

REALITY

なぜ「検証では勝てるのに、
実戦では負ける」のか？

トレーダーを苦しめる「5つのズレ」と、その解決策

その悩み、あなただけではありません。

バックテストの資金曲線は完璧。
勝率もリスクリワードも理想的。
でも、実戦では資金が減っていく。

「検証って意味ないのかな……」
「自分には才能がないのかな……」

検証が間違っているわけではない。
問題は「ズレ」にある。



バックテストと実戦は「別のゲーム」

THE MAP (Backtest)

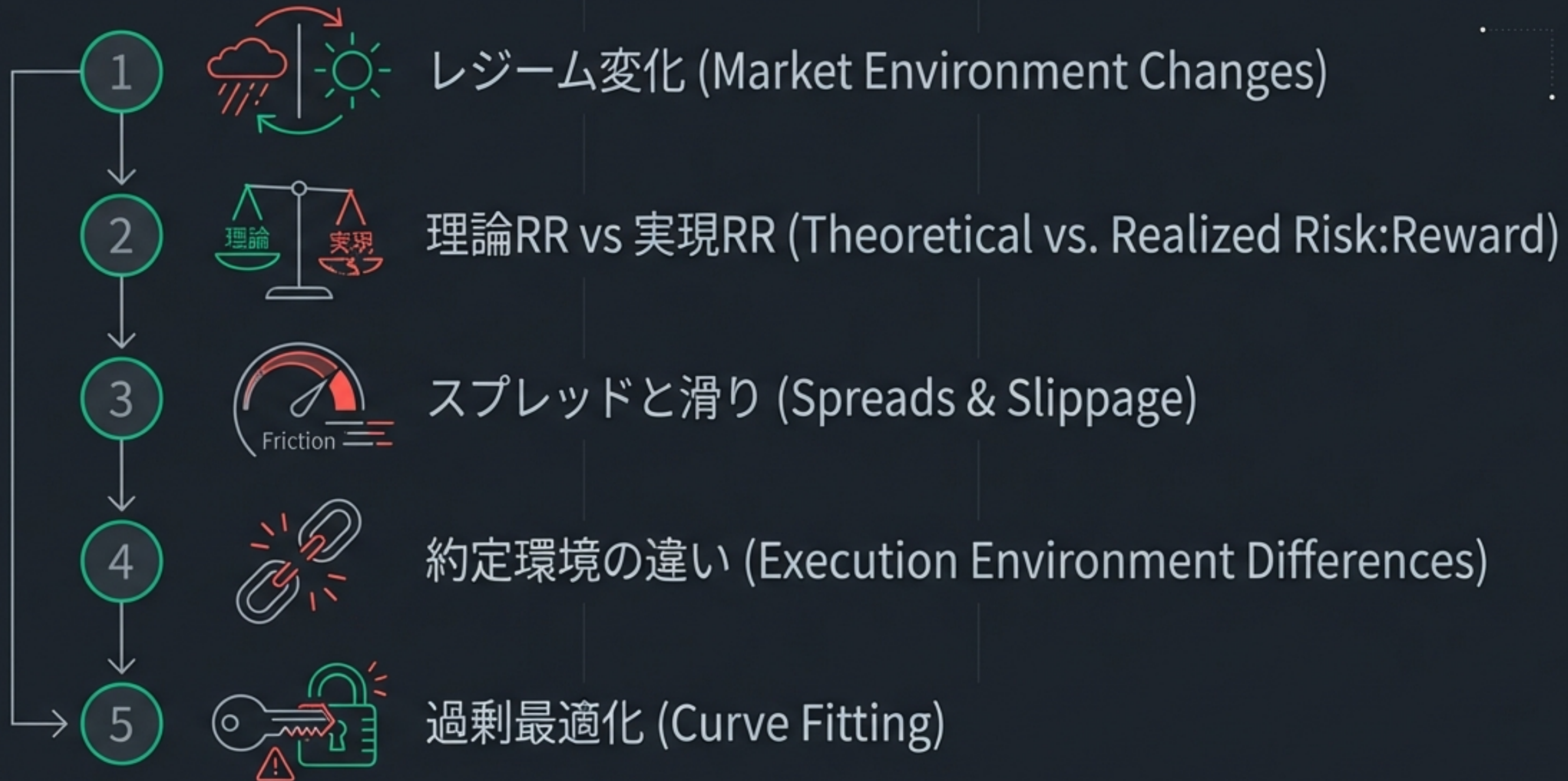


THE TERRITORY (Reality)



地図（検証）は正しいとしても、現地（実戦）には天気や渋滞が存在する。この「ズレ」の正体を知る必要がある。

実戦を狂わせる5つの正体



① 「相場の天気」は変わり続ける

レジーム変化を無視している



特定の期間（天気）だけに最適化された手法は、環境が変わると機能しなくなる。
「勝てなかった期間」こそ確認が必要。

② 机上の空論 vs. 心理的現実

理論RRと実現RRが違う

THEORY (Validation)

Profit Target: +2.0R
Stop Loss: -1.0R



REALITY (Psychology)

Early Exit (Fear): **+1.1R**
Slippage / Delay: **-1.2R**

恐怖と欲が、知らぬ間に期待値をマイナスへ押し下げる。

③ リアル相場の「摩擦」を甘く見てはいけない

スプレッドと滑りの存在



指標発表や市場オープン時、スプレッドは拡大する。短期トレードでは、この「摩擦」が命取りになる。

④ 「買えたつもり」の幻

約定環境が検証と違う



- ヒゲ先でのタッチは約定しない
- 急激なブレイクでの置き去り
- 指値が通らない

「入れたはず」の勝ちトレードが消え、負けトレードだけが残る。

⑤ 最大の罫：過剰最適化

カーブフィッティング



過去データに合わせてパラメーターをいじりすぎる。

「検証では神、実戦では凡人」を生む最大の原因。

では、検証は無意味なのか？

NO.

(絶対そんなことはない！)

Old Purpose:
To predict the future.

New Purpose: To know
how the strategy breaks.
(手法の壊れ方を知ること)

☐ どんな環境で負けるか？ ☐ 最大ドロウダウンは？ ☐ 最大連敗数は？

ズレを埋める「構造改革」 Part 1

ACTION 01

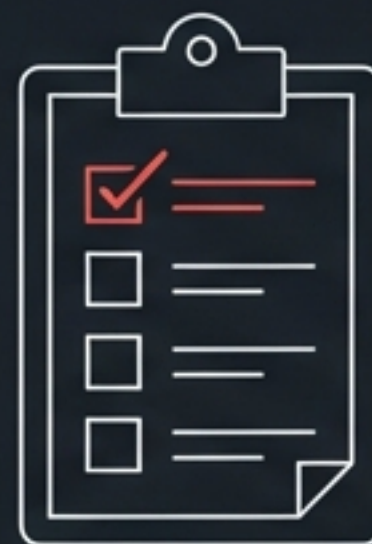
複数年でバックテストする



トレンド相場とレンジ相場の両方を含む3～5年分をテストする。

ACTION 02

実現RRを毎回記録する



計画上のRRではなく、実際に取れた利益Rを記録する。
自分の心理的な「漏れ」を可視化せよ。

ズレを埋める「構造改革」 Part 2

ACTION 03

スプレッドを込みで計算する



特に短期足は必須。
最悪のケース（スプレッド拡大時）を想定して期待値を計算する。

ACTION 04

フォワードテストを挟む



いきなり本番運用しない。小ロットの実弾トレードで、スプレッドや約定の「痛み」を体感する。

現実と戦うためのチェックリスト

PROBLEM (Gap)	SOLUTION (Action)
Regime Change (相場の変化)	Multi-year Testing (複数年テスト)
RR Discrepancy (RRのズレ)	Track Realized RR (実現RRの記録)
Slippage/Spread (摩擦)	Worst-case Calculation (厳しめの計算)
Execution (約定環境)	Forward Testing (フォワードテスト)
Curve Fitting (過剰最適化)	Know how it breaks (壊れ方を知る)

それは「才能」のせいじゃない



勝てないのは運や才能の問題ではなく、構造的な「ズレ」の問題です。

構造的な問題だからこそ、修正可能です。

5つのズレを理解した時、検証は幻想ではなく「本当に使える武器」になります。

応援しています！

Content Source: 鼻ツっぺ

Font: NotoSansJP-VariableFont_wght.ttf

