

5連敗は「異常」ではない。確率が教えるFXの真実

メンタルを崩壊させる「ドローダウン」を乗り越えるための数学的アプローチ

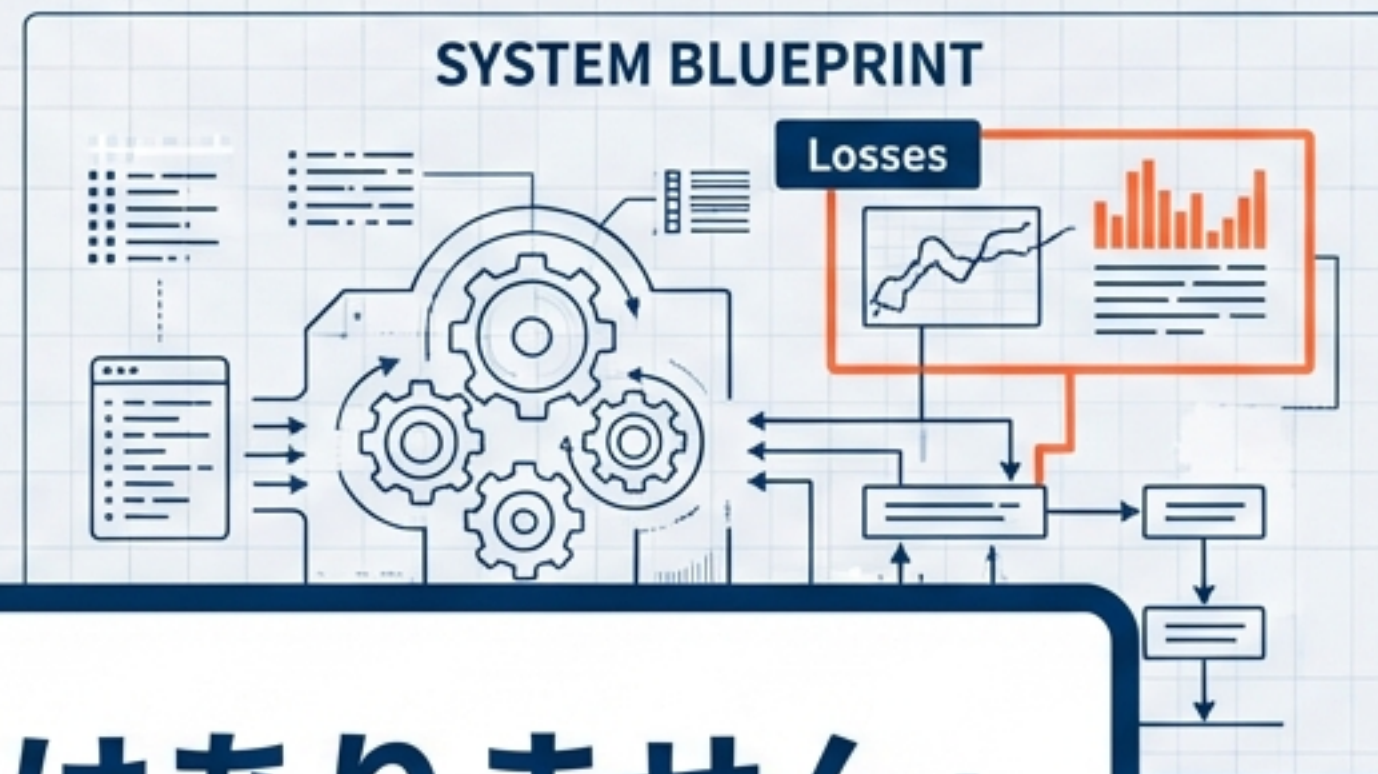


$$P = (1 - R)^k$$

「手法が壊れた？」 その不安への回答

この悩みに対する答えは明確です。

「5連敗しました……もうこの手法はダメなんではないですか？」



「それは手法の問題ではありません」

ERROR: None.

STATUS: Normal Operation.

NOTE: 連敗は「異常」ではなく「仕様」です。

感情を排除し、計算式で現実を見る

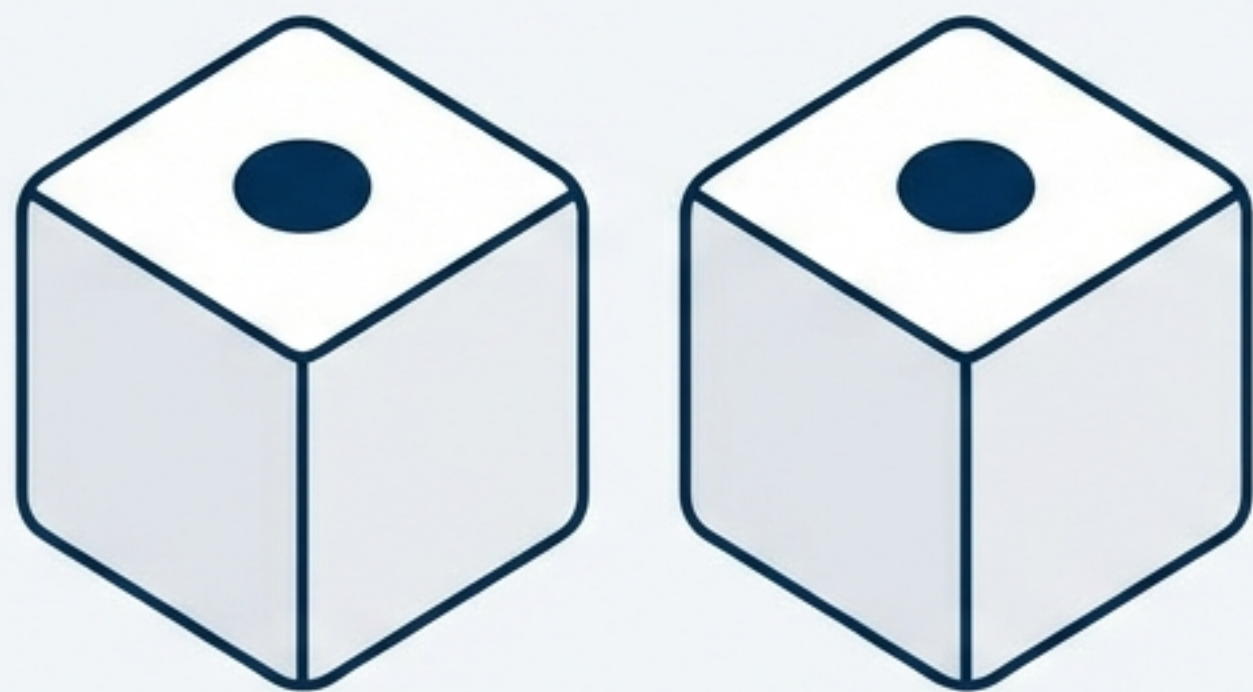
$$k\text{連敗する確率} = (1 - \text{勝率})^k$$

負ける確率

連敗数
(k 回掛け算)

つまり、負ける確率を連続して引く確率は、
単純な計算で導き出せます。

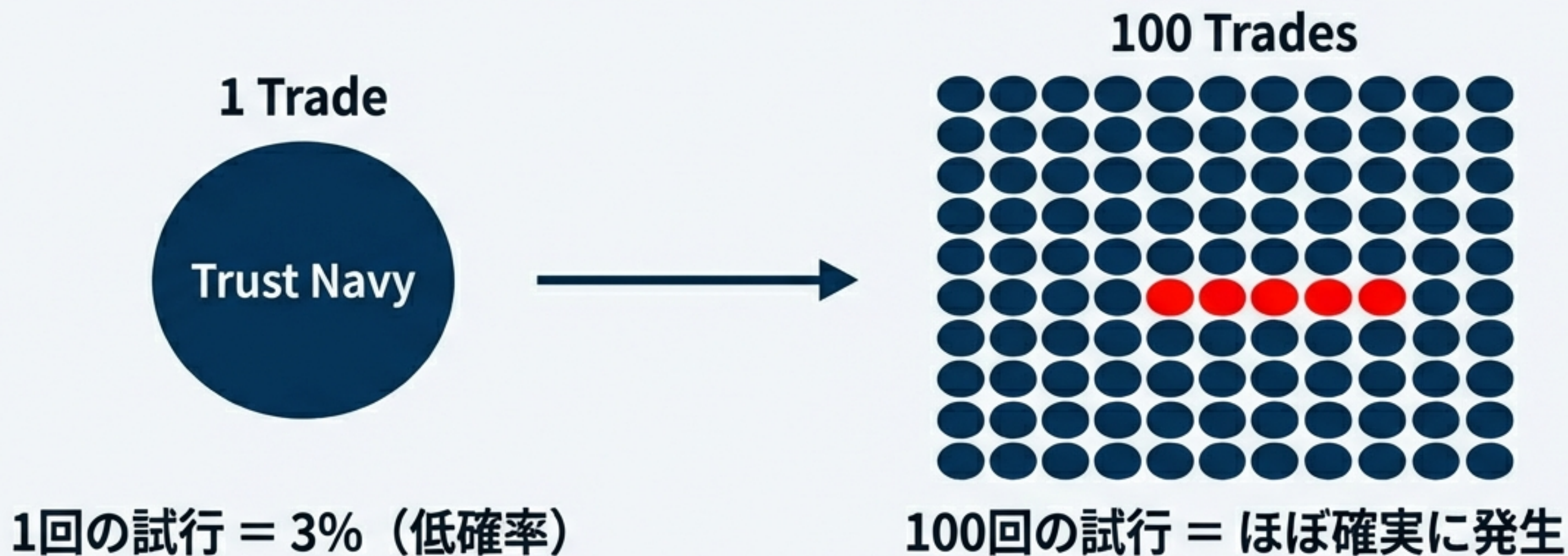
ケースA：勝率50%（コイン投げと同じ確率）



サイコロで「1」が2回連続で出るのと同程度の確率。

連敗数	確率
3連敗	12.5%
4連敗	6.25%
5連敗	3.13%

「3%」の数字に騙されてはいけない



「1回だけの試行で5連敗する確率」は3%ですが、「100回トレードする中でどこかで5連敗する確率」は別物です。

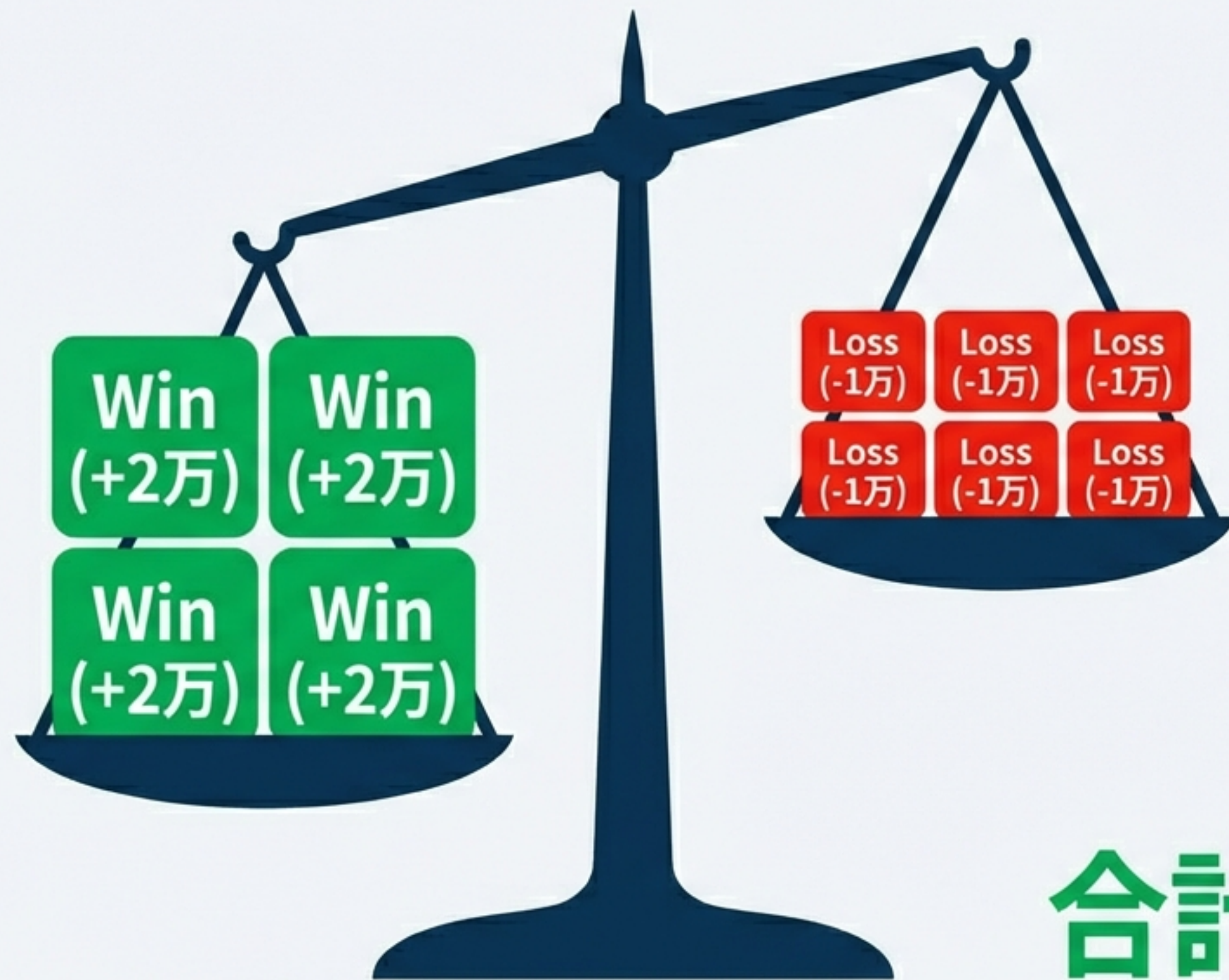
勝率50%でも、100回トレードすれば5連敗は「普通」に発生します。

ケースB：勝率40%（現実的なトレーダーの数字）

連敗数	確率
3連敗	21.6%
4連敗	12.96%
5連敗	7.78% (約8%)

- ✓ 約10セットに1回は5連敗が発生します。
- ✓ 勝率40%の手法を使っているなら、5連敗は「想定内」の出来事。
- ✓ 「あ、確率通りに来たな」と受け止めるのが正解です。

なぜ、勝率40%でも利益が残るのか？



RR 1:2 の場合

10戦して4勝6敗（勝率40%）

勝ち：4回 × 2万円 = +8万円

負け：6回 × 1万円 = -6万円

合計：+2万円の利益

ケースC：勝率30%（それでも戦える）

5連敗の確率：約17%

3回に1回は5連敗が発生します。もはや日常茶飯事です。

RR 1:3 の場合

$$\left[\text{勝ち3回}(+9\text{万}) \right] - \left[\text{負け7回}(-7\text{万}) \right] = \left[+2\text{万円} \right]$$

連敗が多いことと、負け戦略であることはイコールではありません。

あなたを退場させる「3つの致命的な行動」

連敗そのものが問題ではありません。問題は、連敗時にとってしまう行動です。



**1. 連敗を
想定していない**

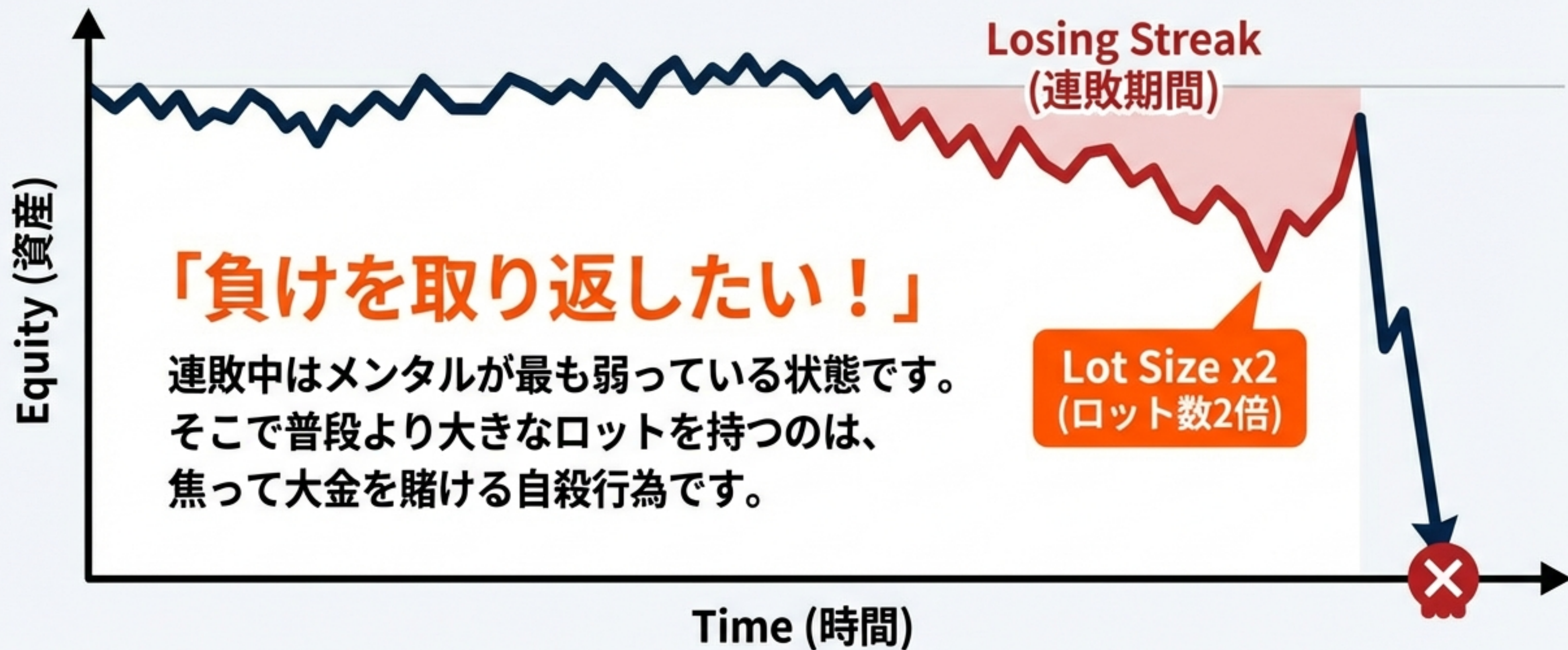


**2. 連敗中に
ロットを上げる**



**3. 連敗中に
ルールを変える**

最大の地雷：感情的なロット操作



“「3連敗してムキになり、ロットを2倍にしてさらに連敗する…これが退場への王道パターンです。」

生存率を分ける「リスク%」の魔法

5連敗後の残資金（初期資産100万円）



同じ「5連敗」という事実でも、リスク設定次第でそれは「かすり傷」にも「致命傷」にもなります。

鋼のメンタルを作る「4つの設計図」

1. 勝率を把握する



自分の勝率は40%? 50%? ざっくりでOK。

2. リスクリワード(RR)を固定する



1:2 または 1:3 に固定する。

3. リスク%を設定する



1トレードあたり資金の1-2%を推奨。

4. 想定最大連敗を計算する



勝率40%なら8連敗は「想定内」。

結論：連敗は「避ける」ものではなく「飼いならす」もの

-  **勝率50%でも5連敗は普通にある。**
-  **勝率40%なら5連敗は想定の範囲内。**
-  **勝率30%なら5連敗は日常茶飯事。**

**恐怖の原因は「何が起きているか分からないこと」
です。確率を知れば、恐怖は消えます。**

焦らず、確率を味方につけて前進しよう

手法を変えたいとき、ロットを上げたいとき、
まずこの確率の数字を思い出してください。

「あ、これは確率的に普通のことだ」と気づくだけで、
トレードは劇的に変わります。

コツコツと経験を積み重ねていきましょう。
あなたのトレードがうまくいくことを応援しています。

