

NASDAQTANKER : LE JOURNAL DE BORD

Naviguer les eaux volatiles du Nasdaq-100 avec la robustesse pour bouisse.



Un projet de recherche quantitative open source. Dédié à la structuration du risque, pas à la promesse de performance.

UN OCÉAN D'OPPORTUNITÉS ET DE PÉRILS

Le Nasdaq-100 est un des moteurs de performance les plus puissants du monde financier. Un environnement structurellement haussier. Cependant, sa nature volatile le soumet à des tempêtes violentes et soudaines. Les corrections peuvent être brutales. Le véritable défi n'est pas de capturer chaque vague de hausse, mais de survivre aux creux.



OPPORTUNITÉ

Investir sur un actif structurellement haussier.



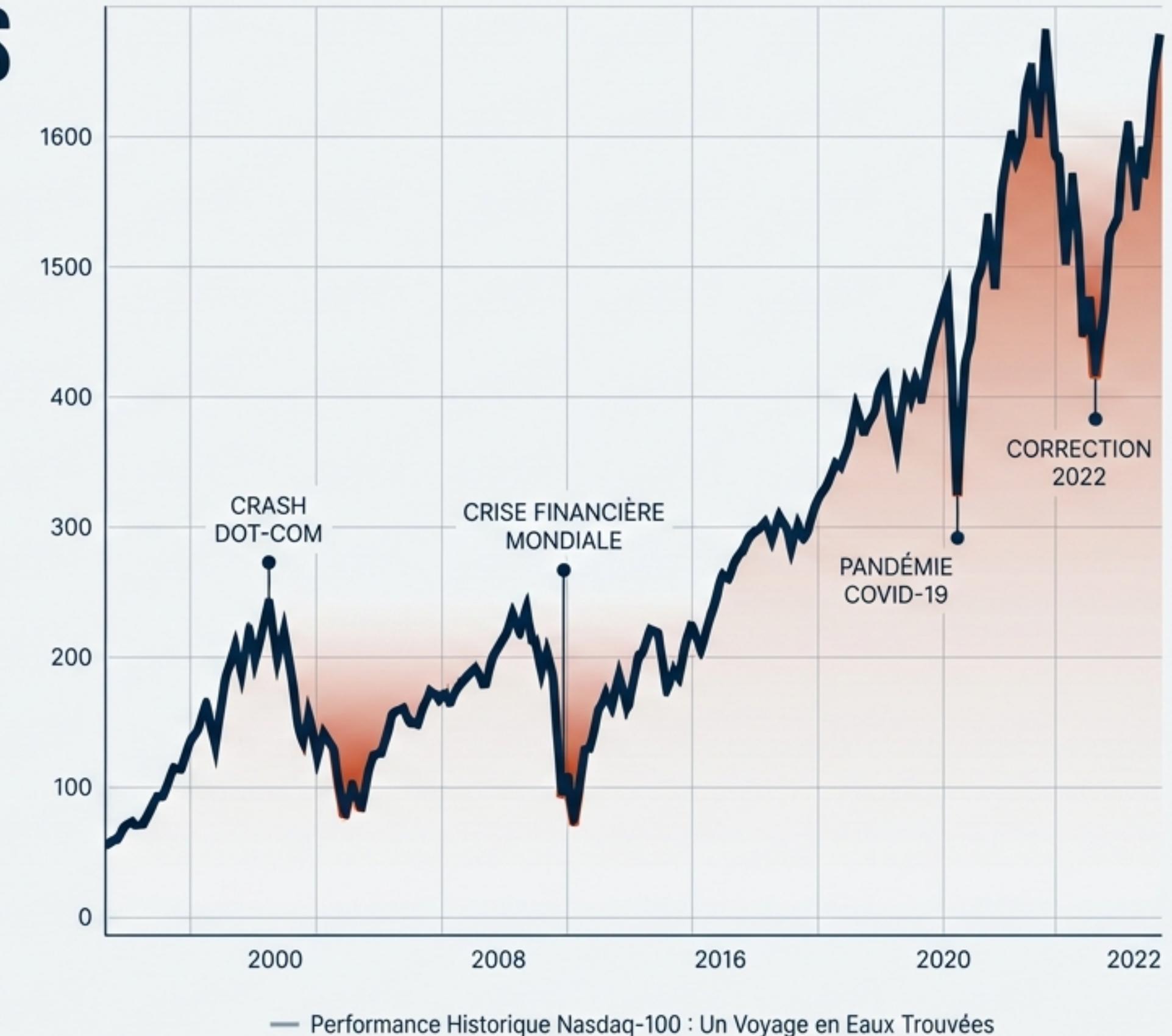
RISQUE

Assumer le risque actions inhérent.



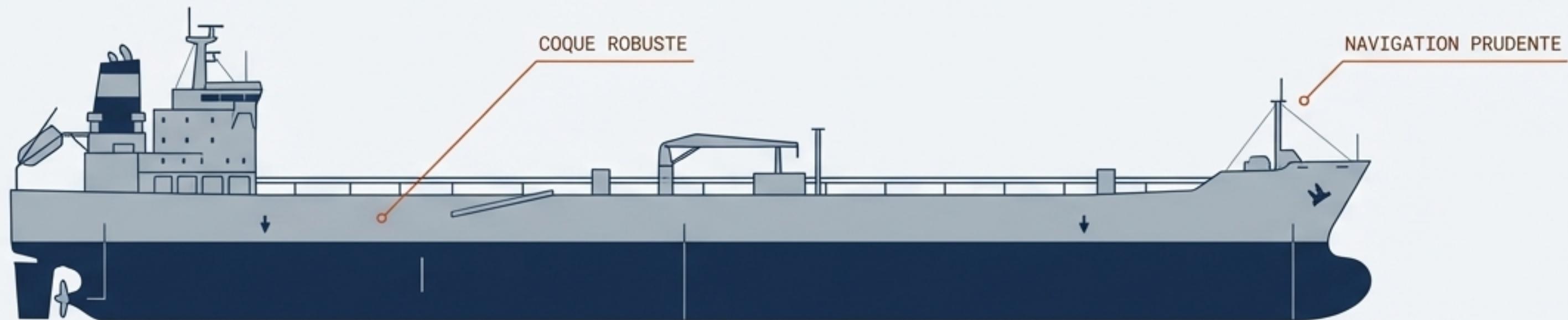
DANGER

Éviter les "drawdowns destructeurs" qui anéantissent le capital à long terme.



CONSTRUIRE LE VAISSEAU : LA PHILOSOPHIE NASDAQTANKER

« Le cœur du projet n'est pas la performance maximale, mais la survie du capital. »



NasdaqTanker est notre réponse à la volatilité de l'océan Nasdaq.

Ce n'est pas un hors-bord de course, mais un supertanker conçu pour la résilience.

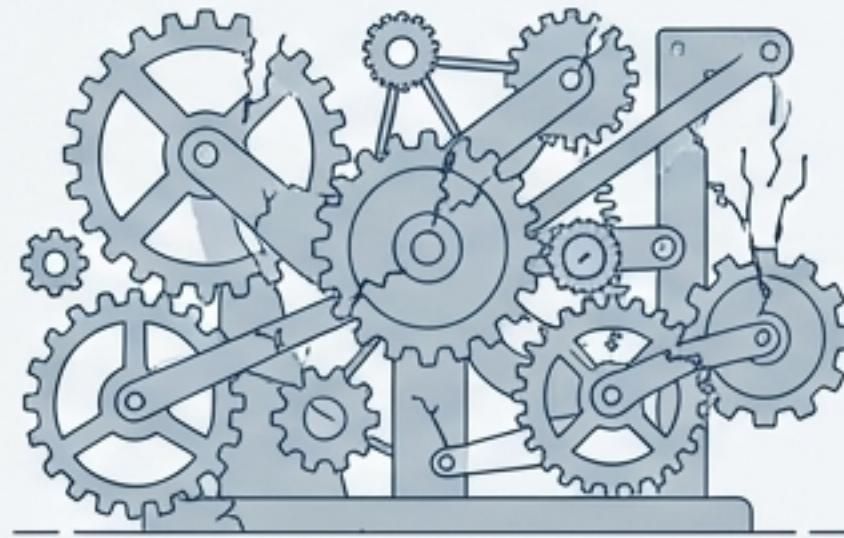
Il s'agit d'un projet de recherche quantitative appliquée, un support pédagogique complet pour illustrer la structuration d'un projet d'algo-trading sérieux, de la recherche à la validation.

Notre objectif est volontairement simple et réaliste : viser des rendements modérés et réguliers, tout en protégeant activement le capital.

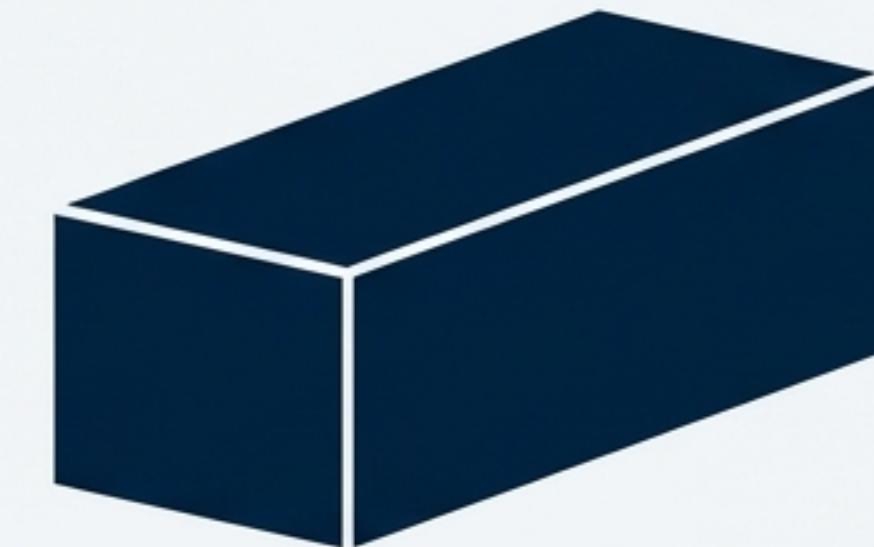
LA BOUSSOLE MÉTHODOLOGIQUE : LA ROUSTESSE AVANT TOUT

« En finance, la robustesse précède toujours l'optimisation. »

SUR-OPTIMISATION



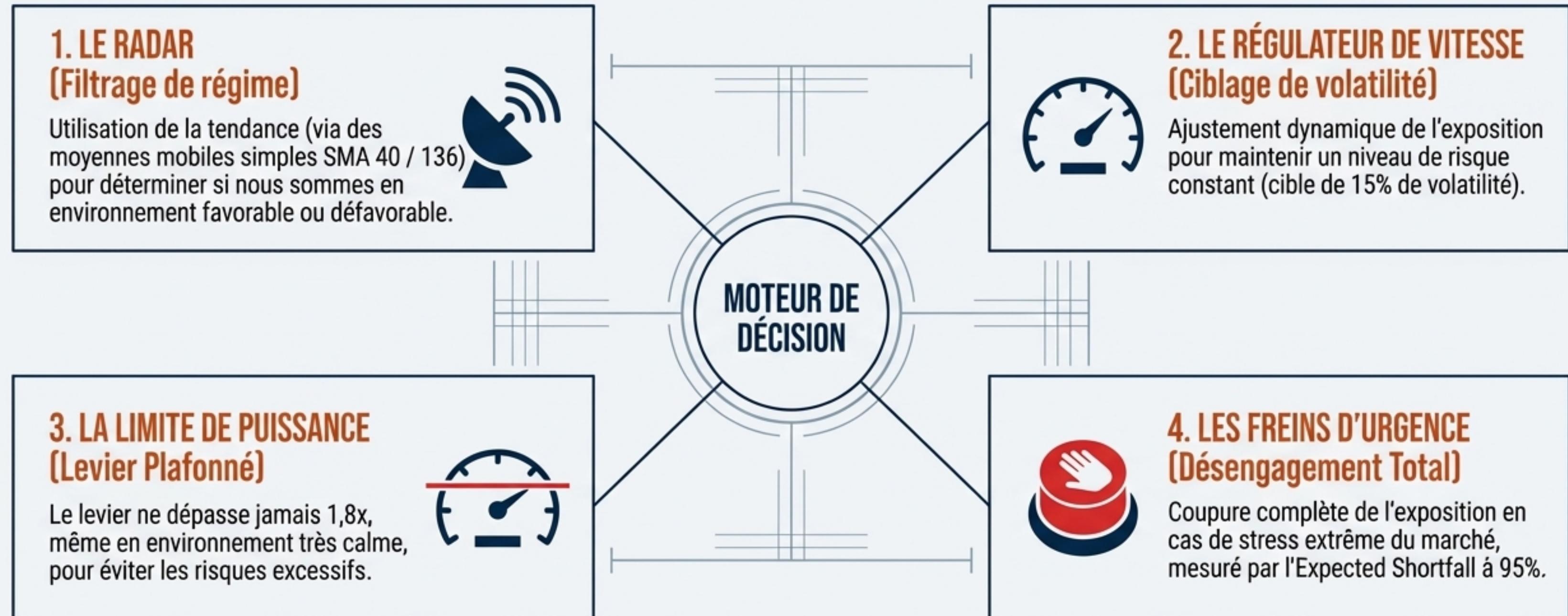
ROUSTESSE



Le choix de systèmes simples et bien structurés est central. Nous démontrons qu'ils peuvent être robustes sans tomber dans l'optimisation excessive ou les modèles sur-paramétrés. La simplicité est une force : elle réduit le risque de sur-ajustement (overfitting) et augmente la probabilité que le système se comporte comme prévu dans des conditions de marché futures. Chaque composant de la stratégie est choisi pour sa solidité éprouvée, pas pour sa performance théorique maximale sur des données passées.

DANS LA SALLE DES MACHINES : L'INGÉNIERIE DE LA ROUSTESSE

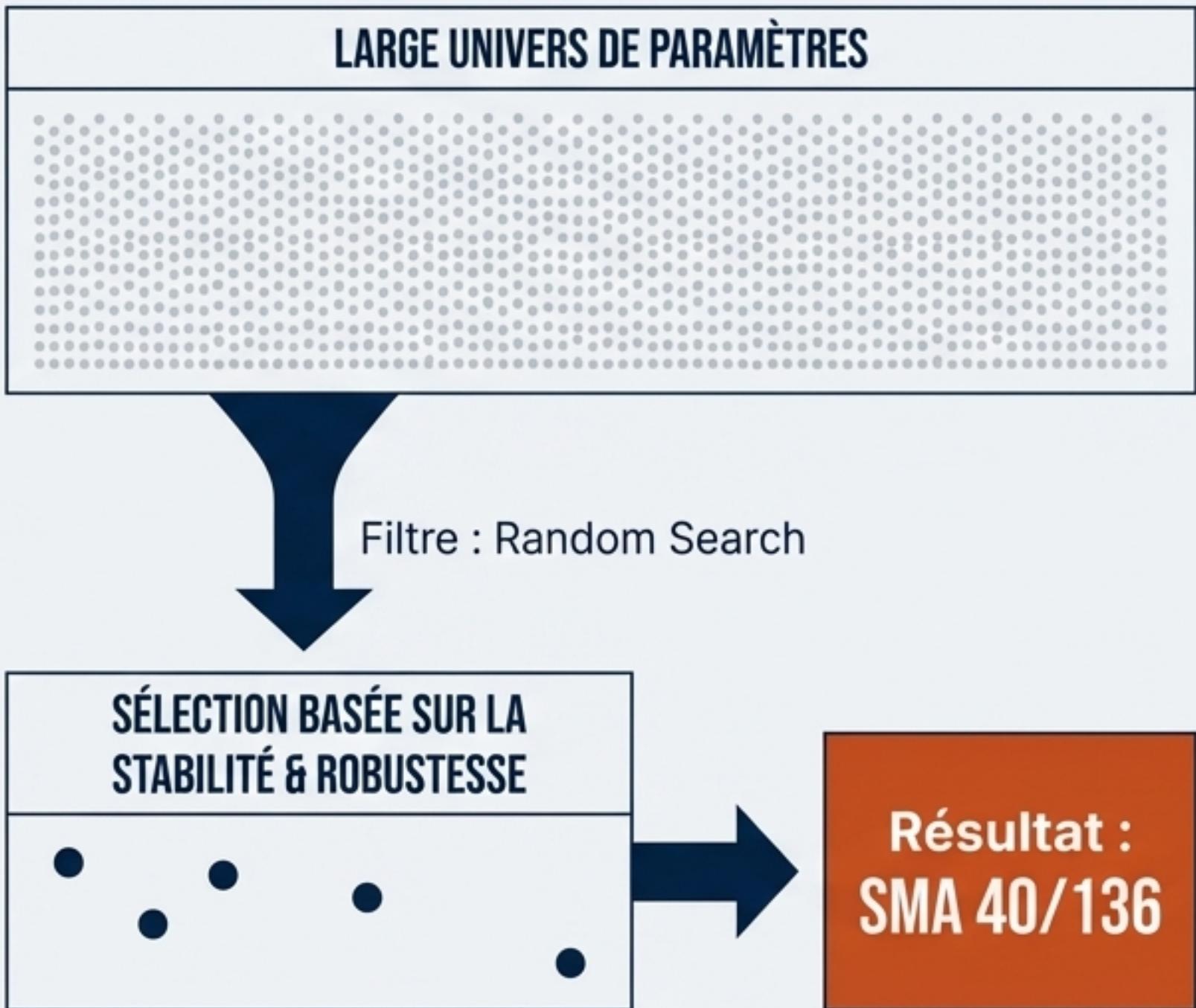
L'architecture de la stratégie est volontairement sobre et repose sur quatre piliers.



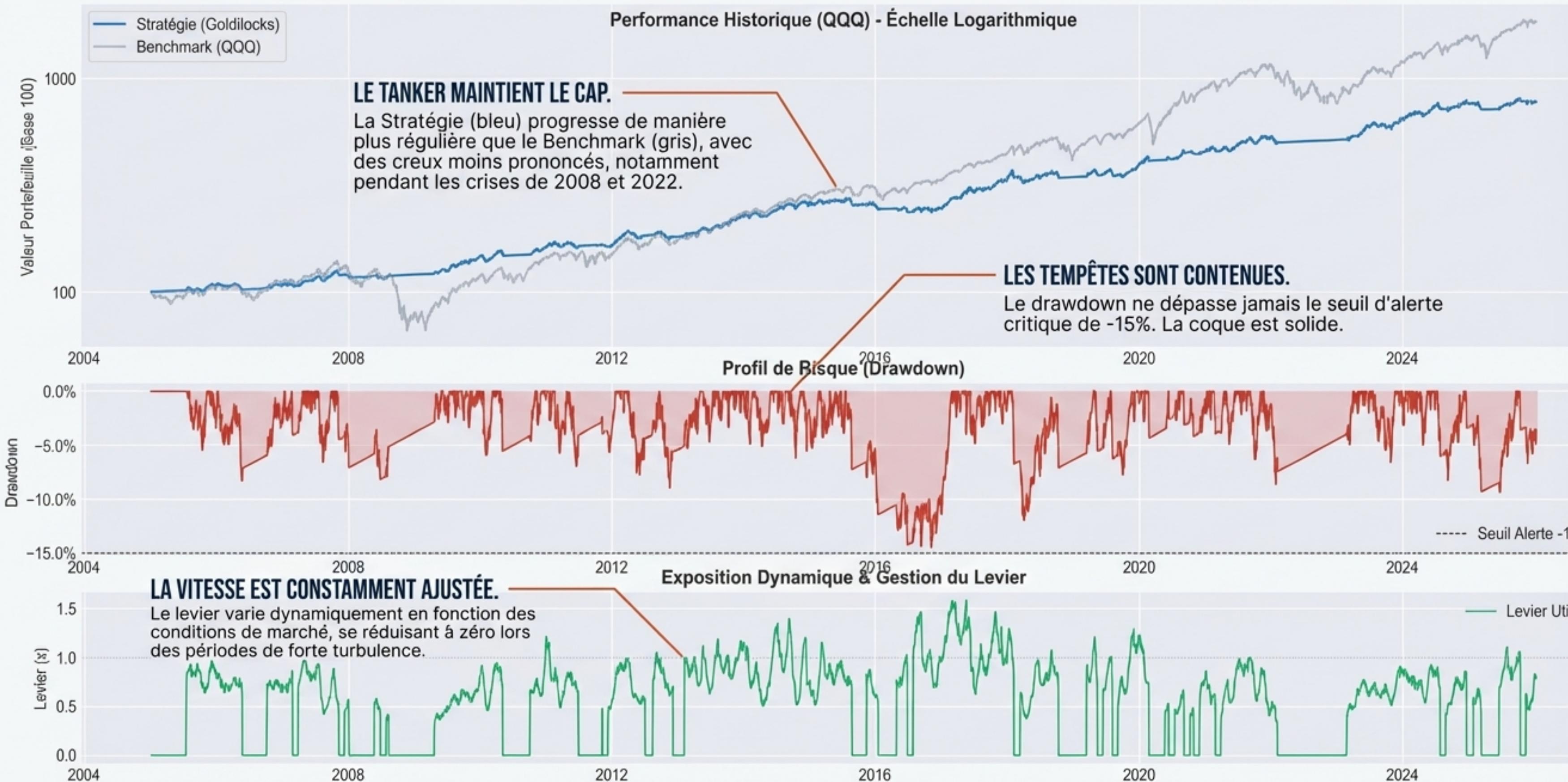
LES PLANS DÉTAILLÉS : LE CHOIX DES MOYENNES MOBILES SIMPLES

Pourquoi les SMA 40 et 136 ?

- Ces paramètres n'ont pas été choisis arbitrairement pour maximiser la performance historique.
- **Étape 1 : Recherche Aléatoire.** Ils résultent d'un 'random search' orienté sur le ratio de Sharpe, explorant un large univers de possibilités.
- **Étape 2 : Critère de Sélection.** Ils ont été retenus non pas pour leur performance maximale, mais pour leur **stabilité** et leur **robustesse hors-échantillon** démontrées lors des tests.
- Cette approche en deux étapes est une bonne pratique de recherche quantitative, réduisant le risque de sélectionner des paramètres qui ne sont performants que par chance sur les données passées.

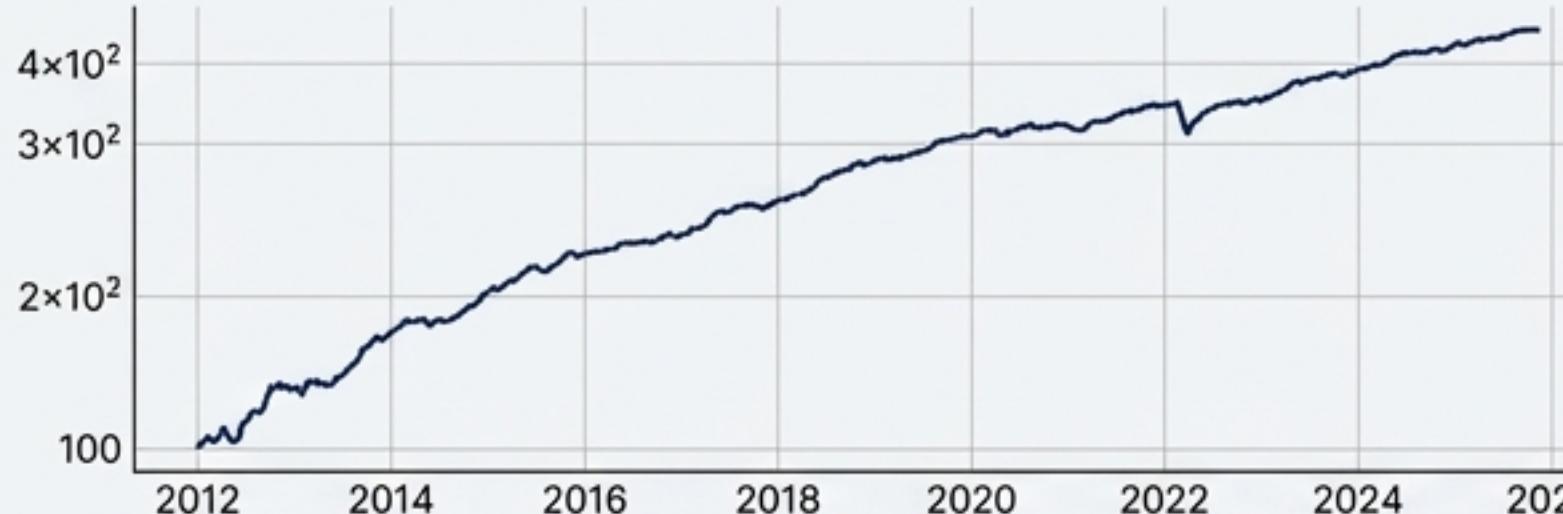


LE JOURNAL DE BORD : 20 ANS DE NAVIGATION (2004-2024)



TESTS DE NAVIGABILITÉ : UNE VALIDATION RIGOUREUSE

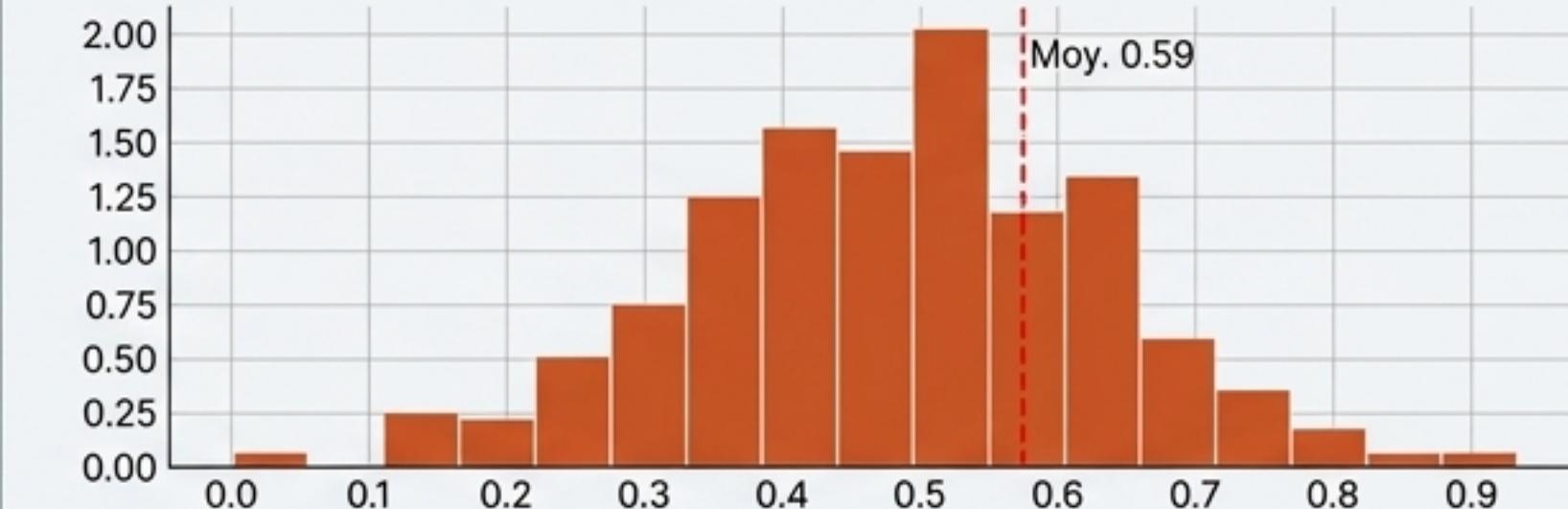
1. Courbe OOS Walk-Forward



Takeaway :

Le Vaisseau navigue en eaux inconnues. La performance reste constante sur des données que le modèle n'a jamais vues, confirmant que la stratégie n'est pas sur-optimisée.

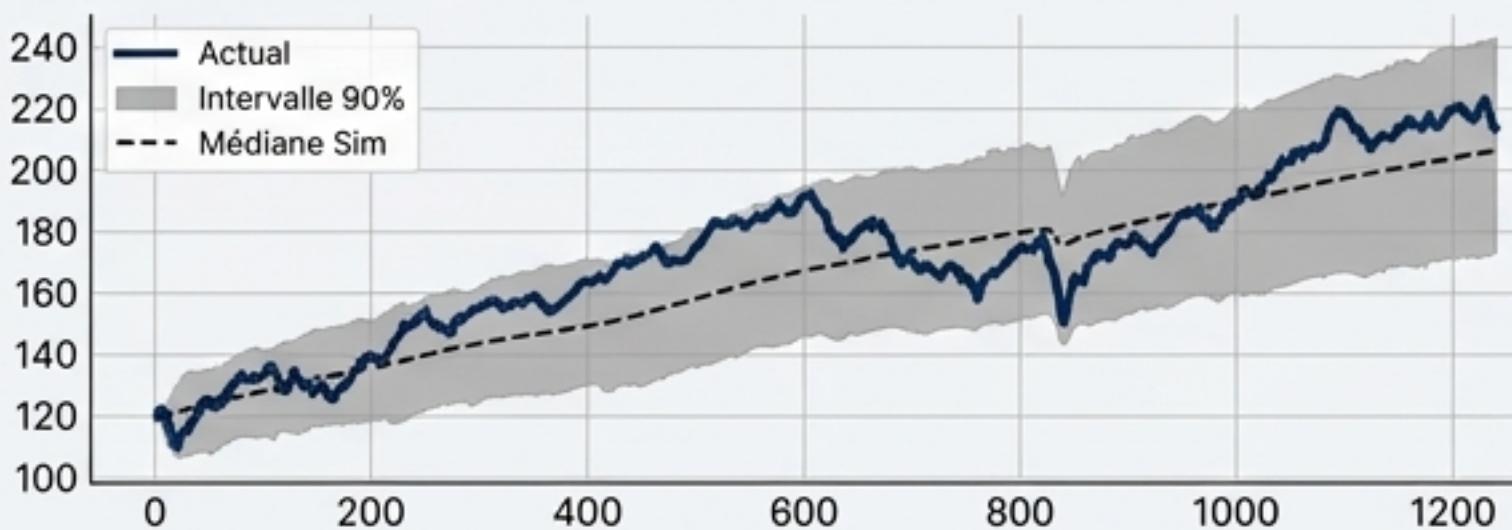
2. Stabilité du Sharpe (CPCV)



Takeaway :

Le compas est fiable. Le ratio de Sharpe (Moy. 0.59) est stable et robuste à travers différentes périodes de marché.

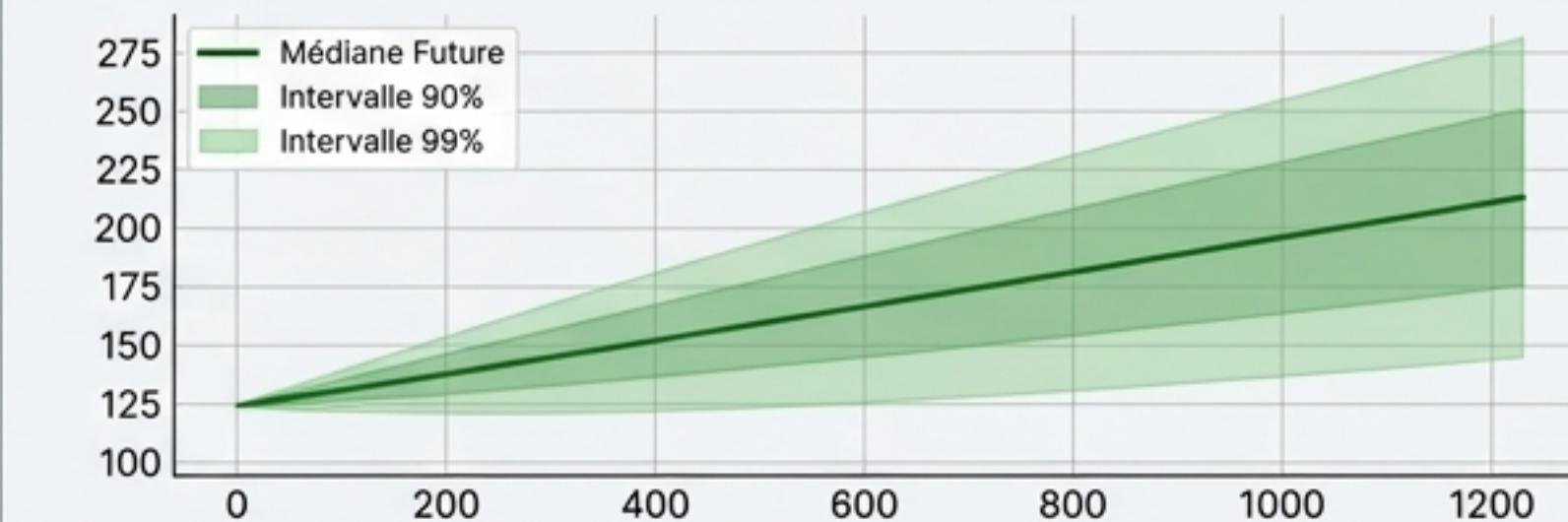
3. Réalité vs Simulations (Passé)



Takeaway :

Le journal de bord est conforme aux prévisions. La performance réelle s'est inscrite dans l'éventail des simulations statistiques.

4. Projection Probabiliste (5 Ans)



Takeaway :

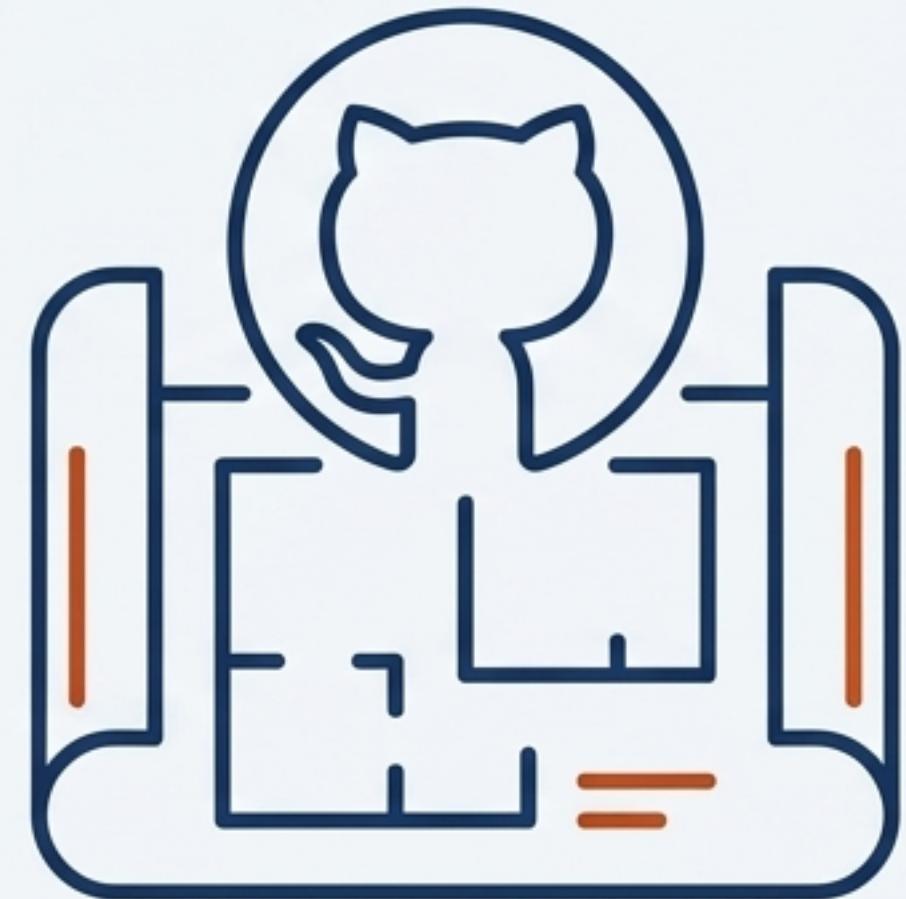
Cartographier les routes futures. Les projections montrent une trajectoire attendue positive, tout en quantifiant l'incertitude.

PARTAGER LES PLANS DE CONSTRUCTION : NOTRE ENGAGEMENT OPEN SOURCE

L'open source n'est pas un argument marketing. C'est un outil de discipline méthodologique et de transmission.

Objectifs pédagogiques :

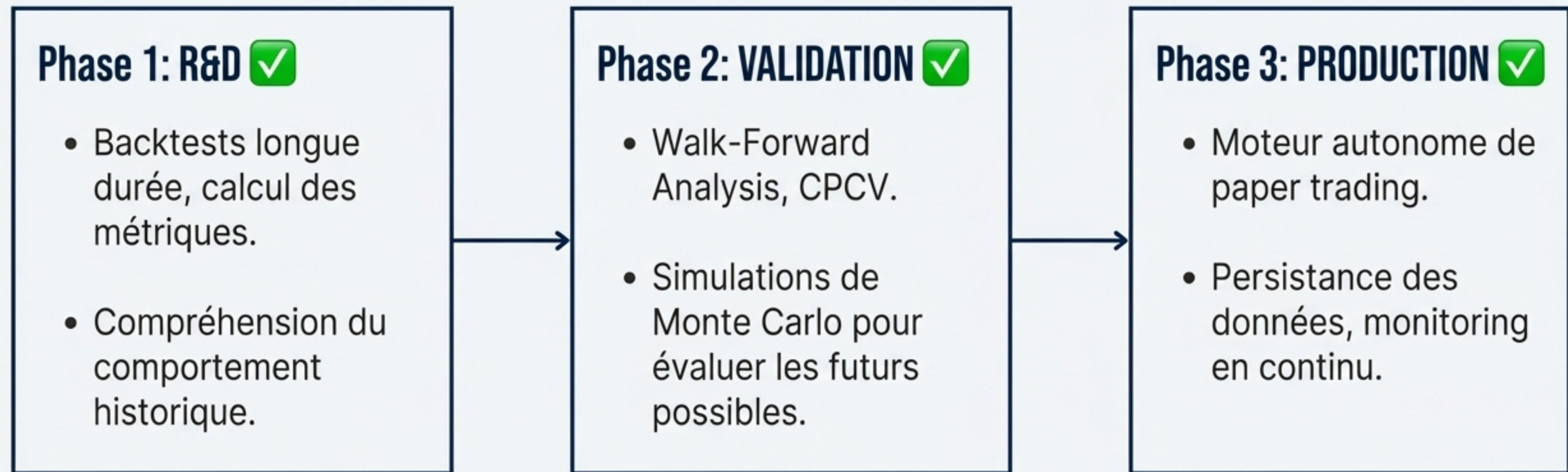
- Permettre la **reproduction** complète des résultats.
- Montrer les **arbitrages** réels entre risque et rendement.
- Exposer en toute transparence les **limites** du système.
- Illustrer les **bonnes pratiques** de la recherche quantitative.



Dépôt GitHub :
<https://lnkd.in/evETb53F>

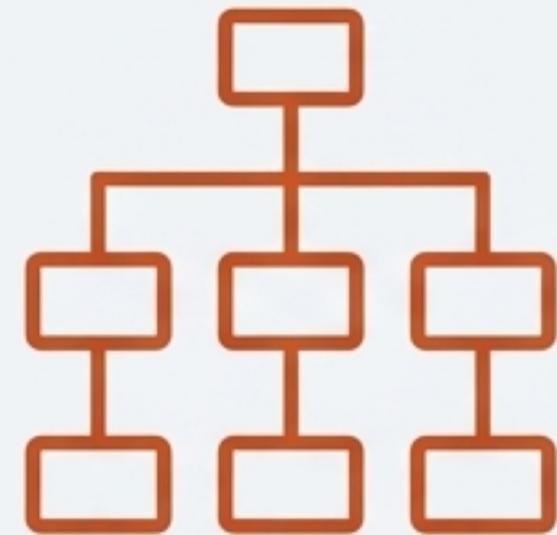
UNE ARCHITECTURE DE RECHERCHE OUVERTE ET REPRODUCTIBLE

Le dépôt est organisé comme un workflow quantitatif complet. Chaque étape est visible, documentée et critiquable.



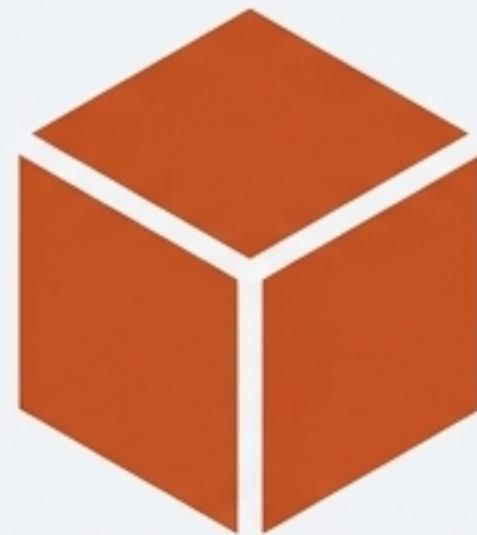
CE QUE NASDAQTANKER VOUS APPRENDRA À MAÎTRISER

Ce projet s'adresse à celles et ceux qui veulent comprendre :



LA STRUCTURE

Comment structurer un projet quantitatif propre, de l'idée à la validation.



LA SIMPLICITÉ

Pourquoi la simplicité, lorsqu'elle est bien pensée, peut être une force et un gage de robustesse.



LA PRIORITÉ

Et pourquoi, en finance, la robustesse et la survie du capital doivent toujours précéder la recherche de l'optimisation à tout prix.

MONTEZ À BORD : EXPLOREZ, APPRENEZ, CONTRIBUEZ

Les plans du NasdaqTanker sont à vous. Plongez dans le code, questionnez la méthodologie, et adaptez les outils pour votre propre apprentissage. La recherche quantitative est un voyage collaboratif.



Explorez le code sur GitHub :
<https://github.com/Optralnvest/NasdaqTanker>