

RAPPORT DE BACKTESTS

Le risque, les résultats, les limites

XAUUSD M5 - Capital initial simulé de 10 000 USD - TMC PRO GOLD v0.2.5

Ce rapport présente les résultats natifs audités de trois tests à 1 % du solde et les références à 5 %. Les comparaisons directes 1 % / 5 % portent sur les mêmes dates et sources de prix ; les références de périodes différentes sont présentées séparément.

DD equity : recul depuis le sommet atteint, pertes latentes incluses ; ce n'est pas un pourcentage du capital initial. **PF** : rapport entre gains et pertes des opérations.

Les trois simulations à 1 % sont indépendantes et leurs périodes se chevauchent. Leurs résultats ne doivent pas être additionnés.

Les trois nouveaux tests à 1 %

Période / source	Net USD	ROI	DD equity	PF
01/10/2022 - 30/09/2026 M1 ouverture, spread 9 pips	+22 610,99	+226,11 %	19,02 %	1,27
01/01/2026 - 30/09/2026 Ticks serveur	+3 121,95	+31,22 %	8,62 %	1,38
01/08/2026 - 30/09/2026 Ticks serveur	+1 051,42	+10,51 %	8,59 %	1,44

Références à 5 %

Période / source	Net USD	ROI	DD equity	PF
01/10/2022 - 30/09/2026 M1 ouverture, spread 9 pips	+560 297,89	+5 602,98 %	71,61 %	1,28
01/08/2026 - 30/09/2026 Ticks serveur	+5 112,56	+51,13 %	37,44 %	1,26
08/08/2026 - 30/09/2026 Ticks serveur ; référence distincte	-1 474,57	-14,75 %	37,26 %	0,85

Le grand résultat sur M1 doit être lu avec ses limites

La simulation à 5 % sur quatre ans affiche +560 297,89 USD, mais son drawdown d'equity atteint 71,61 %. Elle utilise les prix d'ouverture M1 et comporte un trou de 227,5 heures. Sur une position, la perte réalisée a atteint 16,97 % du solde de référence. Ces chiffres ne constituent pas une promesse de résultat futur.

Le capital de 10 000 USD appartient aux simulations. Il ne représente ni un dépôt effectué, ni le solde du compte réel connecté. Aucune mise en route du robot pour des ordres réels n'est établie par ces backtests.

MÉTHODE

Conditions communes de simulation

Des simulations indépendantes, avec dimensionnement recalculé à chaque exécution.

Paramètre	Valeur et portée
Robot / instrument	TMC PRO GOLD 0.2.5 / XAUUSD / graphique M5
Capital et devise	10 000 USD au départ de chaque test ; compte de simulation hedging
Mode de risque	PercentOfCapital ; AccountBalance ; 1 % ou 5 % selon le test
Lot maximal	MaximumLots est inactif dans ce mode. Le volume respecte toujours le minimum, le maximum et le pas du symbole du courtier.
Exposition	Budgets par profil ; jusqu'à deux profils. Aucun plafond absolu agrégé de perte.
Initialisation	1 000 bougies de préparation ; les dates et barres disponibles restent celles de chaque export.
Coûts	Commissions et swaps observés dans le rapport natif. Les montants sont présentés séparément.
État final des tests	Aucune position ouverte ni aucun ordre en attente en fin de test ; audits mécaniques et intégrité des quatre exports vérifiés.

Le nombre de positions compte les entrées distinctes. Une réduction de volume ajoute une opération sans créer une position. Les répartitions par mois ou année suivent la date de clôture UTC, et non la date d'entrée ni le calendrier de New York.

Le budget est un maximum estimé, pas une consommation exacte : sur la première position d'août à 1 %, le budget est de 100 USD, le risque au stop de 82,28 USD et le volume de 0,04 lot. Les arrondis et limites du courtier peuvent réduire le risque engagé.

Deux modèles de prix

Ticks serveur : les deux périodes récentes sont rejouées à partir des ticks fournis par le serveur. Le champ de spread du rapport n'est pas une valeur fixe exportée. L'absence de grands trous dans les bougies M5 ne certifie pas la présence de chaque tick.

Quatre ans sur M1 : modèle de données aux prix d'ouverture M1 serveur, spread fixe de 9 pips. La stratégie reste analysée en M5. Le modèle simplifie les mouvements intrabar et possède un trou connu du 14 au 23 novembre 2022.

Le pourcentage n'est pas une perte maximale garantie

Le robot contrôle la perte monétaire estimée jusqu'au stop accepté. Commissions, swaps, slippage et gaps peuvent produire une perte supérieure. Les résultats à 1 % sont de nouveaux backtests natifs : ils ne sont pas obtenus en divisant les résultats à 5 %.

COMPARAISON 1 % / 5 %

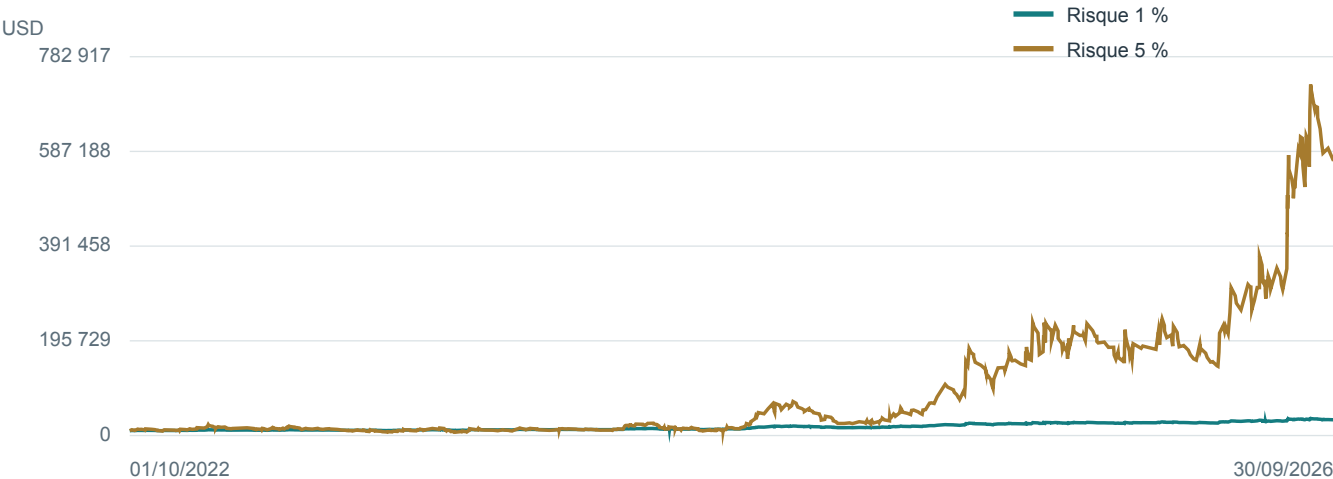
Quatre ans sur prix d'ouverture M1

01/10/2022 - 30/09/2026 | Même capital initial : 10 000 USD | Spread fixe : 9 pips

Indicateur	Risque 1 %	Risque 5 %
Résultat net (USD)	+22 610,99	+560 297,89
Rendement	+226,11 %	+5 602,98 %
Solde final (USD)	32 610,99	570 297,89
Profit factor	1,27	1,28
Drawdown equity natif	19,02 %	71,61 %
Drawdown equity (USD)	3 778,88	211 106,86
Positions / opérations	679 / 682	679 / 697

Résultat qualifié par le modèle et la couverture

Ce test n'est pas un replay sur ticks de quatre ans. Le trou de 227,5 heures entre les bougies traitées du 14/11/2022 00:05 au 23/11/2022 11:35 UTC empêche de parler d'un historique continu. La plus grande perte constatée sur une position atteint 3,37 % du solde de référence dans le test à 1 %, contre 16,97 % dans celui à 5 %. Le budget nominal au stop n'est donc pas un plafond de perte réalisée.



Solde simulé aux clôtures, points natifs reliés pour la lecture. Le drawdown d'equity est la statistique séparée de cTrader ; aucune trajectoire continue d'equity n'est reconstruite.

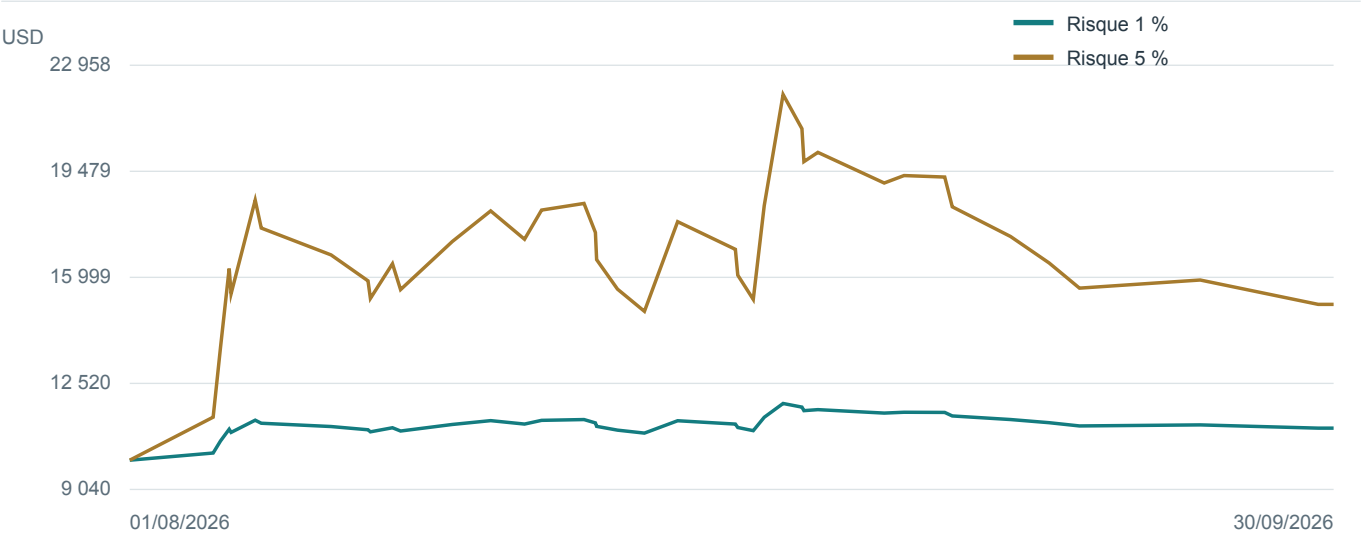
Les commissions et swaps sont inclus dans les résultats nets natifs. Les drawdowns ci-dessus sont les statistiques natives d'equity ; leur maximum en dollars et leur maximum en pourcentage peuvent correspondre à des épisodes différents.

COMPARAISON 1 % / 5 %

Août et septembre 2026 sur ticks

01/08/2026 - 30/09/2026 | Ticks serveur | Capital initial : 10 000 USD

Indicateur	Risque 1 %	Risque 5 %
Résultat net (USD)	+1 051,42	+5 112,56
Rendement	+10,51 %	+51,13 %
Solde final (USD)	11 051,42	15 112,56
Profit factor	1,44	1,26
Drawdown equity natif	8,59 %	37,44 %
Drawdown equity (USD)	1 038,53	9 042,96
Positions / opérations	38 / 38	38 / 38



Solde simulé aux clôtures, points natifs reliés pour la lecture. Le drawdown d'equity est la statistique séparée de cTrader ; aucune trajectoire continue d'equity n'est reconstruite.

Les 38 positions communes ont les mêmes entrées, niveaux de stop et objectif, et clôtures. Le pourcentage de risque modifie les volumes ; les arrondis et l'évolution du solde empêchent de supposer un simple résultat multiplié par cinq.

Pourquoi le départ du 8 août change le résultat à 5 %

Sur le test distinct du 08/08 au 30/09, le net est -1 474,57 USD. Dans le test débutant le 01/08, six positions de la première semaine, quatre gagnantes et deux perdantes, ajoutent +7 617,12 USD. Le solde atteint donc 17 617,12 USD au 8 août. Les 32 positions communes ont les mêmes entrées, niveaux et clôtures, mais des volumes différents parce que le budget dépend du solde.

RISQUE 1 %

Janvier à septembre 2026 sur ticks

01/01/2026 - 30/09/2026 | Ticks serveur | Capital initial : 10 000 USD

Indicateur	Résultat natif à 1 %
Résultat net / rendement	+3 121,95 USD / +31,22 %
Solde final / profit factor	13 121,95 USD / 1,38
Drawdown equity	8,62 % / 1 238,24 USD
Positions / opérations	124 / 126
Commissions / swaps	-81,54 USD / -19,97 USD



Solde simulé aux clôtures, points natifs reliés pour la lecture. Le drawdown d'equity est la statistique séparée de cTrader ; aucune trajectoire continue d'equity n'est reconstruite.

Les maxima de drawdown en dollars et en pourcentage sont conservés séparément par cTrader et peuvent correspondre à des épisodes différents.

Aucun test à 5 % sur ces mêmes neuf mois n'appartient aux résultats déjà audités. Cette période est présentée seule. Comparer son rendement à celui d'août-septembre ou à celui des quatre ans mélangerait des historiques et des conditions différents.

Pertes réalisées dans la simulation

19 position(s) ont une perte nette supérieure au budget initial jusqu'au stop. Le plus grand rapport perte nette / budget initial est de 1,29. Le réglage de 1 % ne borne donc pas toutes les pertes réalisées à 1 %.

COÛTS ET DIMENSIONNEMENT

Ce que le net et le risque mesurent

Les coûts sont issus des opérations historiques exportées, sans hypothèse de rentabilité future.

Test	Brut USD	Commission	Swaps USD	Net USD
4 ans - 1 %	+25 293,54	-1 814,88	-867,67	+22 610,99
2026 - 1 %	+3 223,46	-81,54	-19,97	+3 121,95
Août-sept. - 1 %	+1 071,33	-22,20	+2,29	+1 051,42
4 ans - 5 %	+599 193,06	-25 024,68	-13 870,49	+560 297,89
Août-sept. - 5 %	+5 256,60	-179,64	+35,60	+5 112,56
8 août-sept. - 5 %	-1 463,28	-90,30	+79,01	-1 474,57

Net = brut + commissions + swaps ; coûts effectivement enregistrés par cTrader.

Dépassements constatés du budget nominal

Test	Positions au-delà du budget	Plus grande perte / budget
4 ans - 1 %	356	3,37 x
2026 - 1 %	19	1,29 x
Août-sept. - 1 %	5	1,12 x
4 ans - 5 %	351	3,39 x
Août-sept. - 5 %	18	1,17 x
8 août-sept. - 5 %	13	1,16 x

Les trois modes sont exclusifs

Pourcentage : budget maximal estimé depuis le solde avant l'ordre. **Montant fixe** : budget monétaire choisi. MaximumLots est inactif dans ces deux modes. **Lot maximal** : plafond de volume normalisé au pas et borné par le courtier ; les budgets monétaires sont inactifs, mais une estimation positive du risque reste exigée.

Deux tests fonctionnels séparés sur le 01/08-07/08/2026 ont confirmé six positions de 0,01 lot dans le mode lot maximal, puis six budgets de 100 USD constants dans le mode montant fixe, avec des volumes de 0,04 à 0,09 lot. Ils vérifient le dimensionnement, sans constituer des benchmarks de performance.

VALIDATION ET SOURCES

Une preuve historique, une portée précise

Exports natifs, audits locaux et documentation officielle sont distingués.

Le build v0.2.5 a compilé sans erreur ni avertissement et 138 tests locaux ont réussi. Le binaire public et le binaire installé ont le même SHA-256. Ces vérifications complètent les observations natives ; elles ne prouvent pas, à elles seules, les résultats TradingView ou l'exécution future.

Binaire : c339e64b97677b31ab5f6edb676d51d936bddc801d2646633844ae96b67e3ebd

Le capital simulé en USD est indépendant du solde du compte réel connecté. Après les tests, le dernier état natif vérifié affiche le profil local à 1 %, entrées désactivées et robot arrêté. Aucune exécution réelle ou cloud n'est établie par ce rapport.

Ce que ces tests ne valident pas

Parité historique avec TradingView ; reprise native après redémarrage avec positions ouvertes ; conversion monétaire native BRL ; rentabilité future. Les pertes réalisées et l'exposition simultanée restent différentes du budget nominal de chaque profil.

Références locales

Base : output/ctrader-backtest-2026-10-01/

Chaque dossier contient report.html, events.json, log.txt, parameters.cboset, analysis.json, audit.json et ledger-audit.json. La source Markdown jointe fournit les chemins relatifs au projet et les SHA-256 des exports.

4 ans - 1 % - risque-1pct/run09c-usd-1pct-quatre-ans-m1

2026 - 1 % - risque-1pct/run09b-usd-1pct-2026-ticks

Août-sept. - 1 % - risque-1pct/run09a-usd-1pct-aout-sept-ticks

4 ans - 5 % - run08c-v0.2.5-usd-four-years-m1

Août-sept. - 5 % - run08b-v0.2.5-usd-ticks

8 août-sept. - 5 % - run08a-v0.2.5-usd-ticks

Documentation officielle, consultée le 01/10/2026

[Backtests cTrader Algo : simulation sans effet réel](#)

[Backtester un cBot : M1 serveur et ticks serveur](#)

[cTrader : ordres et stop loss](#)

[cTrader : slippage, gaps et coûts](#)