

なぜ、勝ち始めた途端に崩れるのか？

中級者が陥る「原因不明の不調」の正体を解明する

Based on the analytics of trader psychology and probability

ある日突然訪れる「謎の崩壊」



検証通りにトレードして、利益も出て、自信もついた。それなのに突然、連敗が始まり資金が減っていく。手法は変えていないはずなのに、なぜ結果だけが変わるのか。

実は、急に壊れたわけじゃない

勝っている期間 (Winning Phase)



負け始めた期間 (Losing Phase)



原因

勝ち始めた瞬間から、
崩壊はもう始まってる。

利益が出た瞬間に生じる「見えない変化」が、後の崩壊を引き起こしている。

見えない変化①：検証条件からのズレ

勝てていた頃 (When Winning)

慎重・待つ姿勢

「ここは微妙だから
見送ろう」



Strict Adherence to Rules

現在 (Now)

自信・過信

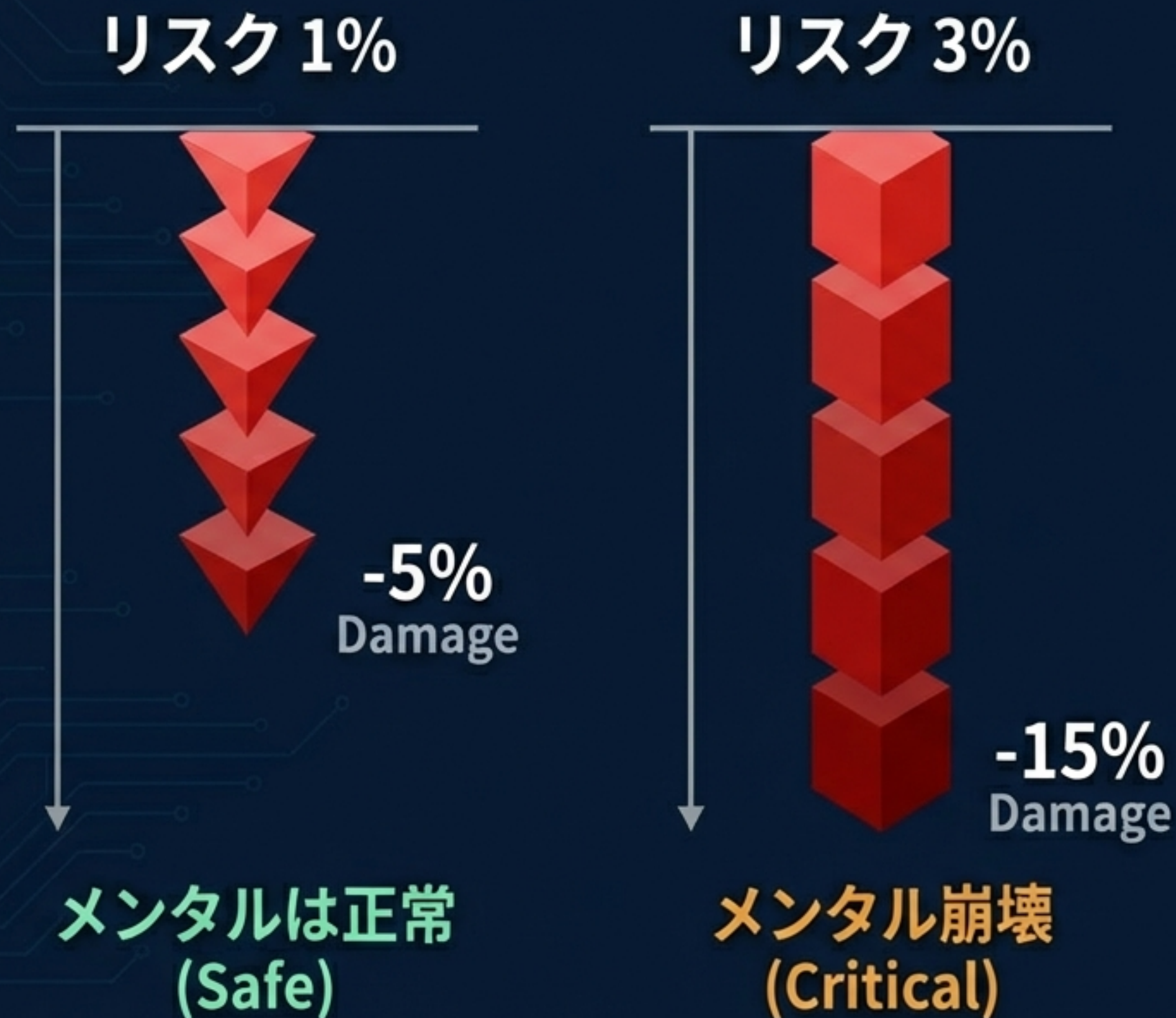
「ここもいけそう！」
「今日調子いいし、
もう一発！」



Unnoticed Strategy Drift

成功体験が規律を緩ませ、知らぬ間に「別の手法」をトレードしてしまっている。

見えない変化②：ロット増加と分散の暴走



「ロットを上げてても連敗
確率は変わらない」

しかし、資金の振れ幅（分
散）は劇的に大きくなる。

-15%のドローダウンが起き
ると、人は平常心でルール
を守れなくなる。

見えない変化③：成功体験バイアス



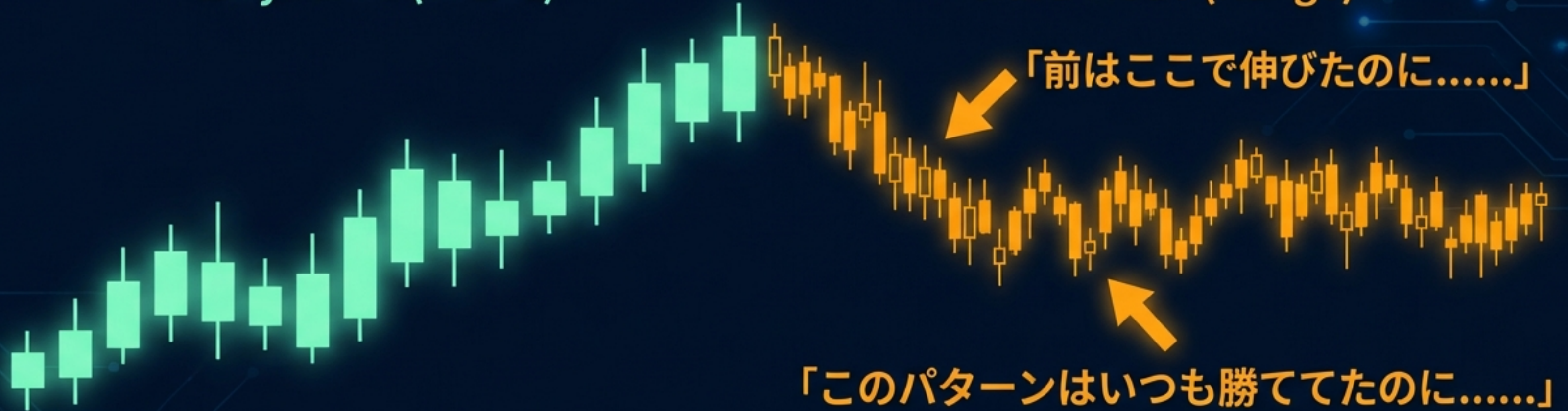
「相場が読めるようになった」のではなく、
「たまたま相場が手法にハマっていた」だけ。

環境が変わったのに「自分は正しい」と思い込むことで、傷口が広がり続ける。

見えない変化④：レジーム変化への鈍感さ

Easy Mode (Trend)

Hard Mode (Range)



相場は生き物であり、ボラティリティや流動性は常に変化する。環境が変わったのに同じアクションを繰り返すのは、「運が悪い」のではなく「適応できていない」だけ。

見えない変化⑤：実現RRの静かな悪化

検証上のプラン (The Plan)

+2.0R

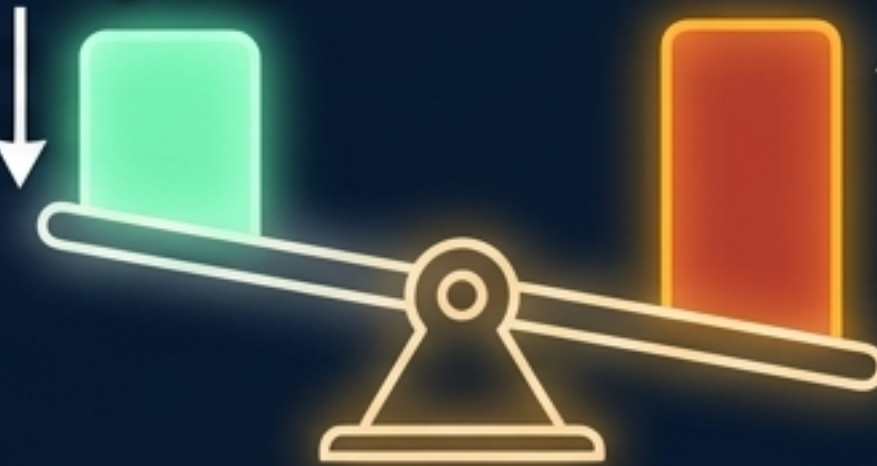


期待値プラス (Positive Edge)

実戦のリアル (The Reality)

+0.9R

早期利確
(Fear)



滑り・遅れ
(Slippage/
Hesitation)

期待値マイナス (Negative Edge)

「含み益が減るのが怖い」→ 早利確 (+0.9R)

「損切りしたくない」→ 滑り・遅れ (-1.1R)

これを繰り返すと、勝率が変わらなくても資金は静かに減り続ける。

「不調」なんて存在しない

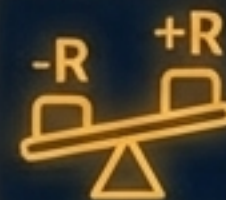
~~不調~~



ロット数
(Lot Size)



相場環境
(Environment)

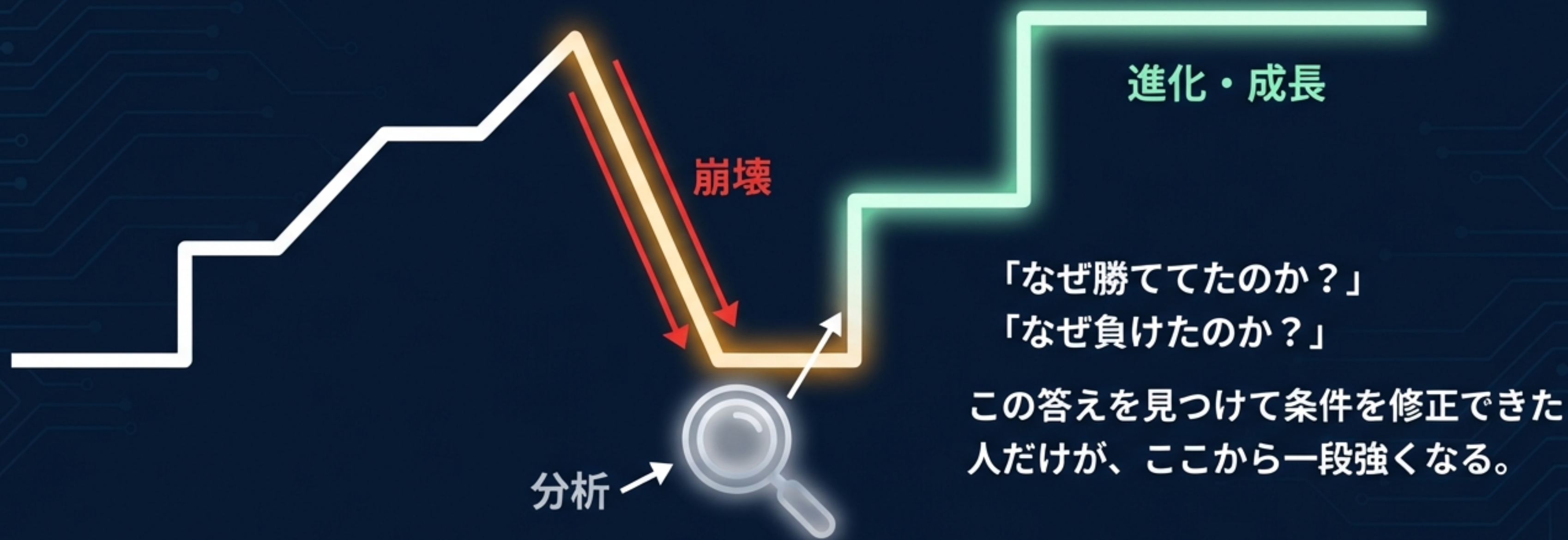


リスクリワード
(Risk:Reward)

相場に「気分」や「調子」はない。あるのは「条件」だけ。

「最近調子悪くてさ～」と言うのをやめよう。
負けているなら、上記の条件のどれかがズレているだけ。

崩壊は「進化」への入り口



条件を元に戻していける人は、本当の実力がつく。

崩壊を防ぐ具体策：資金管理



① ロット変更は超慎重に

- 感情や「調子」でロットを変えない。「3ヶ月連続プラスなら検討する」など、期間による厳格なルールを設ける。



② 実現RRを毎回記録する

- 「TPまでの距離」ではなく「実際に取れたpips」を記録せよ。
- 検証データと実戦データが乖離し始めたら、即座にトレードを停止して修正する。

崩壊を防ぐ具体策：環境認識



③ 相場環境を定期的に確認する

- 週に一度、「今はトレンドか？レンジか？」を確認する。
- 環境が変われば、手法の期待値も変わることを受け入れる。



④ 評価は月単位です

- 数回の負けや、1週間の結果で「崩れた」と判断しない。
- 短期のノイズに反応せず、月単位のサンプル数で自分の行動を評価する。

まとめ：安定への道筋

5つの崩壊原因 (The 5 Causes)

1. 検証条件からのズレ (Strategy Drift)
2. ロット増加と分散の拡大 (Variance Trap)
3. 成功体験バイアス (Success Bias)
4. レジーム変化への鈍感さ (Regime Blindness)
5. 実現RRの悪化 (RR Decay)

4つの解決策 (The 4 Solutions)

1. ロット変更ルール of 厳格化
2. 実現RRの記録と監視
3. 定期的な環境認識
4. 月単位での評価

「運が悪い」のではなく「条件がズレた」だけ。冷静に修正しよう。

Financial Noir Diagnostic

勝てるようになることより、
崩れないことの方がずっと難しい。

焦らず、呼吸をして、条件を確認しよう。
相場は逃げない。いつでも立て直せる。