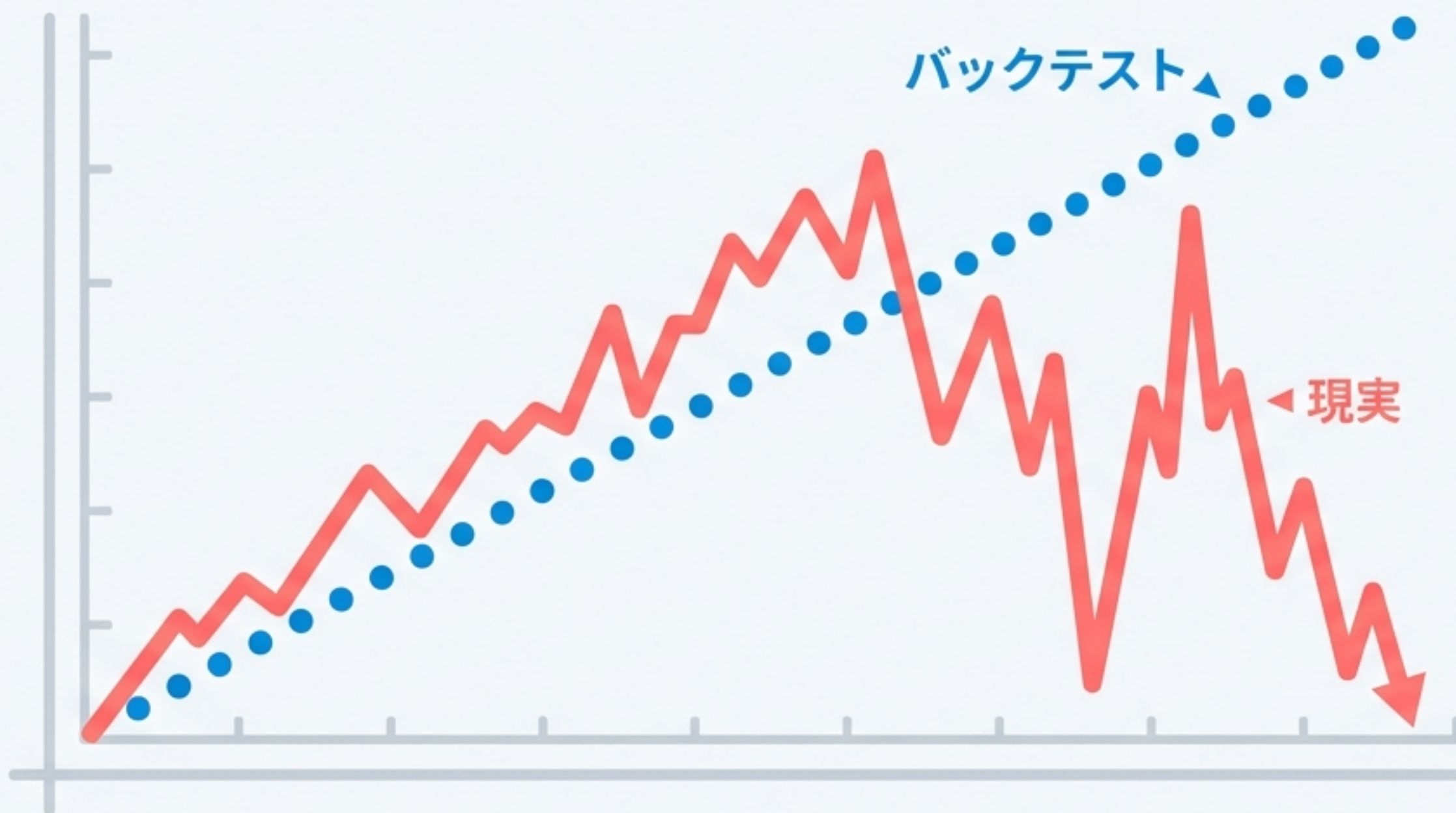


期待値プラスなのに勝てない？

統計と現実の「ズレ」を埋める、トレード生存戦略



こんぬつわ！
鼻ツッぺです♪



トレーダーがぶつかる「あの壁」

- ✓ バックテストでは右肩上がり
- ✓ 検証ノートでも利益が出ている
- ✓ なのに実際にトレードすると負ける

「検証が間違っていたのか？」

「相場が変わったのか？」

「自分には向いていないのか？」

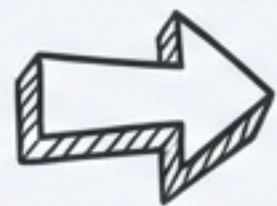
その理由はシンプルです。
**統計の世界と、
現実のトレードは
動き方が違う。**

「期待値プラス＝必ず勝てる」の誤解

期待値プラスとは：「長期的に積み重ねれば利益が残る可能性が高い」こと。

注意：「短期での勝利を保証するものではない」

- 勝率 40%
- リスクリワード 1:2



10回のトレード結果

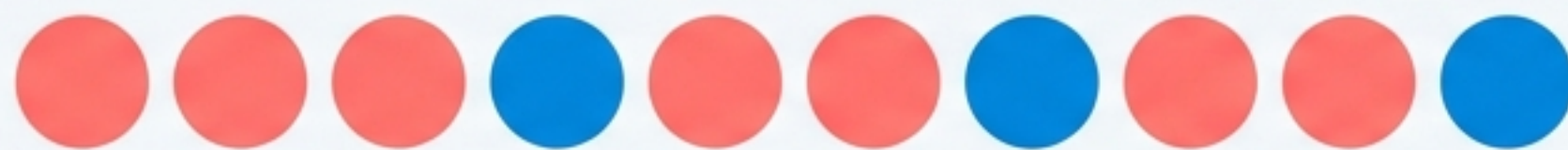
$$4\text{勝 } (+8R) - 6\text{敗 } (-6R) = \text{合計 } +2R$$

理論上はプラス。しかし現実には均等に配分されません。

避けられない「ブレ」の正体



コイン投げ（確率50%）



10回投げれば、表が7回出ることもある。

これは「**分散**」と呼ばれる統計的な現象です。
不正ではなく、正常な確率の振る舞いです。

むしろ連敗が来ないほうが不自然なのです。

勝率40%の現実：正常な連敗

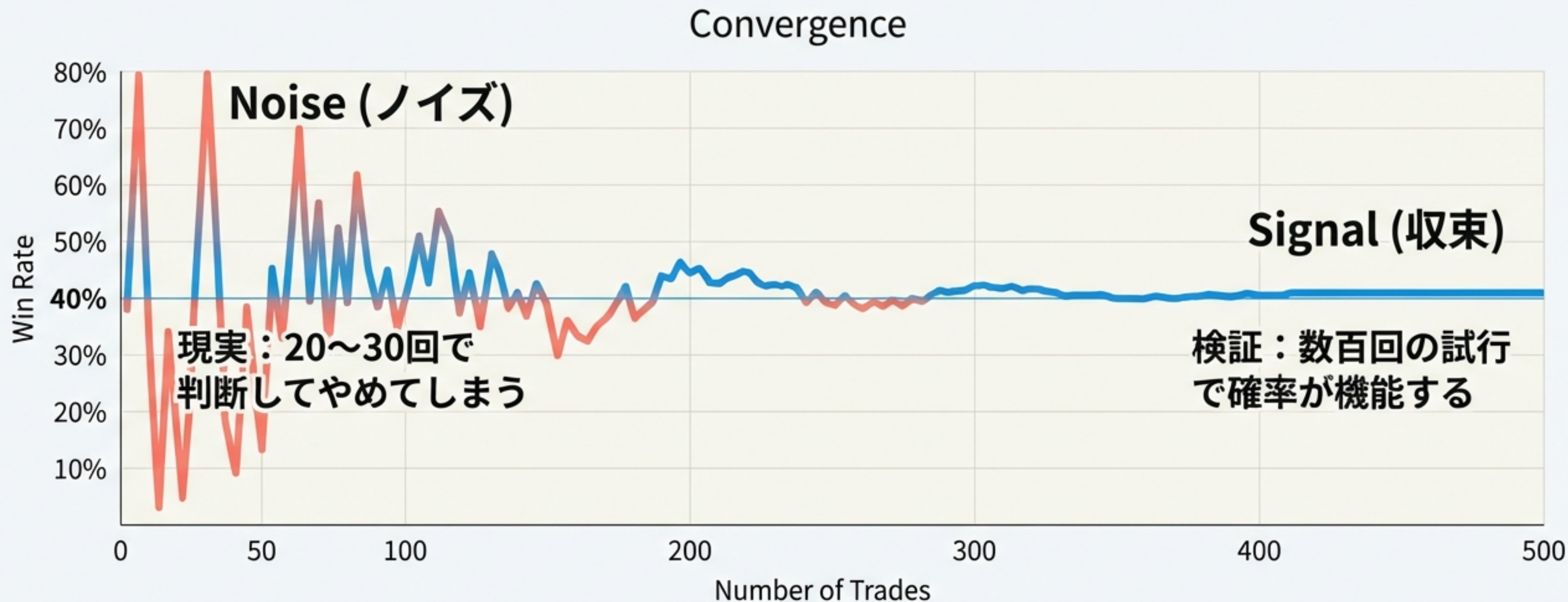
ここで『この手法は壊れている』と錯覚する。



5連敗、6連敗、8連敗...

これらは全て数学的に『正常な確率の範囲内』です。

サンプル数が圧倒的に足りない



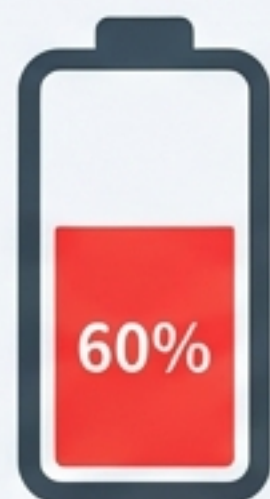
“

「手法が悪いではありません。試行回数が足りていないだけです。」

本当の敵は「ロット破綻」

シナリオA：リスク 5%

5連敗 → 残金 77% (-23%)
10連敗 → 残金 60% (-40%)



メンタル崩壊。
恐怖でトレード
続行不可能。

シナリオB：リスク 1%

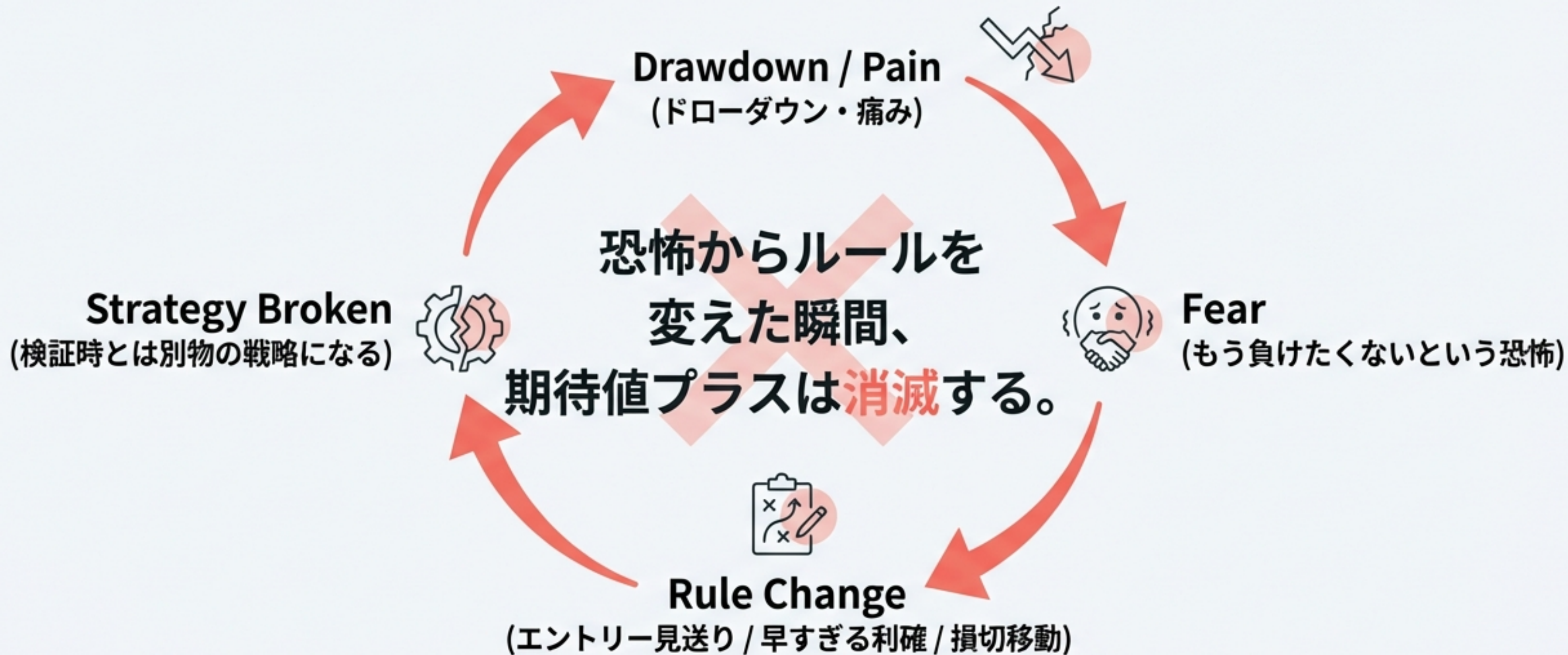
10連敗 → 残金 90% (-10%)



生存。同じ条件
でトレードを継
続できる。

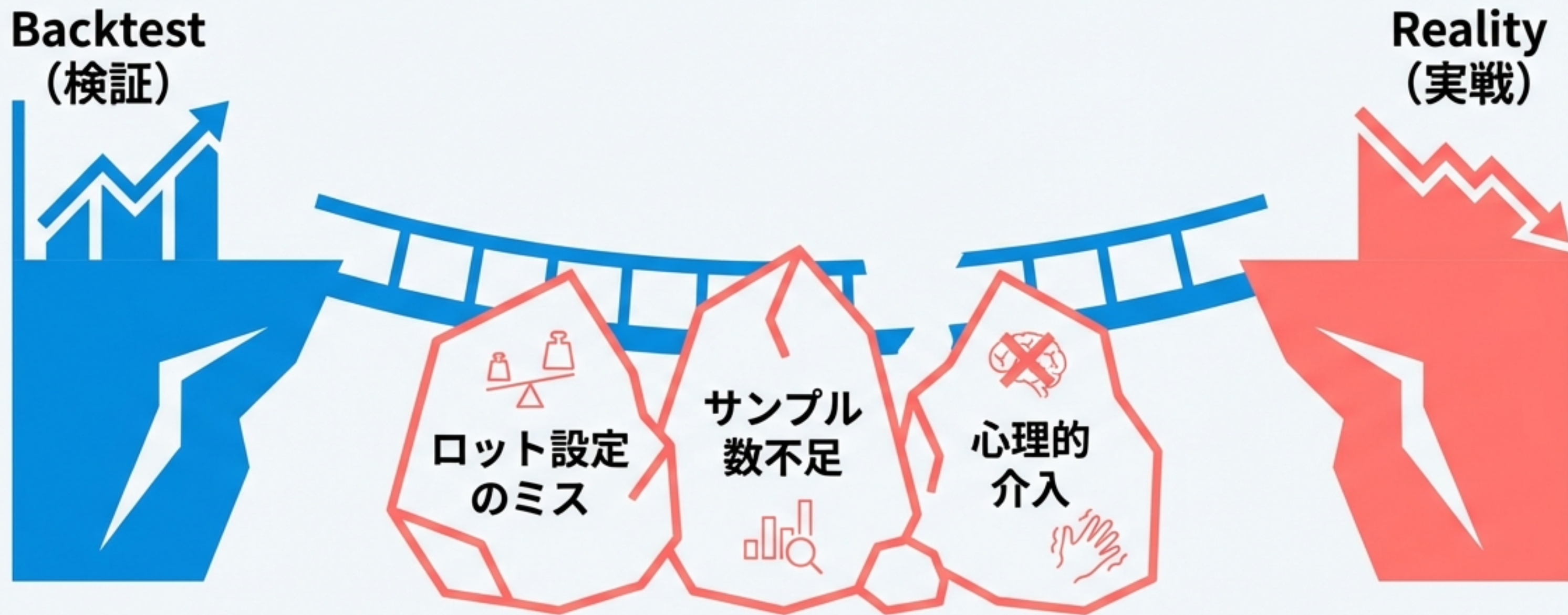
ハイレバレッジは、確率が収束する時間を奪います。

心理が期待値を「壊す」メカニズム



「心理的な負荷が規律を乱し、本来得られるはずの利益を遠ざけるのです。」

なぜ検証通りにいかないのか（まとめ）



検証が嘘をついてるんじゃないくて、
実戦側が検証と同じ条件を再現できていないのです。

解決策①：ロットを小さくする



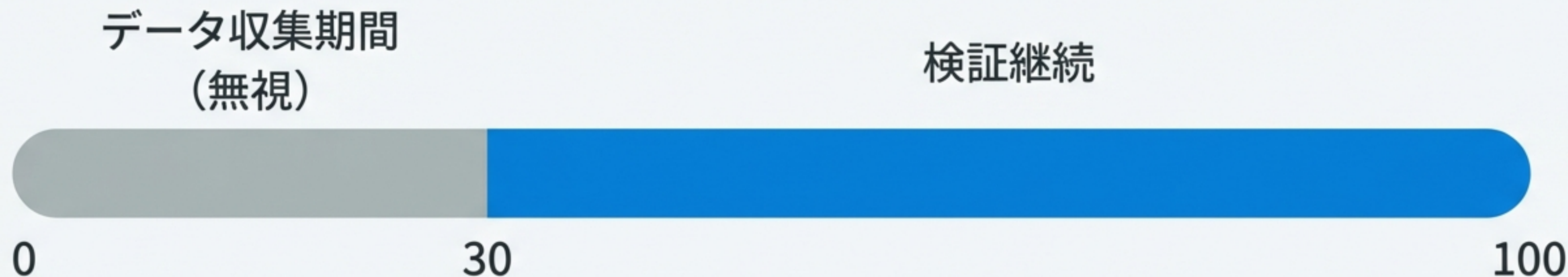
リスクを極小化する

推奨：1トレードあたりリスク 1%

10連敗しても、資金もメンタルも無傷で
いられるサイズに設定してください。

「生き残ること」が、利益を出すための絶対条件です。

解決策②：母数を固定してから評価する



「100回やるまでは評価しない」と決める。

最初の30回の損益結果は単なるノイズです。気にしないでください。

解決策③：途中でルールを変えない

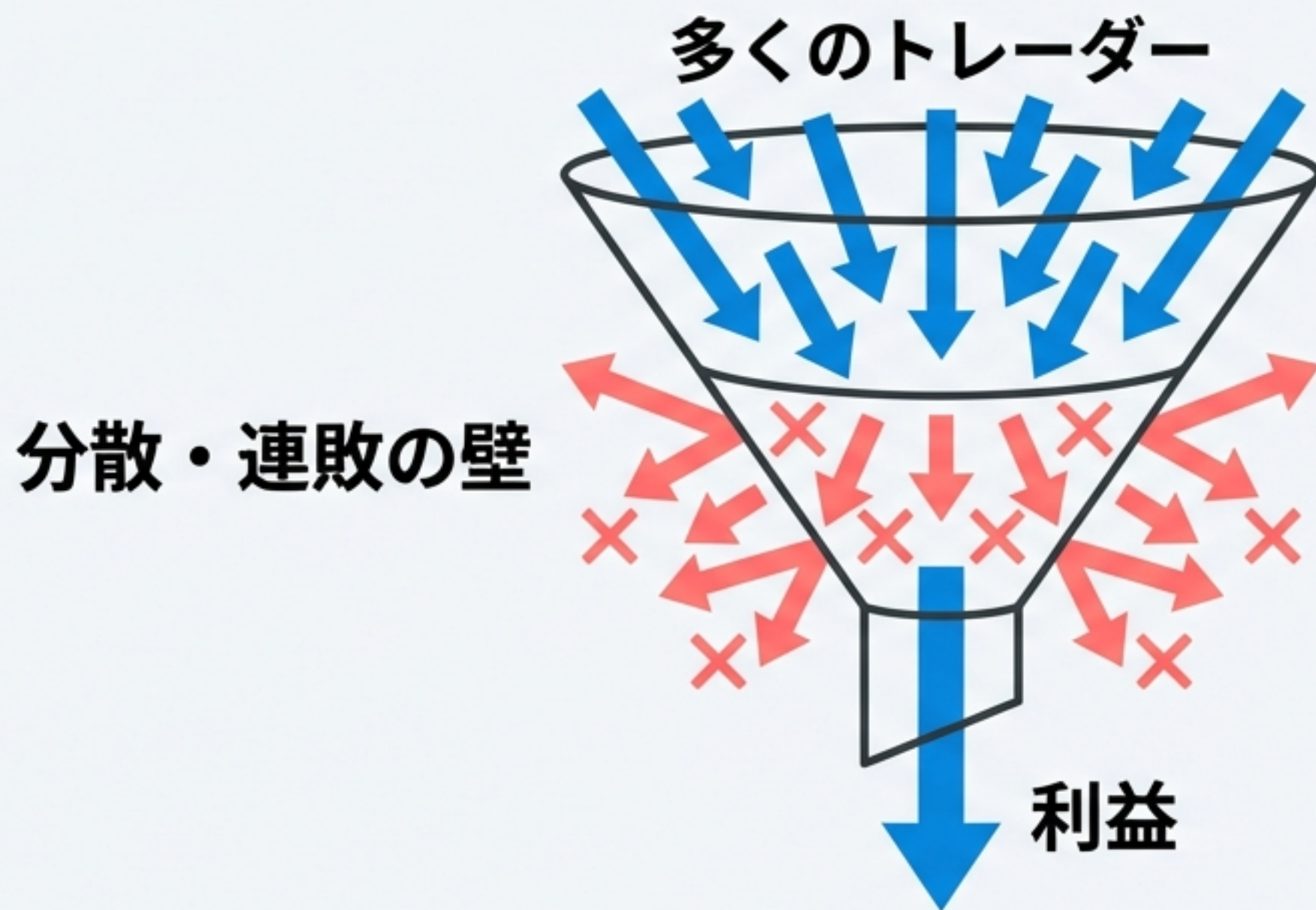


- ⊘ • 損切り位置を動かさない
- ✗ • 利確を早めない
- ✗ • 負けた後にエントリー根拠を変えない

魔法は必要ありません。

「実戦」で「検証」と同じ条件を再現し続けること。それが全てです。

期待値は「耐えた人」にしか働かない



期待値は強力ですが、残酷です。
短期的な痛みを耐え、同じ条件で続けた人だけが、平均値に収束します。

迷った時の自問自答（チェックリスト）

- ☐ 本当に検証と同じ条件で運用できているか？
- ☐ 連敗を許容できるロットで設計できているか？
- ☐ ルールを変えずに100回続けられているか？

この3つがYESなら、ズレは埋まります。

経験を積んで、強くなろう

- 期待値プラス ≠ 短期必勝
- 連敗 = 正常
- 小ロット = 生存戦略

君のトレードがうまくいくこと、
鼻ツッペはいつも応援してるよ♪



検証が間違っているのではない。
現実が統計の条件を満たしていないだけ。