Le dossier des tests

Swing, day trading, scalping : 30 méthodes passées au même protocole. Données jusqu'au 2026-11-06.

On ne croit rien. On teste tout. Ce document montre tout, y compris ce qui échoue. La feuille Excel qui l'accompagne contient chaque trade, avec des frais que tu peux changer toi-même.

Ce qu'il faut retenir

Sur 30 méthodes, 3 passent nos 5 filtres, toutes en swing. Elles se ressemblent : acheter un repli court quand la tendance de fond monte. Ce n'est donc qu'une seule idée, et non trois preuves indépendantes.

Aucune méthode de journée ne passe. Une partie de l'explication tient en un chiffre : sans aucun frais, 10 000 € investis seulement la nuit depuis 2000 deviennent 39 543 €, et seulement la journée 12 543 €.

En scalping, le premier adversaire, ce sont les frais. Avec un tick de glissement par côté et 5 $ de commission, un objectif et un stop de 8 ticks sur l'ES demandent 65 % de réussite pour ne rien perdre. Sur plus de 10 ans de NQ, en bougies de 1 et 5 minutes, aucune de nos 10 méthodes de scalping et de day trading ne passe, et des entrées au hasard perdent à peu près les frais.

Passer les filtres n'est pas une promesse. On dit « dans ce test », et rien de plus.

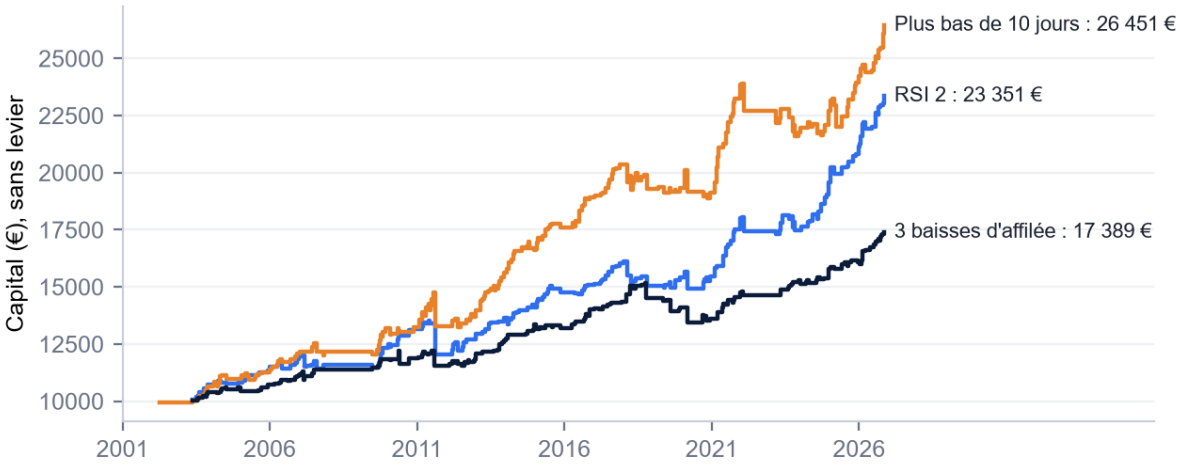
Le protocole, écrit avant de voir les résultats

Réglages classiques, jamais retouchés. Le signal est connu avant l'ordre. Une méthode qui échoue reste publiée. Pour passer, il faut franchir les 5 filtres : **1.** au moins 100 trades ; **2.** un résultat positif après frais sur chacune des deux moitiés de l'historique ; **3.** moins de 1 % de 1 000 tirages au hasard font aussi bien (même côté, mêmes durées, dates au sort) ; **4.** un résultat positif sur un second marché, sans rien régler ; **5.** un résultat toujours positif avec des frais doublés.

Swing : 26 ans de données

Contrat ES, second marché NQ, données journalières depuis 2000. Signal à la clôture, ordre à l'ouverture suivante. 0,6 point par aller-retour.

Méthode	Trades	Gagnants	Par trade	1re moitié	2e moitié	Hasard	2e marché	Frais x2	Verdict
RSI 2	200	76 %	+0,44 %	+0,40 %	+0,46 %	0,5 %	+0,52 %	+0,41 %	**Passe les 5**
Plus bas de 10 jours	237	76 %	+0,42 %	+0,43 %	+0,42 %	0,6 %	+0,54 %	+0,39 %	**Passe les 5**
3 baisses d'affilée	200	70 %	+0,28 %	+0,25 %	+0,31 %	0,6 %	+0,27 %	+0,25 %	**Passe les 5**
Bollinger filtré	68	75 %	+1,07 %	+0,59 %	+1,34 %	3,5 %	+0,98 %	+1,04 %	Ne passe pas
Cassure 20 jours, achat	108	48 %	+0,83 %	+0,17 %	+1,43 %	68,2 %	+1,13 %	+0,80 %	Ne passe pas
RSI 2, vente	69	67 %	+0,64 %	+0,93 %	+0,04 %	0,2 %	−0,11 %	+0,59 %	Ne passe pas
IBS	418	74 %	+0,35 %	+0,29 %	+0,39 %	1,5 %	+0,40 %	+0,32 %	Ne passe pas
Tour de mois	314	61 %	+0,27 %	+0,23 %	+0,31 %	17,6 %	+0,34 %	+0,24 %	Ne passe pas
Cassure 20 jours, vente	99	22 %	−1,33 %	−0,72 %	−1,98 %	94,2 %	−1,60 %	−1,37 %	Ne passe pas



Capital d'un compte sans levier, frais compris, en position seulement pendant les trades. Sur un contrat à terme, le levier change tout : les mêmes baisses pèsent bien plus lourd.

Recoupement

Les mêmes règles, sans rien régler, sur un troisième support (SPY, depuis 2000, 0,02 % par ordre) : RSI 2 : +0,35 % par trade sur 194 trades ; Plus bas de 10 jours : +0,36 % par trade sur 243 trades ; 3 baisses d'affilée : +0,20 % par trade sur 215 trades.

Ce que ça ne dit pas

Ces méthodes passent peu de temps sur le marché, et rapportent au total moins qu'acheter et garder sur la même période. Elles n'ont pas de stop dans ce test : le pire trade du RSI 2 reste une perte importante. Les contrats sont enchaînés sans ajustement. Une exécution réelle peut coûter plus.

Day trading : pas de position la nuit

S&P 500 (SPY), second marché Nasdaq (QQQ), depuis 2000. Ouverture vers clôture, 0,02 % par ordre.

Méthode	Trades	Gagnants	Par trade	1re moitié	2e moitié	Hasard	2e marché	Frais x2	Verdict
Après une forte baisse, achat	914	50 %	+0,05 %	+0,06 %	+0,03 %	1,0 %	+0,01 %	+0,01 %	Ne passe pas
Range le plus étroit de 7 jours	1 034	48 %	+0,00 %	−0,03 %	+0,03 %	8,6 %	+0,00 %	−0,04 %	Ne passe pas
Après une forte hausse, vente	949	44 %	−0,01 %	−0,01 %	−0,01 %	10,5 %	+0,05 %	−0,05 %	Ne passe pas
Le lundi	1 267	51 %	−0,01 %	−0,05 %	+0,02 %	25,4 %	−0,01 %	−0,05 %	Ne passe pas
Tous les jours (référence)	6 753	51 %	−0,03 %	−0,04 %	−0,02 %	50,5 %	−0,04 %	−0,07 %	Ne passe pas
Gap baissier, achat	924	49 %	−0,05 %	−0,10 %	+0,00 %	73,9 %	−0,01 %	−0,09 %	Ne passe pas
Le vendredi	1 354	50 %	−0,06 %	−0,08 %	−0,03 %	84,4 %	−0,10 %	−0,10 %	Ne passe pas
Gap haussier, vente	1 035	40 %	−0,12 %	−0,11 %	−0,13 %	99,2 %	−0,03 %	−0,16 %	Ne passe pas

Bougies d'une heure, depuis 2023-12-11 : environ 3 ans, trop court pour conclure dans un sens favorable.

Méthode	Trades	Gagnants	Par trade	1re moitié	2e moitié	Hasard	2e marché	Frais x2	Verdict
Élan de la 1re heure	723	49 %	−0,02 %	+0,01 %	−0,05 %	24,7 %	+0,01 %	−0,06 %	Ne passe pas
Cassure de la 1re heure	708	43 %	−0,04 %	−0,01 %	−0,06 %	42,7 %	−0,01 %	−0,08 %	Ne passe pas
Élan, dernière heure	723	37 %	−0,04 %	−0,03 %	−0,05 %	62,5 %	−0,03 %	−0,08 %	Ne passe pas

Le jour ou la nuit ?



10 000 € sur le S&P 500 (SPY), sans aucun frais. Investi de l'ouverture à la clôture, ou de la clôture à l'ouverture suivante.

La plus proche

Acheter le lendemain d'une forte baisse : +0,049 % par trade sur 914 trades. Au test du hasard, elle est à 1,0 %, au niveau du seuil, donc refusée. On ne bouge pas la barre après coup.

Scalping : le mur des frais

Sur l'ES, un tick vaut 12,50 $. Avec un tick de glissement de chaque côté et 5 $ de commission, un aller-retour coûte 30 $, soit 2,4 ticks. Le taux de réussite à battre, avec un objectif et un stop égaux :

Objectif et stop	Taux à battre	Sur l'ES
4 ticks	80,0 %	calcul, voir la feuille Excel
8 ticks	65,0 %	calcul, voir la feuille Excel
16 ticks	57,5 %	calcul, voir la feuille Excel
32 ticks	53,8 %	calcul, voir la feuille Excel

Et sur le vrai marché ? Entrées au hasard sur des bougies d'une minute du NQ, 2 626 séances, 3 ticks de coût, 4 000 tirages :

Objectif et stop	Trades gagnants	Taux à battre	Résultat moyen, frais compris
32 ticks	48,6 %	54,7 %	−3,8 ticks
64 ticks	50,4 %	52,3 %	−2,8 ticks
128 ticks	49,9 %	51,2 %	−3,9 ticks
256 ticks	49,8 %	50,6 %	−2,7 ticks

Au hasard, on gagne environ une fois sur deux, et on perd à peu près les frais. Sous 32 ticks, trop de bougies d'une minute touchent les deux niveaux : on ne donne pas de mesure.

Scalping et day trading : plus de 10 ans en 1 et 5 minutes

NQ du 2015-01-02 au 2025-07-24, 2 626 séances complètes. Second marché : ES du 2020-11-17 au 2024-07-19, 458 séances, avec des trous. Résultats en % du prix d'entrée, 0,75 point par aller-retour sur le NQ. Position fermée à 16 h, heure de New York.

Méthode	Trades	Gagnants	Par trade	1re moitié	2e moitié	Hasard	2e marché	Frais x2	Verdict
Élan 1re heure, NQ	2 619	52 %	+0,020 %	−0,017 %	+0,056 %	7,1 %	+0,006 %	+0,011 %	Ne passe pas
Cassure 15 min, NQ	2 618	43 %	+0,012 %	−0,024 %	+0,049 %	8,8 %	+0,024 %	+0,003 %	Ne passe pas
Cassure 1 h, NQ	2 444	50 %	+0,011 %	−0,014 %	+0,035 %	13,8 %	−0,003 %	+0,001 %	Ne passe pas
Cassure 30 min, NQ	2 578	46 %	+0,004 %	−0,024 %	+0,032 %	23,9 %	+0,036 %	−0,005 %	Ne passe pas
EMA 9/21, 5 min, NQ	10 730	34 %	+0,002 %	−0,003 %	+0,007 %	1,4 %	−0,005 %	−0,007 %	Ne passe pas
EMA 9/21, 1 min, NQ	47 385	29 %	−0,008 %	−0,012 %	−0,005 %	26,6 %	−0,012 %	−0,018 %	Ne passe pas
Élan, dernière heure, NQ	2 619	50 %	−0,009 %	−0,016 %	−0,001 %	49,5 %	−0,004 %	−0,018 %	Ne passe pas
Élan, fin 30 min, NQ	2 618	47 %	−0,012 %	−0,008 %	−0,015 %	69,1 %	−0,028 %	−0,021 %	Ne passe pas
Retour au VWAP, NQ	10 243	48 %	−0,014 %	−0,014 %	−0,014 %	99,4 %	−0,012 %	−0,023 %	Ne passe pas
Cassure 5 min, NQ	2 626	36 %	−0,015 %	−0,030 %	+0,001 %	72,4 %	−0,007 %	−0,024 %	Ne passe pas

Aucune ne passe. En 1 minute, l'EMA 9/21 prend 47 385 trades. Sans frais et sans levier, 10 000 € deviennent 13 098 €. Avec nos frais, 167 €.

La plus proche, l'élan de la 1re heure : +0,020 % par trade, mais −0,017 % sur la 1re moitié et +0,056 % sur la 2e, et 7,1 % au test du hasard. Changement de marché ou période favorable ? Ce test ne permet pas de trancher, donc on ne conclut pas.

La référence : acheter à l'ouverture et vendre à la clôture, chaque jour, fait +0,025 % par jour sur le NQ, mieux que chacune de ces méthodes, et −0,004 % sur l'ES, sur une période plus courte. Sur cette période, le NQ a beaucoup monté.

Ce que ça ne dit pas : le scalping et le day trading ne sont pas prouvés impossibles. Ces règles sont simples et sans lecture du carnet d'ordres ni décision humaine.

Sources : fichiers publics sur Hugging Face. NQ : licence MIT indiquée par son auteur, origine des cours non précisée, écart médian de 0,065 % avec les clôtures Yahoo. ES : aucune licence indiquée, sert seulement de second marché. Aucun cours n'est diffusé ici.

Les limites de tout ce dossier

Le passé ne dit rien de l'avenir. Tester 30 méthodes augmente le risque qu'une passe par chance, d'où notre seuil de 1 %. Les données viennent de Yahoo Finance et de fichiers publics, et peuvent contenir des erreurs. Les ordres sont simulés. Rien ici n'est un signal, ni un conseil adapté à ta situation.

Avertissement

Contenu pédagogique. Simulations historiques, pas des performances réelles. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. Ce n'est pas un conseil en investissement. Le trading comporte un risque de perte en capital ; avec le levier, tu peux perdre plus que ta mise.

Contact : logiquetrade@gmail.com. Discord : https://discord.gg/caQmhXfbqx