

Séries de pertes • *attendues*

Une série de pertes n'est pas un signal d'alarme : c'est ce que les probabilités prévoient.

Série de pertes la plus longue

MOYENNE ATTENDUE, EN PERTES D'AFFILÉE

WIN RATE	50 TRADES	100 TRADES	200 TRADES
25 %	10,4	12,7	15,1
30 %	8,8	10,7	12,6
33 %	8,0	9,7	11,4
40 %	6,5	7,9	9,2
50 %	5,0	6,0	7,0
60 %	3,9	4,6	5,4
70 %	3,0	3,5	4,1

Probabilité sur 100 trades

D'AVOIR AU MOINS K PERTES D'AFFILÉE

WIN RATE	≥ 5	≥ 7	≥ 10	≥ 12
25 %	100 %	99 %	79 %	55 %
30 %	100 %	95 %	58 %	33 %
33 %	100 %	90 %	45 %	22 %
40 %	98 %	69 %	20 %	8 %
50 %	81 %	32 %	4 %	1 %
60 %	46 %	9 %	1 %	0 %
70 %	15 %	1 %	0 %	0 %

Ce que ça coûte

PERTE DU COMPTE, SELON LE RISQUE PAR TRADE

SÉRIE	0,5 %	1 %	2 %	3 %	5 %
3 pertes	-1,5 %	-3,0 %	-5,9 %	-8,7 %	-14,3 %
5 pertes	-2,5 %	-4,9 %	-9,6 %	-14,1 %	-22,6 %
7 pertes	-3,4 %	-6,8 %	-13,2 %	-19,2 %	-30,2 %
10 pertes	-4,9 %	-9,6 %	-18,3 %	-26,3 %	-40,1 %
15 pertes	-7,2 %	-14,0 %	-26,1 %	-36,7 %	-53,7 %

Pour revenir à zéro

GAIN NÉCESSAIRE APRÈS UNE BAISSE DU COMPTE

BAISSE	GAIN REQUIS
-5 %	+5,3 %
-10 %	+11,1 %
-15 %	+17,6 %
-20 %	+25,0 %
-30 %	+42,9 %
-40 %	+66,7 %
-50 %	+100,0 %

MODÈLE SIMPLE : TRADES INDÉPENDANTS, WIN RATE CONSTANT, PERTE ÉGALE AU RISQUE FIXÉ AVANT L'ENTRÉE (CALCUL EXACT, PAS UNE APPROXIMATION).

LES PERTES DU COMPTE SUPPOSENT UN RISQUE EN % DU SOLDE COURANT. UN ÉCHANTILLON DE 20 TRADES NE PERMET PAS DE CONCLURE SUR UN WIN RATE.

TRADE STACK • LE JOURNAL DU TRADER • TRADESTACK.FR