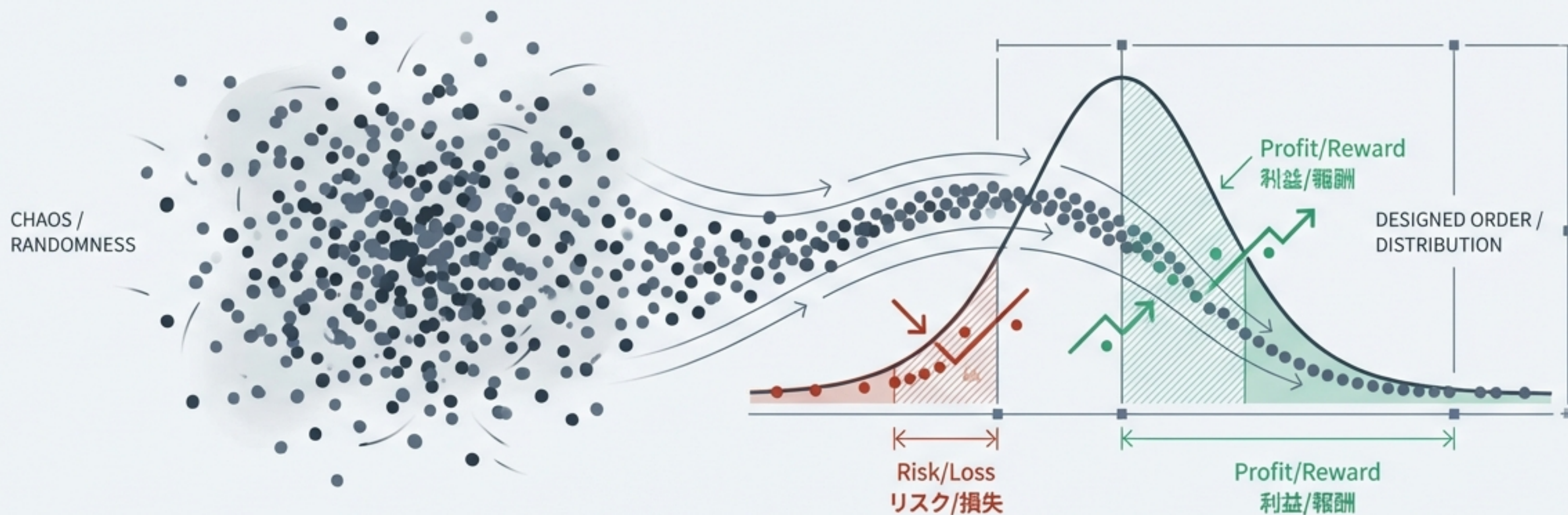


確率論は「勝率」の話ではない。

損益分布を設計する「実現リスクリワード」という思考法



一般的な通説 vs プロの視点

【一般的な通説】

- ・ 勝率60%なら安定する
- ・ 勝率50%じゃ増えない
- ・ とにかく勝率を高めろ！



【プロの視点】

- ・ 勝率そのものは重要ではない
- ・ 重視すべきは『実現リスクリワード』の形
- ・ 長く生き残るトレーダーの共通点



3つの「リスクリワード」を区別する

設計リスクリワード

Designed RR
(The Blueprint)



エントリー時点で
決めた比率

例：損切り-1万 vs 利確+1万
= 1:1

実現リスクリワード

Realized RR
(The Result)



実際のトレード結果から
計算する平均比率

例：平均利益1.2万 vs
平均損失1万 = 1.2:1

期待リスクリワード

Expected RR
(The Future)



実現RRが安定し、
統計的に見込まれる
将来の数値

ケーススタディ：レンジブレイクの基本構造

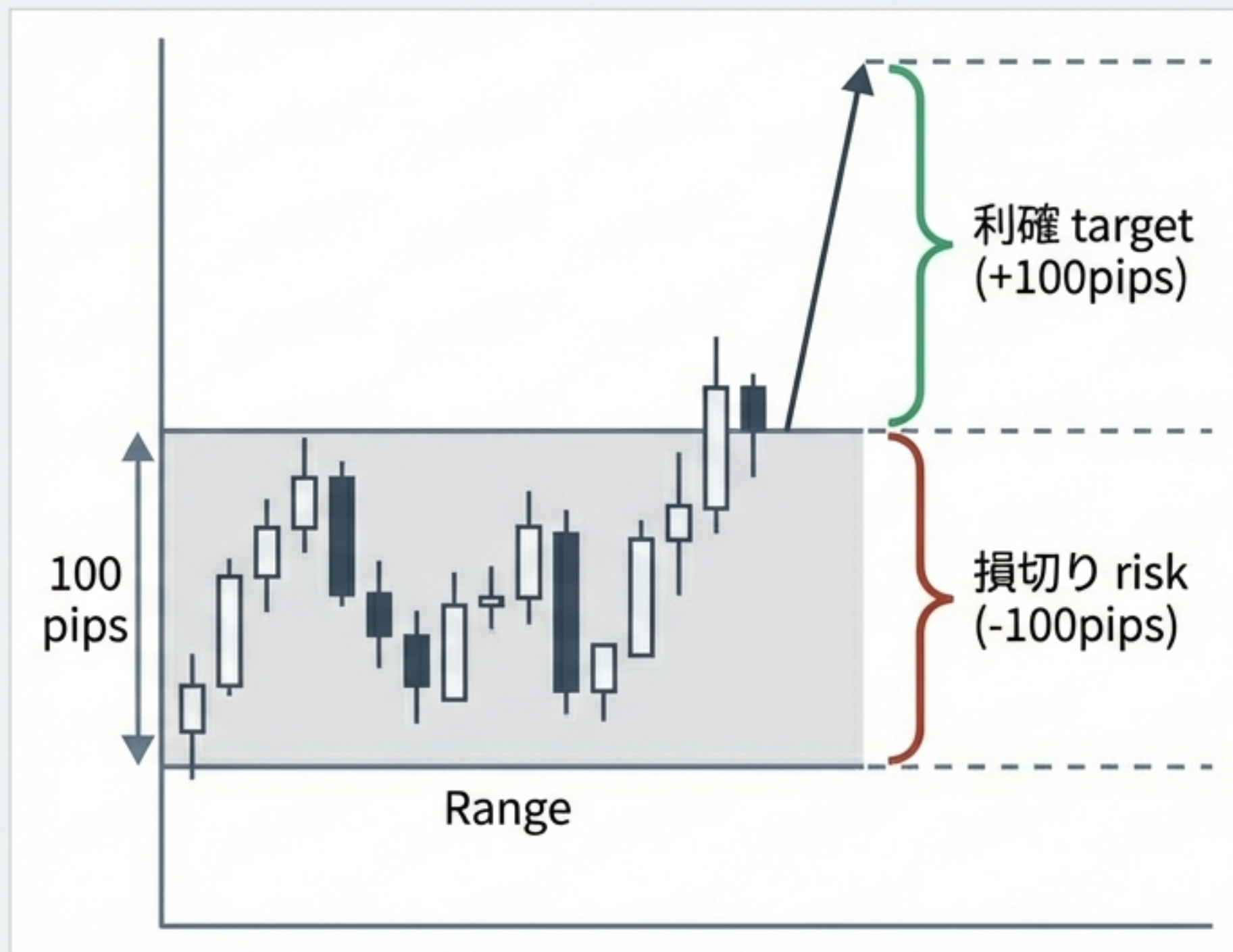
基本戦略:

- ・ エントリー: レンジ上限ブレイク
- ・ 損切り (SL): レンジ下限
- ・ 利確 (TP): レンジ幅分上

数値設定:

- ・ レンジ幅 = 100pips
- ・ リスク = 100pips
- ・ リワード = 100pips

設計リスクリワード = 1:1



勝率50% × 設計RR 1:1 = 利益ゼロ

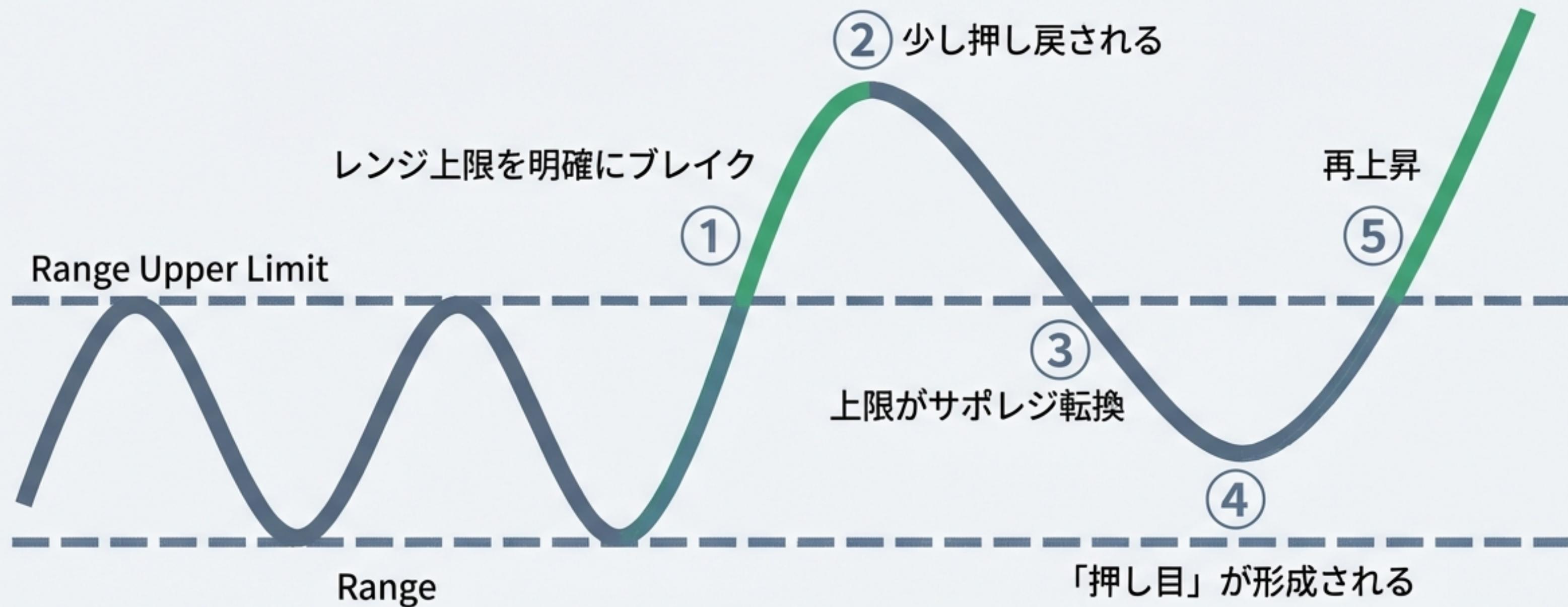


勝ちトレード: +100pips (確率50%)
負けトレード: -100pips (確率50%)

結果: 「プラマイゼロ」 これでは資産は増えない

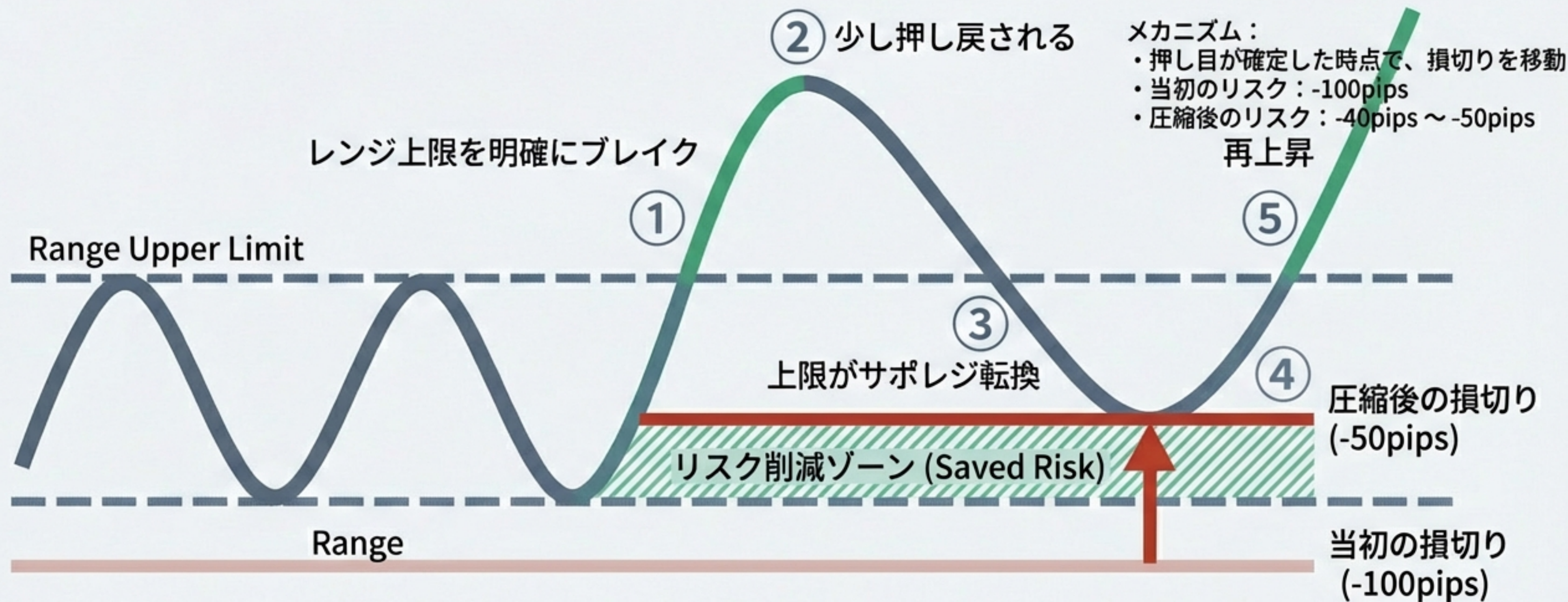
「じゃあレンジブレイクって意味ないじゃん!...でも、ちょっと待って。」

実際のブレイクは「一瞬」ではない



教科書的な「勝つか負けるか」の2択ではない。チャートは動的な波を描く。

損切りの圧縮：隠れた変数进行操作する



スイングローの下にSLを移動することで、負けの額を減らす。

分布モデルのシミュレーション (100回試行)

勝ち: 50回
(+100pips)

30回: フル損切り
(-100pips)

20回: 圧縮損切り
(-50pips)

勝率: 50% (不変)

勝ち: 50回

負け: 50回 (内訳: -100が30回, -50が20回)

計算結果：勝率は同じでも利益が出る

平均利益 (Avg Profit) = +100pips

平均損失 (Avg Loss) =
 $(30 \times -100 + 20 \times -50) \div 50$



-80pips

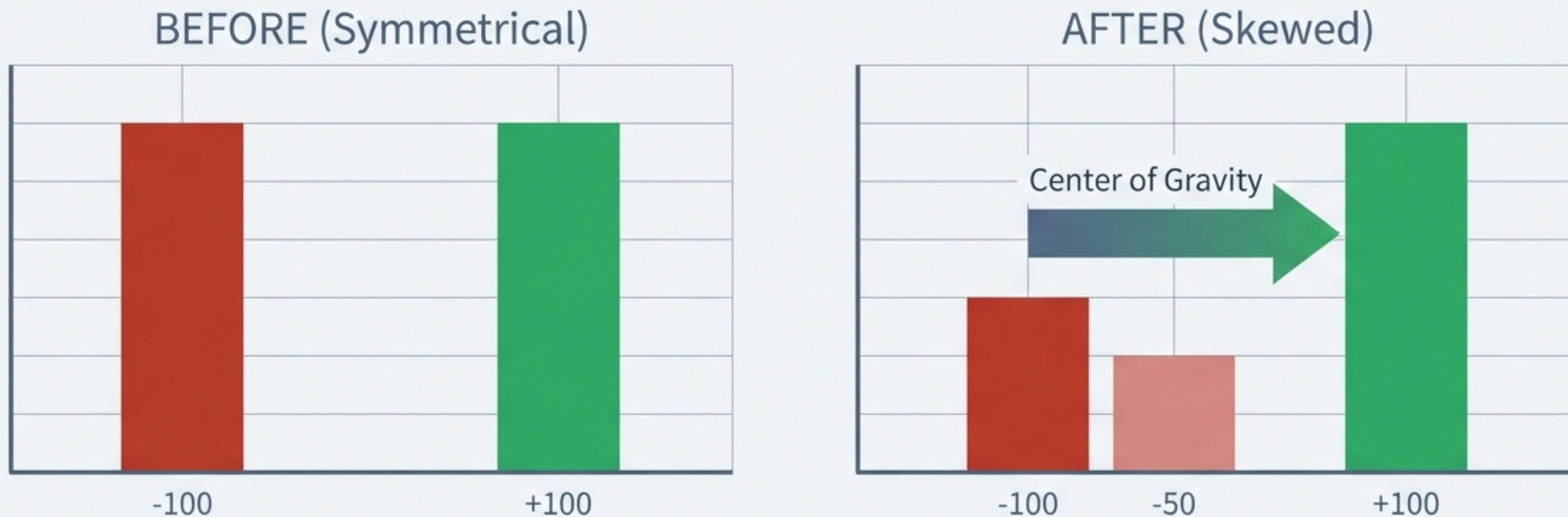
実現リスクリワード =

$100 \div 80 =$

1.25 : 1

設計は1:1だが、結果は1.25:1に改善。

「勝率」ではなく「分布の形」を変える



- 勝率は上げていない
- 利益目標も伸ばしていない
- 負けの分布の形だけが変わった

「-50pipsで済む負け」という中間層が、期待値をプラスに押し上げる。

どちらのゲームに参加しますか？

GAME A



表: +100円

裏: -100円

結果: 増えない

GAME B



表: +100円

裏: 20%の確率で-50円で済む

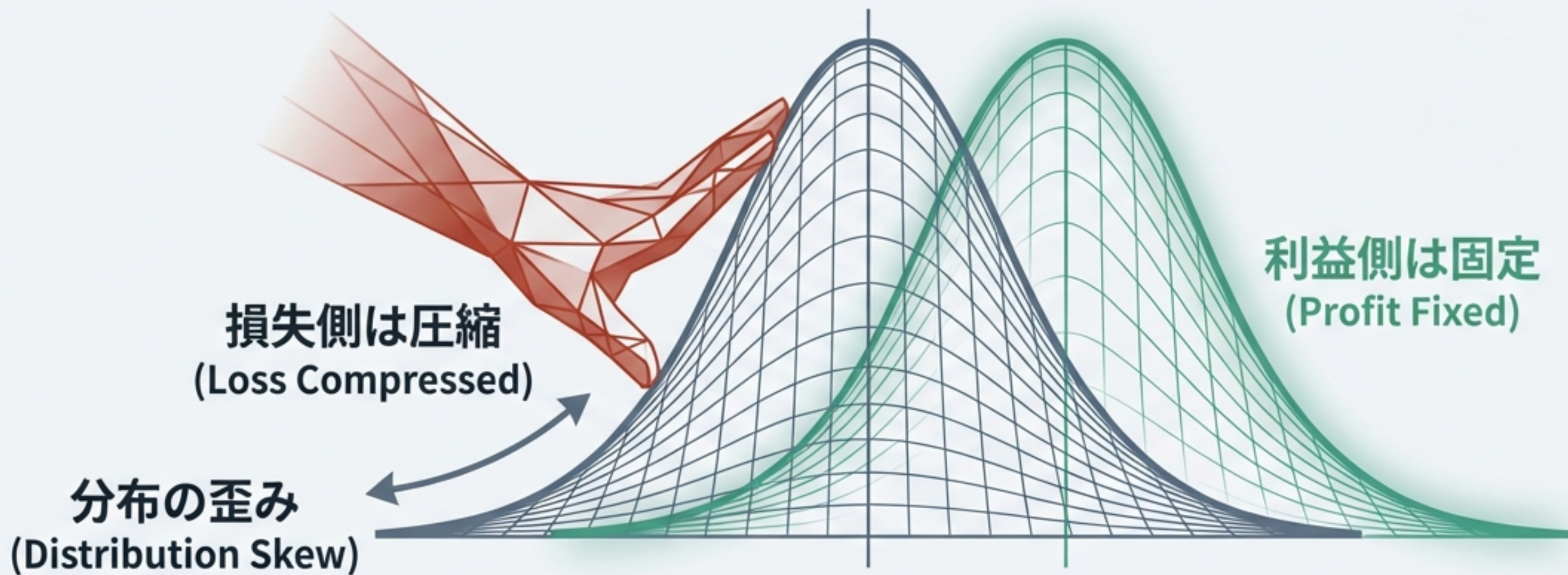
結果: 徐々に増える

後出しジャンケンではない。「再現性」の確保



損切り移動は「気分」ではなく「ルール」で行う。

確率論の正体：損益分布をどう歪ませるか



「そのわずかな歪みが優位性になる」

無理に勝率を上げるより、負けの質を改善しよう

- ✓ 勝率50%でも理論上はトントン
- ✓ 負けを圧縮して分布を歪ませる
- ✓ 実現リスクリワードが改善する
- ✓ 確率が味方になる

「損失の種類」を意識し始めたとき、
トータルの成績は変わり始める。

