LUCIDFLEX 25K · ANALYSE QUANTITATIVE

Ton budget prop firm

Combien d'évaluations prévoir, avec quel budget et quelle stratégie, **pour aller jusqu'au premier retrait** ? Chaque stratégie est simulée dans un **scénario défavorable** et un **scénario favorable**.

> **Le budget ne remplace pas l'edge.** Il ne fait qu'acheter du temps à une stratégie qui gagne déjà, ou retarder la ruine de celle qui ne gagne pas.

Dans ce playbook

Quatre budgets, trois stratégies, deux scénarios, deux règles de retrait.

01 **Définir la ruine**
Trois façons de perdre, trois chiffres.

02 **Les hypothèses**
Strike, ORB 2.0, Fair Price, et un témoin sans edge.

03 **Obtenir un funded**
La chance de n'en avoir aucun après N évaluations.

04 **Être payé**
Ton budget tient-il jusqu'au premier retrait ?

05 **Bilan et temps**
Finir gagnant, et combien de trades ça prend.

06 **Ta marge d'erreur**
Si ton win rate est 3 points trop optimiste.

200 000 parcours simulés **par stratégie et par scénario**

Trois façons d'être ruiné

Obtenir un funded, être payé, finir gagnant : ce sont trois questions différentes. Chacune a sa propre probabilité de ruine.

1

RUINE N° 1

Aucun funded

Toutes les évaluations achetées échouent. C'est la question que tout le monde se pose… et la moins importante.

2

RUINE N° 2 · LA VRAIE

Budget épuisé avant d'être payé

Tu as dépensé toutes tes évaluations, funded perdus compris, sans jamais toucher un seul retrait.

3

RUINE N° 3

Bilan négatif

Tu as été payé, mais tes retraits ne remboursent pas toutes les évaluations achetées.

L'UNITÉ : LE JETON

1 jeton = 1 évaluation LucidFlex 25K au prix promo de **50,40 $**. Un retrait net vaut 9 à 18 jetons selon son montant.

LES 4 BUDGETS TESTÉS

500 $	1 000 $	1 500 $	3 000 $
9 évaluations	19 évaluations	29 évaluations	59 évaluations

À retenir : un funded n'est pas un salaire. La ruine qui compte pour ton portefeuille, c'est la n° 2 : vider ton budget avant le premier retrait.

Trois stratégies, deux scénarios, un témoin

Chaque win rate est donné dans un **scénario défavorable** (un débutant qui applique moins bien la méthode) et un **scénario favorable** (le win rate mesuré). Pile ou face sert de témoin : un trader sans aucun avantage.

STRIKE / COUNTER STRIKE

Scénario défavorable	**55 %**
Scénario favorable	**64 %**
Ratio · risque en évaluation	**RR 2 · 1 %**
Espérance par trade	**+0,49 / +0,72 R**

Favorable : mesuré en live et en backtest. Hors break-even.

ORB 2.0

Scénario défavorable	**60 %**
Scénario favorable	**70 %**
Ratio · risque en évaluation	**RR 1 · 1 %**
Espérance par trade	**+0,11 / +0,28 R**

Favorable : mesuré à l'aveugle, 56 trades gagnants sur 80. Hors break-even.

FAIR PRICE

Scénario défavorable	**44 %**
Scénario favorable	**54 %**
Ratio · risque en évaluation	**RR 1,5 · 1,25 %**
Espérance par trade	**+0,04 / +0,29 R**

Défavorable : 44 % sur 194 trades. Favorable : 54 %. Sans break-even.

PILE OU FACE

Win rate	**50 %**
Référence	**sans edge**
Ratio · risque en évaluation	**RR 1 · 1 %**
Espérance par trade	**−0,06 R**

Le témoin : un trader qui n'a aucun avantage.

LES RÈGLES DU PARCOURS SIMULÉ

- Une évaluation à la fois, sans copy trading
- Rachat après chaque échec tant que le budget le permet
- Retraits non réinvestis
- 1 trade par séance ; un 2e seulement après une perte
- Frais : 6 % du risque ; 15 % de BE (ORB 2.0, Strike) ; DLL de 600 $
- Funded : risque = ¼ du coussin (solde − plancher)
- 5 retraits pleins, puis passage en live
- Mauvaises périodes : le win rate varie de ±8 points

DEUX RÈGLES DE RETRAIT

Lucid (minimum) : retrait dès 5 jours gagnants ≥ 100 $, au moins 500 $ et au plus 50 % du profit.
Prudence : retrait plein de 1 000 $ seulement, en gardant 7 % de marge au-dessus du plancher.

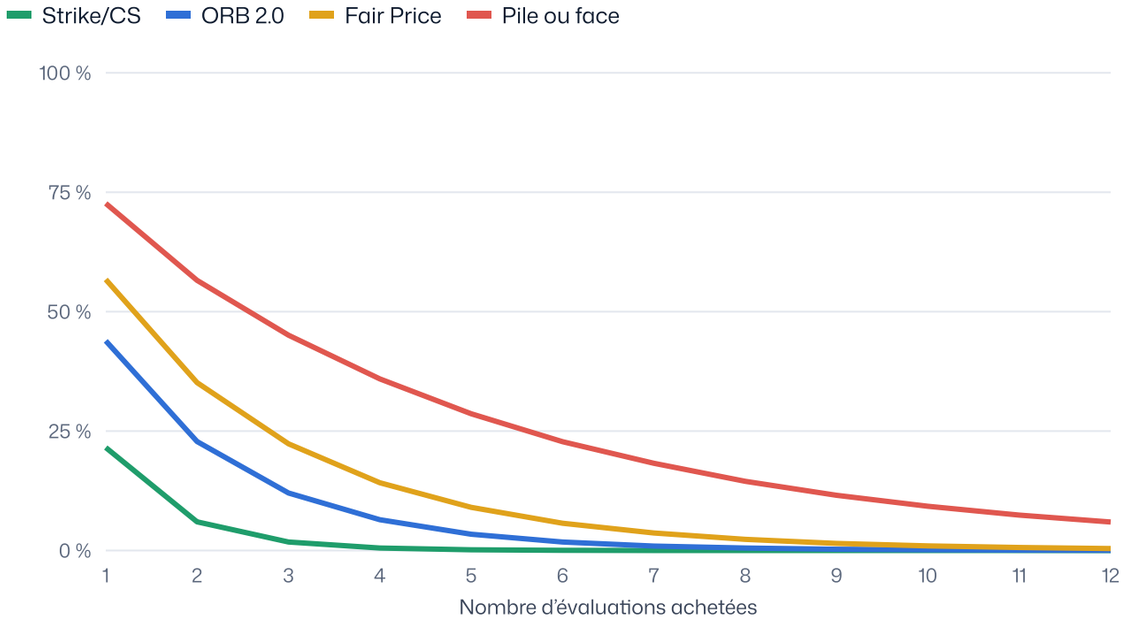
COMMENT C'EST CALCULÉ

200 000 traders virtuels par stratégie, par scénario et par règle, trade par trade, avec les règles LucidFlex 25K (vérifiées le 03/10/2026).

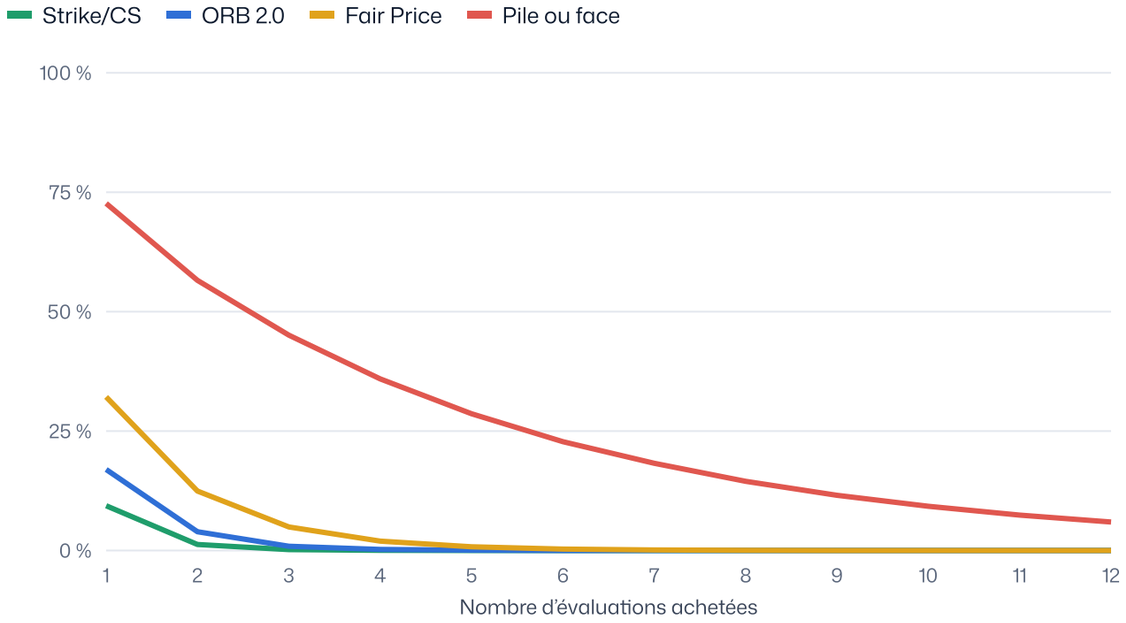
Obtenir un funded est presque garanti

Probabilité de n'avoir **aucun funded** après N évaluations. Même un trader sans edge finit par valider : il suffit d'acheter assez de tickets.

Scénario défavorable



Scénario favorable



5 **Après 5 évaluations, aucun funded**

Défavorable : Strike 0,1 % · ORB 2.0 3,4 %. Favorable : Strike < 0,1 % · ORB 2.0 < 0,1 %. Fair Price 9,0 % · pile ou face 29 %.

! **Le piège**

À pile ou face, 10 évaluations donnent quand même un funded 91 fois sur 100. Valider ne prouve donc pas que tu as un edge.

Ton budget tient-il jusqu'au premier retrait ?

Ruine n° 2 : probabilité de dépenser tout ton budget **sans toucher un seul retrait**. Une évaluation à la fois, à 50,40 $, rachetée après chaque échec.

Stratégie · win rate	500 $ 9 évals		1 000 $ 19 évals		1 500 $ 29 évals		3 000 $ 59 évals	
	Lucid	Prudence	Lucid	Prudence	Lucid	Prudence	Lucid	Prudence
Strike / Counter Strike · 55 % DÉFAVORABLE	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %
Strike / Counter Strike · 64 % FAVORABLE	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %
ORB 2.0 · 60 % DÉFAVORABLE	1,3 %	3,4 %	< 0,1 %	0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %
ORB 2.0 · 70 % FAVORABLE	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %
Fair Price · 44 % DÉFAVORABLE	14 %	33 %	1,7 %	9,7 %	0,2 %	2,9 %	< 0,1 %	< 0,1 %
Fair Price · 54 % FAVORABLE	< 0,1 %	0,2 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %
Pile ou face · 50 % SANS EDGE	48 %	79 %	22 %	62 %	10 %	48 %	1,0 %	23 %

1 Edge solide

En scénario favorable, Strike, ORB 2.0 et Fair Price à 54 % : **500 $ suffisent**, quelle que soit la règle de retrait.

2 Edge mince

Fair Price à 44 % avec 500 $: 14 % de ruine (Lucid), 33 % (prudence). Attendre le gros retrait coûte cher.

3 Sans edge

Pile ou face avec 500 $: 48 % à 79 % de ne jamais être payé.

Finir gagnant, et le vrai coût : le temps

Ruine n° 3 : probabilité de finir en perte une fois tout le budget utilisé (retraits nets moins évaluations achetées). En dessous : le nombre de trades joués jusqu'au premier retrait (médiane).

Stratégie · win rate	500 $ (9 évals)		1 000 $ (19 évals)		1 500 $ (29 évals)		3 000 $ (59 évals)	
	Lucid	Prudence	Lucid	Prudence	Lucid	Prudence	Lucid	Prudence
Strike / Counter Strike · 55 % **DÉFAVORABLE**	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %
Strike / Counter Strike · 64 % **FAVORABLE**	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %
ORB 2.0 · 60 % **DÉFAVORABLE**	1,3 %	3,4 %	< 0,1 %	0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %
ORB 2.0 · 70 % **FAVORABLE**	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %
Fair Price · 44 % **DÉFAVORABLE**	14 %	33 %	5,7 %	16 %	2,2 %	5,5 %	0,2 %	0,8 %
Fair Price · 54 % **FAVORABLE**	< 0,1 %	0,2 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %
Pile ou face · 50 % **SANS EDGE**	48 %	79 %	46 %	74 %	42 %	63 %	33 %	60 %

COMBIEN DE TRADES AVANT D'ÊTRE PAYÉ ? BARRE PLEINE : LUCID · BARRE CLAIRE : PRUDENCE



Strike / Counter Strike · 55 % DÉFAVORABLE	Lucid : **25 trades** (dont 13 en funded) · Prudence : **37** (24)
Strike / Counter Strike · 64 % FAVORABLE	Lucid : **18 trades** (dont 10 en funded) · Prudence : **25** (16)
ORB 2.0 · 60 % DÉFAVORABLE	Lucid : **71 trades** (dont 19 en funded) · Prudence : **154** (67)
ORB 2.0 · 70 % FAVORABLE	Lucid : **33 trades** (dont 13 en funded) · Prudence : **61** (40)
Fair Price · 44 % DÉFAVORABLE	Lucid : **75 trades** (dont 15 en funded) · Prudence : **180** (38)
Fair Price · 54 % FAVORABLE	Lucid : **29 trades** (dont 13 en funded) · Prudence : **56** (34)
Pile ou face · 50 % SANS EDGE	Lucid : **208 trades** (dont 14 en funded) · Prudence : **778** (48)

Et si ton win rate est 3 points trop optimiste ?

Ruine n° 2, mêmes budgets, mêmes règles : seul le win rate baisse de 3 points par rapport au **scénario défavorable**. C'est l'erreur classique d'un backtest de 50 à 100 trades.

Stratégie · win rate	500 $		1 000 $		1 500 $		3 000 $	
	Lucid	Prudence	Lucid	Prudence	Lucid	Prudence	Lucid	Prudence
Strike/CS · 55 % scénario défavorable	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %
Strike/CS · 52 % 3 points de moins	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %
ORB 2.0 · 60 % scénario défavorable	1,3 %	3,4 %	< 0,1 %	0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %	< 0,1 %
ORB 2.0 · 57 % 3 points de moins	6,8 %	19 %	0,4 %	3,0 %	< 0,1 %	0,5 %	< 0,1 %	< 0,1 %
Fair Price · 44 % scénario défavorable	14 %	33 %	1,7 %	9,7 %	0,2 %	2,9 %	< 0,1 %	< 0,1 %
Fair Price · 41 % 3 points de moins	30 %	58 %	8,5 %	33 %	2,3 %	18 %	< 0,1 %	3,2 %

1 **Edge solide = marge d'erreur**
Le Strike à 52 % reste quasi sans ruine dès 500 $, avec les deux règles.

2 **ORB 2.0 à 57 %**
Avec 1 000 $, la ruine reste sous 3,1 % : un budget de 1 000 $ absorbe l'erreur de mesure.

3 **La règle pratique**
Dimensionne ton budget sur le **bas de ta fourchette** de win rate, jamais sur ton meilleur chiffre.

À retenir

RUINE N° 2 — **Mesurer la bonne ruine**
Obtenir un funded est presque garanti. La question : serai-je payé avant d'avoir vidé mon budget ?

EDGE — **L'edge décide, le budget suit**
En scénario favorable, 500 $ suffisent pour les trois stratégies. En défavorable, le Fair Price à 44 % demande 1 000 $ (Lucid) à 3 000 $ (prudence).

RETRAIT — **Retirer tôt ou garder de la marge**
Le retrait minimum Lucid paie plus vite ; la marge de 7 % protège le funded mais demande environ 2 fois plus de trades.

SANS EDGE — **Une loterie, pas un plan**
Pile ou face finit parfois payé grâce aux règles de la firme, mais une grosse partie perd sa mise.

−3 PTS — **Prévoir l'erreur de mesure**
Calcule ton budget sur le bas de ta fourchette de win rate, surtout si ton edge est mince.

Quel budget pour quel profil ?

Budget minimal pour passer sous 2 % de ruine n° 2, une évaluation à la fois.

	LUCID	PRUDENCE
Strike / Counter Strike · 55 % DÉFAVORABLE	**500 $**	**500 $**
Strike / Counter Strike · 64 % FAVORABLE	**500 $**	**500 $**
ORB 2.0 · 60 % DÉFAVORABLE	**500 $**	**1 000 $**
ORB 2.0 · 70 % FAVORABLE	**500 $**	**500 $**
Fair Price · 44 % DÉFAVORABLE	**1 000 $**	**3 000 $**
Fair Price · 54 % FAVORABLE	**500 $**	**500 $**
Pile ou face · 50 % SANS EDGE	**3 000 $**	**aucun**

Avant tout budget : **prouve ton edge** sur un échantillon suffisant de trades conformes à ton plan.

wmtheswisstrader.com · YouTube @TheSwissTrader

Comment lire ces chiffres

1 Deux scénarios

Le **favorable** reprend le win rate mesuré de chaque stratégie (Strike : live et backtest ; ORB 2.0 : 56 sur 80 à l'aveugle ; Fair Price : 54 %). Le **défavorable** retire environ 10 points, pour un trader qui applique moins bien la méthode.

2 Une simulation

200 000 parcours par stratégie, par scénario et par règle, trade par trade, avec les frais, le break-even, la limite journalière et les règles de retrait LucidFlex 25K.

3 Des hypothèses

Les mauvaises périodes sont modélisées par un win rate qui varie de ±8 points. Les règles d'une prop firm peuvent changer : vérifie-les avant d'acheter.

Illustrations pédagogiques : simulations sous hypothèses, ni résultats de trading ni prévisions. Aucun retrait ni taux de validation n'est garanti. Le trading de futures et les évaluations de prop firm comportent un risque de perte, dont les frais d'inscription. Vérifie les règles contractuelles de chaque firme. Document pédagogique : aucun conseil financier ni signal à copier.

Aller plus loin

Les maths de la prop firm, le Strike, l'ORB 2.0 et le Fair Price sont expliqués en vidéo sur la chaîne YouTube. Le plan de challenge complet et l'accompagnement sont dans la formation.

YouTube · @TheSwissTrader · wmtheswisstrader.com