



V/ Apprendre à analyser les résultats d'une stratégie

Passons au niveau supérieur et interprétons les résultats des stratégies privées !

Pour cela, vous devrez vous rendre à :

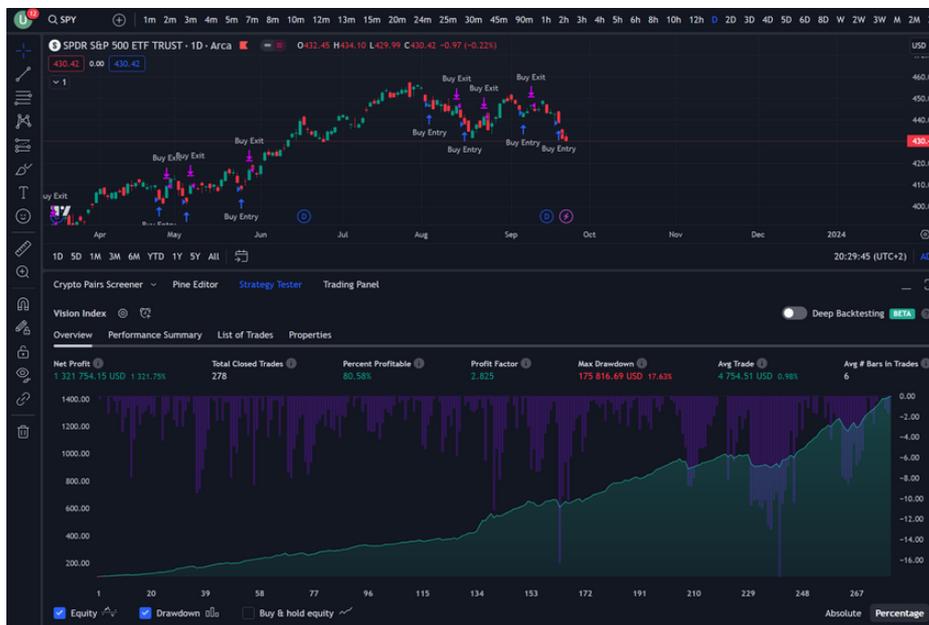
- Indicateurs
- Privé uniquement

Une fois que vous avez notre script affiché sur votre écran, cliquez sur :

- Strategy Tester

Ça y est, on peut analyser les résultats de la stratégie !

Comment lire la première interface de l'outil de back testing Trading View ?



+ Net Profit:

C'est le résultat final que vous aurez obtenu

+ Total Closed Positions:

Nombre total de positions (achat, achat sortie, vente, vente sortie) déclenchées



+ Winrate:

C'est le nombre de positions gagnantes par rapport aux positions perdantes.

- Avec une stratégie de tendance nous pouvons viser 40% car nos gains seront beaucoup plus élevés que nos pertes
- Avec une stratégie de réversion moyenne, nous devrions viser 60% à 70%, car nos gains seront essentiellement égaux à nos pertes.

+ Profit Factor:

C'est la somme des gains sur la somme des pertes.

- Si moins de 1, la stratégie n'est pas rentable
- Si entre 1 et 2 la stratégie est rentable mais à haut risque
- Si supérieur à 2 la stratégie est rentable

+ Drawdown:

Il s'agit de la valeur la plus élevée que le portefeuille a atteinte par rapport à la valeur la plus basse. Sur Tradingview, le drawdown est calculé sur les positions. Vous pouvez avoir une position ouverte qui a enregistré un drawdown sans qu'il ne soit réellement réalisé.

+ Average Trade:

Le pourcentage de profit moyen pour une transaction.

+ Average Number Of Trade Bars:

Une barre représente une unité de temps, le temps moyen passé dans une position est de 16 x 4h par exemple ce qui donne 64h.



Comment lire l'interface de résumé des performances ?

Dans cette catégorie, nous nous concentrerons sur 2 ratios:

+ Sharpe Ratio:

Il s'agit d'une mesure qui vous permet d'évaluer la performance d'un investissement en tenant compte du risque global. Plus le ratio de Sharpe est élevé, meilleure est la performance ajustée au risque.

+ Sortino Ratio:

Comme le ratio de Sharpe, il mesure la relation entre le rendement obtenu et le risque encouru pour le gagner, mais se concentre sur le risque de perte plutôt que sur le risque global. Plus le ratio Sortino est élevé, meilleure est la performance ajustée au risque.