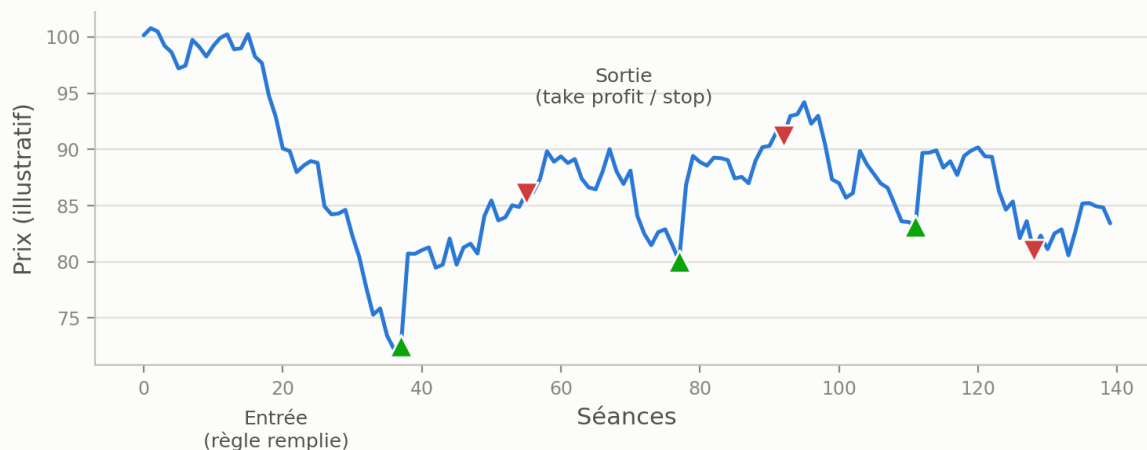
TROIS QUESTIONS HONNÊTES

- Tu as déjà fermé un trade gagnant trop tôt, « pour sécuriser le gain » — puis regardé le prix continuer à monter sans toi.
- Tu as déjà laissé une perte courir en te disant « ça va remonter », au lieu de respecter ton stop initial.
- Tu ne pourrais pas dire, pour tes 10 derniers trades, exactement pourquoi tu es entré et sorti à ces niveaux précis.

Ce n'est pas un problème de discipline personnelle à corriger par la volonté. C'est un problème de méthode — et une méthode, ça se construit. C'est l'objet des six modules qui suivent.

MODULE 1 / 7 — Discrétionnaire vs systématique

Exemple illustratif — la règle décide, pas l'humain



Même signal, deux façons de le traiter — la règle définit entrée et sortie avant que l'émotion ne s'en mêle.

DISCRÉTIONNAIRE	SYSTÉMATIQUE
« Ça a l'air d'un bon point d'entrée »	Condition précise remplie ou non (oui/non)
Le stop est déplacé « pour laisser respirer »	Le stop est fixé avant l'entrée, jamais déplacé
La taille de position varie selon la confiance du moment	La taille de position est calculée selon une règle fixe

Les fondations du systématique

Une règle, pas un avis

« J'aime bien ce setup » n'est pas une stratégie. Une stratégie, c'est une règle qu'on peut écrire noir sur blanc, tester sur le passé, et exécuter sans réfléchir.

Prends un setup que tu connais déjà : le croisement de deux moyennes mobiles (MM20 et MM50). En discrétionnaire, tu regardes le croisement, tu évalues « le contexte », tu décides. En systématique, la règle est fixée à l'avance :

**SI la MM20 croise la MM50 à la hausse
ET le volume est supérieur à sa moyenne 20 jours
ALORS j'entre. Stop à -2 %.
Sortie si la MM20 recroise la MM50 à la baisse.**

MODULE 2 / 7 — Le vocabulaire qui compte

Trois mots à retenir pour la suite du guide :

À RETENIR

- **Edge** — l'avantage statistique d'une règle, mesuré sur des dizaines d'occurrences, pas sur trois trades qui ont marché.
- **Backtest** — l'exécution de la règle sur des données passées, pour voir si l'edge existe vraiment.
- **Drawdown** — la perte maximale entre un sommet et un creux du capital, le vrai indicateur de ce que tu peux « tenir » psychologiquement.

Ce qui change concrètement : tu arrêtes de te demander « qu'est-ce que je pense du marché maintenant » et tu commences à te demander « est-ce que les conditions de ma règle sont remplies, oui ou non ».

Construire ta première stratégie

De l'indicateur à la règle exécutable

On part d'un setup simple et connu : le RSI. Objectif : transformer une intuition (« le RSI est survenu, ça peut rebondir ») en règle stricte, en quatre étapes.

1

Définir la condition d'entrée précisément. Pas « RSI bas » — $RSI(14) < 30$ sur clôture journalière.

2

Ajouter un filtre pour réduire les faux signaux. Ne trader que si le prix est au-dessus de sa moyenne mobile 200 jours (on reste dans le sens de la tendance de fond).

Ces deux premières conditions suffisent déjà à filtrer l'essentiel du bruit : elles éliminent les faux signaux de retournement pris à contre-tendance, qui sont la cause la plus fréquente de pertes sur ce type de setup.

MODULE 3 / 7 — De l'indicateur à la règle (suite)

3

Définir la sortie avant d'entrer. Take profit à +5 %, stop loss à −2 %, ou sortie si le RSI repasse au-dessus de 50.

4

Écrire la règle complète en une phrase testable. « J'entre si RSI(14) < 30 ET prix > MM200 ; je sors à +5 %, −2 %, ou RSI > 50. »

À retenir

Une stratégie simple avec 2-3 conditions claires est largement suffisante pour commencer. La complexité n'ajoute pas de robustesse — elle ajoute des points de rupture.

MODULE 3 / 7 — Cas concret chiffré

Applique la règle complète à un exemple illustratif, du signal jusqu'au résultat.

Étape	Valeur (exemple)
Capital de départ	10 000 €
Signal	RSI(14) = 27, prix > MM200
Entrée	100,00 €
Stop loss (−2 %)	98,00 €
Take profit (+5 %)	105,00 €
Résultat du trade	Sortie à 105,00 € (take profit touché)
Gain sur ce trade	+5 % de la position engagée

Sur ce trade précis, la règle a fonctionné — mais un seul trade ne prouve rien. C'est exactement le rôle du backtest, au Module 4 : répéter cette même mécanique sur des dizaines d'occurrences passées pour savoir si l'edge est réel ou si tu as simplement eu de la chance une fois.

Backtester et lire les résultats

Est-ce que ça marche vraiment, ou est-ce que tu l'espères ?

Le backtest n'est pas là pour te confirmer que ta stratégie est bonne. Il est là pour te dire si elle a un edge mesurable — et il te dira souvent que non. C'est une bonne nouvelle : mieux vaut le savoir sur le papier qu'avec de l'argent réel.

Pas besoin de coder pour commencer : des outils no-code (TradingView, par exemple) permettent de tester une règle simple sur plusieurs années de données en quelques clics.

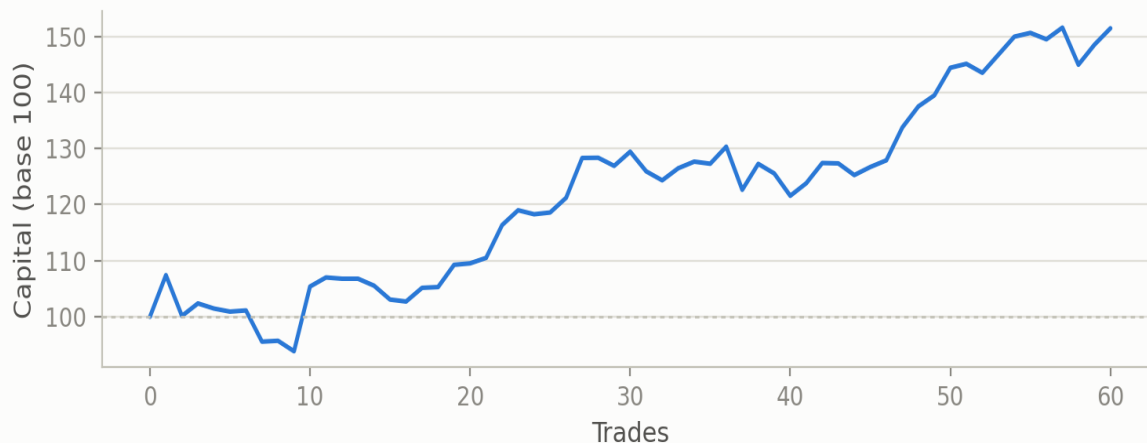
Quatre chiffres à regarder, dans cet ordre d'importance :

À RETENIR

- **Drawdown max** — la pire chute de capital. Si tu ne peux pas l'encaisser psychologiquement, la stratégie n'est pas pour toi, même rentable sur le papier.
- **Win rate** — % de trades gagnants. Ne dit rien seul : une stratégie à 30 % de gagnants peut être très rentable si les gains sont 3x plus gros que les pertes.
- **Ratio gain moyen / perte moyenne** — donne la vraie image avec le win rate.
- **Nombre de trades testés** — sous 30 trades, aucune conclusion n'est fiable statistiquement.

MODULE 4 / 7 — La performance cumulée

Courbe d'équity — capital cumulé sur 60 trades (backtest illustratif)

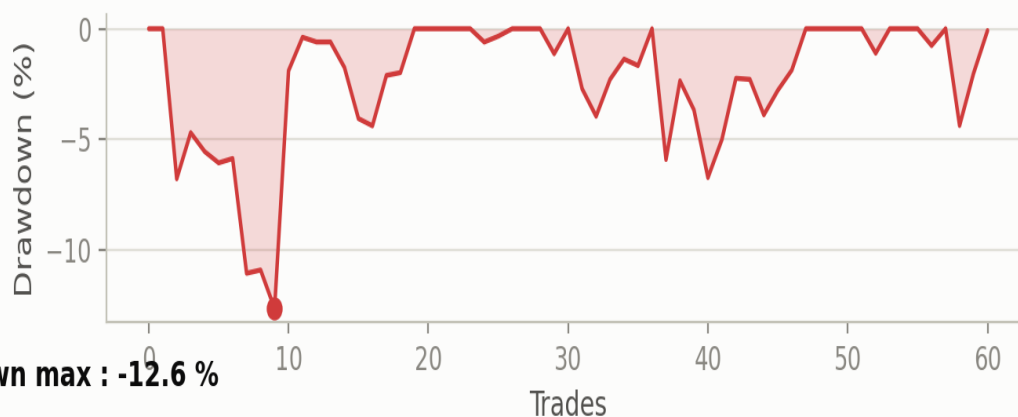


Comment lire cette courbe

Chaque point est le capital cumulé après un trade. Une courbe qui monte de gauche à droite, même en dents de scie, indique un edge positif sur la période testée. Ce qui compte n'est pas la pente moyenne mais la régularité — une courbe qui progresse par paliers stables inspire plus confiance qu'une courbe tirée par deux ou trois trades exceptionnels.

MODULE 4 / 7 — Ce qu'il a fallu encaisser

Drawdown — creux successifs du capital (même backtest)



Même backtest, deuxième lecture : la profondeur des creux traversés pour obtenir la performance de la page précédente.

Le piège du débutant : l'overfitting

Si tu ajustes tes paramètres jusqu'à obtenir 95 % de trades gagnants sur le passé, tu n'as pas trouvé une stratégie robuste — tu as trouvé une combinaison qui colle par hasard à ces données précises. Elle s'effondrera sur des données futures.

Gestion du risque et sizing

La stratégie n'est pas le problème, la taille de position l'est

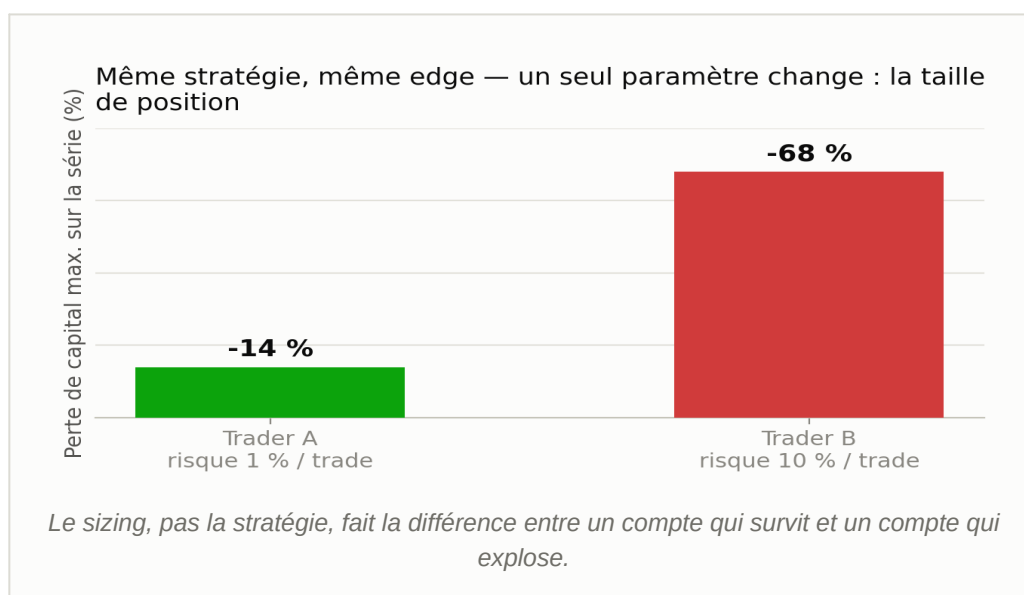
Une stratégie avec un edge réel peut quand même ruiner un compte si elle est mal dimensionnée. Ce n'est pas la stratégie qui protège le capital, c'est le sizing.

Règle de base

Ne jamais risquer plus de 1-2 % du capital sur un seul trade. Le risque, c'est la distance entre l'entrée et le stop loss, multipliée par la taille de position — pas le montant total investi.

Illustration : deux traders utilisent exactement la même stratégie (même edge, même win rate) sur la même série de 20 trades. Le premier respecte un risque de 1 % par trade. Le second risque 10 % par trade « pour aller plus vite ». Le premier traverse une baisse de compte gérable ; le second explose son compte avant la fin de la série — alors que la stratégie sous-jacente était identique.

MODULE 5 / 7 — Même stratégie, deux issues



À retenir

Le stop loss n'est pas négociable et n'est jamais déplacé une fois le trade ouvert. C'est la règle la plus simple — et la plus souvent cassée.

De la stratégie à l'exécution réelle

Ta stratégie est prête. Ton exécution ne l'est pas encore.

Une stratégie validée en backtest et exécutée manuellement se dégrade presque toujours en conditions réelles — pour des raisons qui n'ont rien à voir avec la stratégie elle-même : un ordre oublié parce que tu étais occupé, une erreur de saisie sous stress, un suivi incohérent des trades, un sizing recalculé approximativement à chaque fois, une fiscalité gérée dans la panique en fin d'année.

Ce ne sont pas des détails. Ce sont exactement les mêmes failles d'exécution évoquées au Module 1 — elles reviennent par la porte de derrière si l'automatisation ne prend pas le relais.

MODULE 6 / 7 — Manuel vs automatisé, point par point

Ce qu'il faut pour exécuter une règle fidèlement	Manuel	Automatisé
Exécution connectée directement au marché	✗	✓
Sizing recalculé automatiquement à chaque trade	✗	✓
Suivi et explication de chaque trade exécuté	✗	✓
Export fiscal sans tout reconstituer à la main	✗	✓
Exécution fidèle même en cas d'imprévu (absence, stress)	✗	✓

C'est précisément ce que couvre **Quantinano** : une infrastructure qui exécute ta règle exactement comme tu l'as définie, avec la gestion du risque et le reporting qui vont avec — pas un signal de plus à suivre à la main.

Ton plan d'action

Ce qu'il te reste à faire, dans l'ordre

1

Choisis un setup que tu connais déjà (celui de ce guide ou un autre) et écris-le en règle stricte SI / ALORS.

2

Backteste-le sur au moins 2 ans de données et au moins 30 occurrences.

3

Si le drawdown max testé est supportable pour toi, fixe ton risque par trade (1-2 % maximum).

4

Teste la stratégie en paper trading pendant au moins 4 semaines avant d'engager du capital réel.

5

Passe à l'exécution automatisée pour éliminer les erreurs d'exécution humaine.

En résumé

Ce guide t'a donné la méthode : une règle claire, testée, dimensionnée correctement. La seule variable qu'il te reste à sécuriser, c'est l'exécution — et c'est exactement là que la suite commence.

Glossaire

Les termes utilisés dans ce guide, en une phrase chacun

Edge	Avantage statistique d'une règle, mesuré sur un grand nombre d'occurrences — pas une impression.
Backtest	Test d'une règle sur des données historiques, pour estimer si l'edge existe avant d'engager du capital réel.
Drawdown	Perte maximale entre un sommet et un creux du capital sur une période donnée.
Win rate	Pourcentage de trades gagnants sur l'ensemble des trades pris.
Sizing	Calcul de la taille de position en fonction du risque accepté par trade, pas d'un montant fixe arbitraire.
Overfitting	Fait d'ajuster excessivement les paramètres d'une règle pour coller au passé, au détriment de sa robustesse future.
Paper trading	Exécution d'une stratégie avec de l'argent fictif, dans des conditions de marché réelles, avant capital réel.
RSI	Relative Strength Index — indicateur mesurant la vitesse et l'ampleur des variations de prix, entre 0 et 100.
MM20 / MM50 / MM200	Moyenne mobile calculée sur 20, 50 ou 200 séances — lisse le prix pour en dégager la tendance.
Take profit / Stop loss	Niveaux de sortie fixés à l'avance — respectivement pour sécuriser un gain ou limiter une perte.

FAQ rapide

Faut-il savoir coder pour démarrer ?

Non. Les premiers backtests peuvent se faire avec des outils no-code (TradingView et équivalents). Le code devient utile pour automatiser l'exécution, pas pour valider une règle.

Avec combien de capital peut-on commencer ?

Le montant compte moins que le respect du sizing (Module 5). Commence en paper trading, sans risquer d'argent réel, jusqu'à ce que la règle et son exécution soient stables.

Combien de temps par semaine ça demande ?

Construire et backtester une première règle simple prend quelques heures étalées sur une à deux semaines. Une fois automatisée, l'exécution ne demande plus de suivi permanent — c'est justement l'objectif.

Actions, crypto, forex : est-ce que la méthode change ?

La méthode reste la même (règle, backtest, sizing, exécution). Ce qui change, c'est la volatilité et les horaires de marché — à prendre en compte dans le choix des seuils, pas dans la logique de construction.

Une stratégie qui a bien backtesté peut-elle quand même perdre en réel ?

Oui, et c'est normal : un backtest estime un edge passé, il ne le garantit pas pour l'avenir. C'est pourquoi le paper trading (Module 7) et une taille de position prudente (Module 5) restent indispensables même après un bon backtest.

Pourquoi ne pas simplement suivre les signaux de quelqu'un d'autre ?

Parce que tu n'as alors ni la compréhension du risque pris, ni la capacité de juger quand la règle cesse de fonctionner. Ce guide t'apprend à construire et évaluer ta propre règle, pas à en suivre une à l'aveugle.

La checklist en une page

1 • Avant d'écrire une règle

Choisis un setup que tu maîtrises déjà (analyse technique, momentum, breakout...). Ne pars jamais d'un indicateur que tu ne sais pas expliquer simplement.

2 • Avant de backtester

Entrée, sortie et filtre écrits en une phrase SI / ALORS, sans ambiguïté. Vise au moins 30 occurrences et 2 ans de données.

3 • Avant de risquer du capital réel

Drawdown max du backtest supportable psychologiquement. Risque fixé à 1-2 % max par trade. Au moins 4 semaines de paper trading validées.

4 • Avant de passer à l'échelle

Exécution automatisée en place — sizing, suivi et export fiscal ne reposent plus sur une action manuelle répétée à chaque trade.

Quantinano

Quantinano est une infrastructure de trading algorithmique pensée pour les traders francophones qui veulent passer du systématique testé à l'exécution automatisée — sans reconstruire eux-mêmes toute la mécanique technique.

CE QUE QUANTINANO PREND EN CHARGE

- **Exécution fiable** — tes règles s'exécutent exactement comme définies, sans intervention manuelle.
- **Gestion du risque au niveau du portefeuille** — sizing et limites appliqués automatiquement, pas trade par trade « à l'instinct ».
- **Backtesting rigoureux** — pour valider une règle avant de l'exposer à du capital réel.
- **Conformité intégrée** — export fiscal français inclus, explicabilité post-trade.

Quantinano n'est pas un générateur de stratégies ni un service de signaux : c'est l'infrastructure qui prend le relais une fois que ta méthode — celle de ce guide, ou la tienne — est prête à être exécutée sérieusement.

PROCHAINE ÉTAPE

Passe du guide à l'exécution

Tu as la méthode. Quantinano s'occupe de l'exécuter fidèlement, avec la gestion du risque et le reporting qui vont avec.

Découvrir Quantinano →
quantinano.com