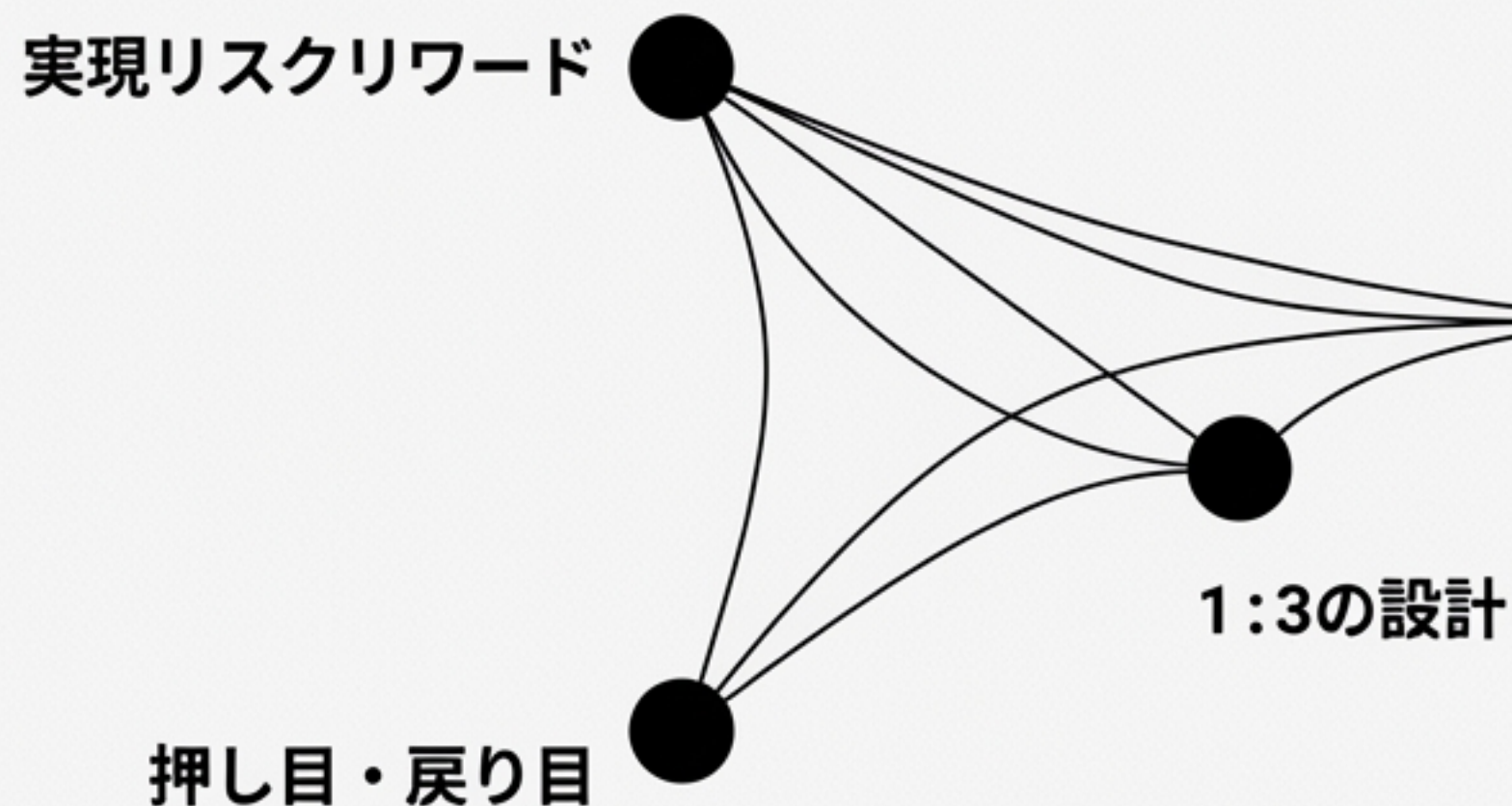


# FXにおける 「確率論」の正体

勝率を捨てて、損益の「形」をデザインする



## 確率論

# 確率論 = 勝率アップの話ではありません

Trader Profile

The Illusion

勝率 70%

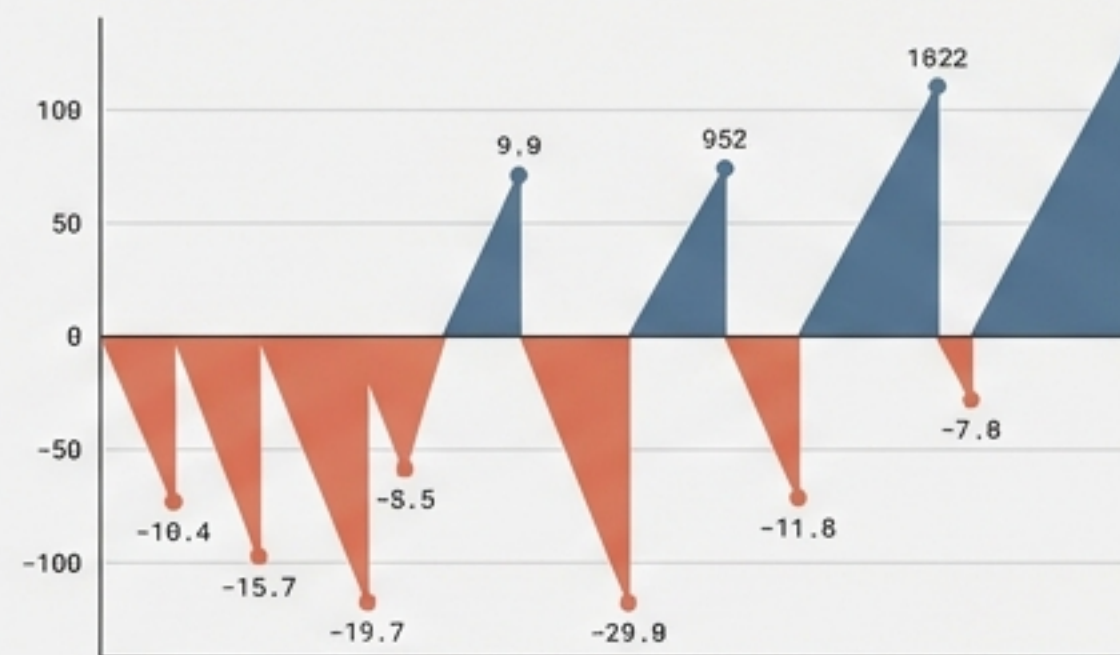


資産減少

Trader Profile

The Reality

勝率 40%



資産増加

重要なのは「何回勝つか」ではない。損益の「分布」がどうなっているかである。

# なぜ「勝率の罠」にハマるのか？



## 心理的メカニズム (Psychological Mechanism):

1. 恐怖 (Fear): 利益がなくなるのが怖くて、すぐに決済してしまう。
2. 希望 (Hope): 「戻ってくるかも」と期待して、損失を放置する。
3. 結果 (Result): 勝率は高いが、期待値はマイナスになる。

# 確率論の核心は「非対称性」にある



## THE GACHA MODEL

Cost: 100 Yen/play

Trials: 10

LOSS: 7 x -100 = **-700円**

WIN: 3 x +300 = **+900円**

---

**NET: +200円**

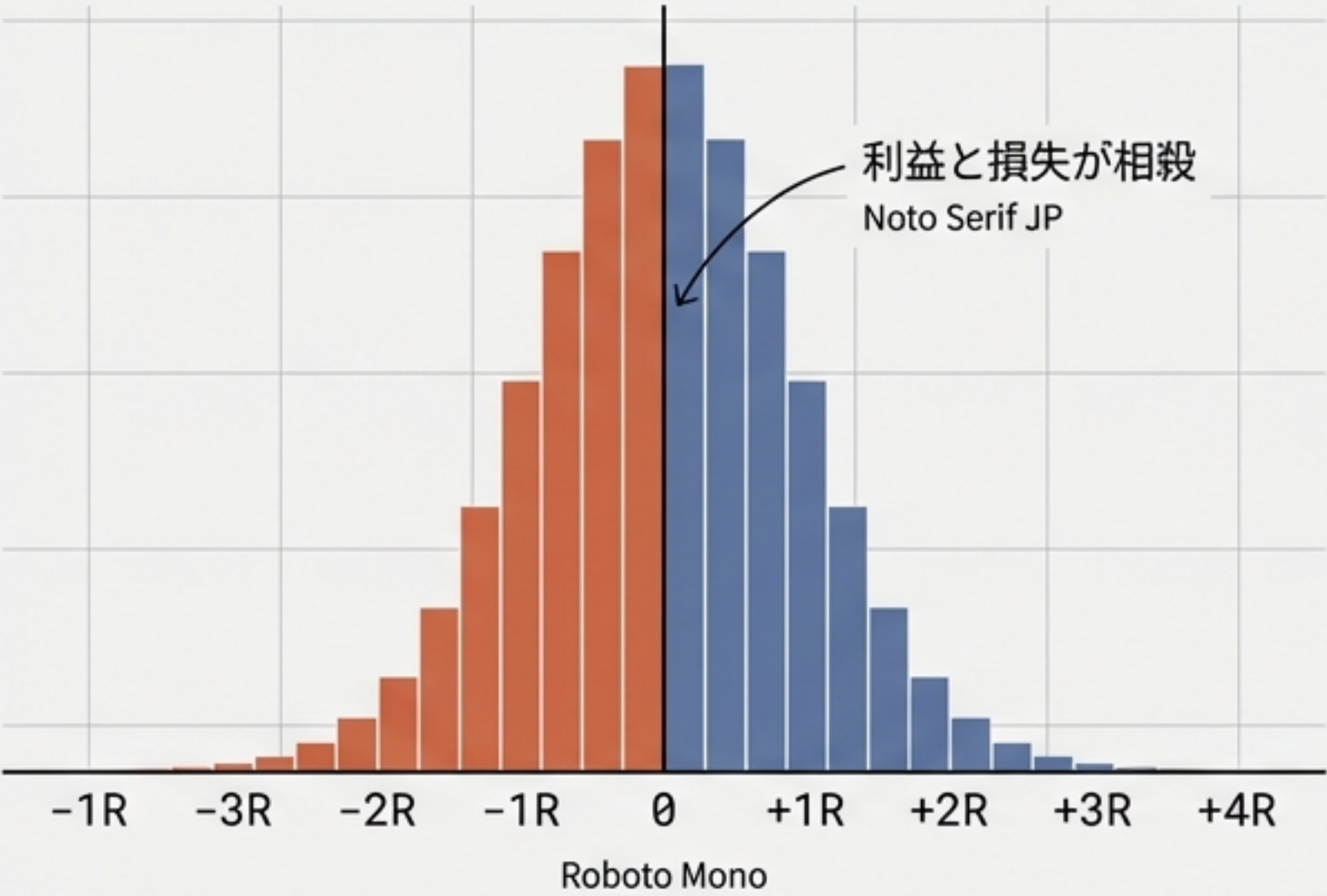
回数（70%）で負けても、金額（非対称性）で勝つ。これが「分布を歪ませる」ということ。

# 損益分布を「右に歪ませる」

Noto Sans JP

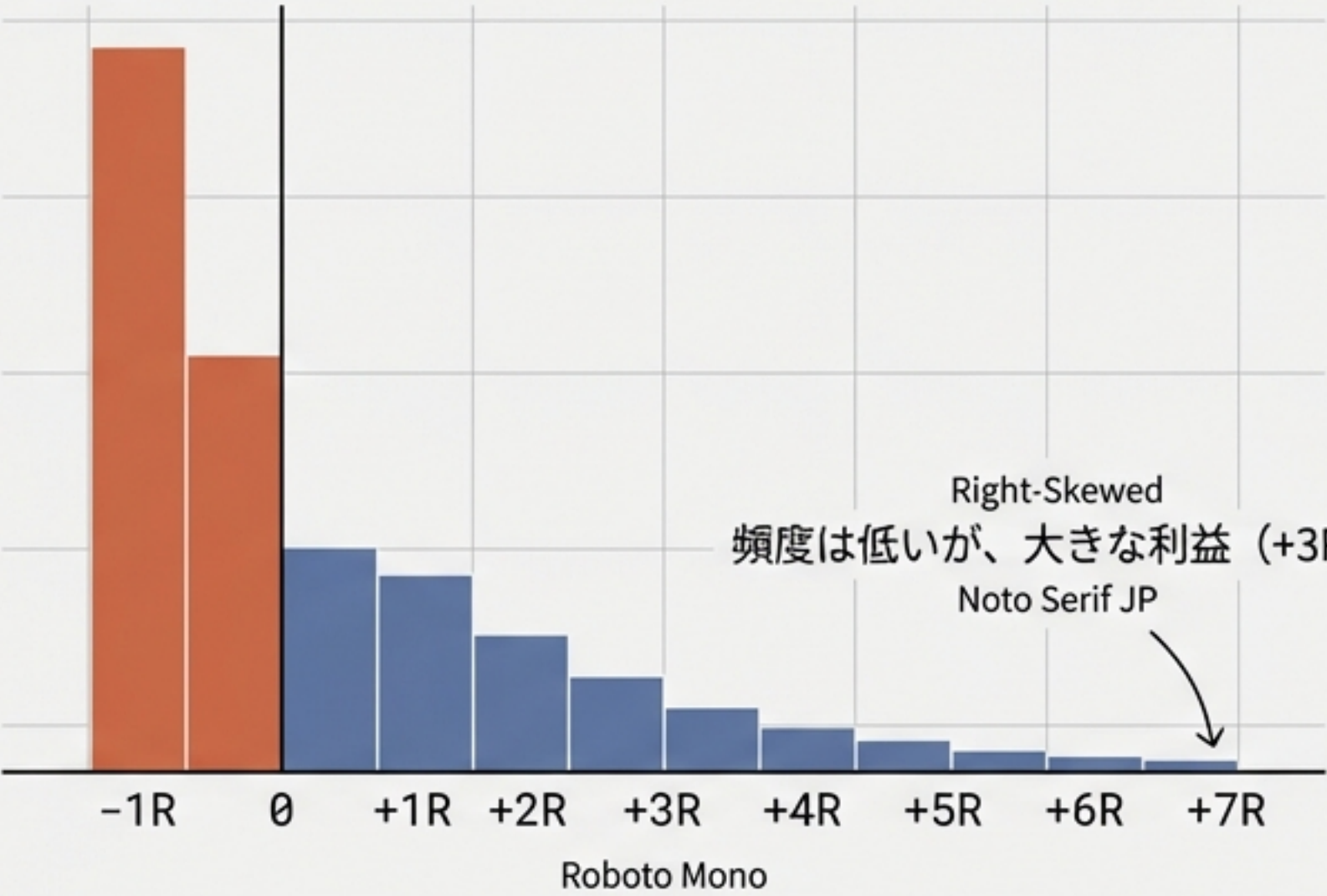
## 負ける分布 / Losing Distribution

Noto Sans JP



## 勝てる分布 / Winning Distribution

Noto Sans JP



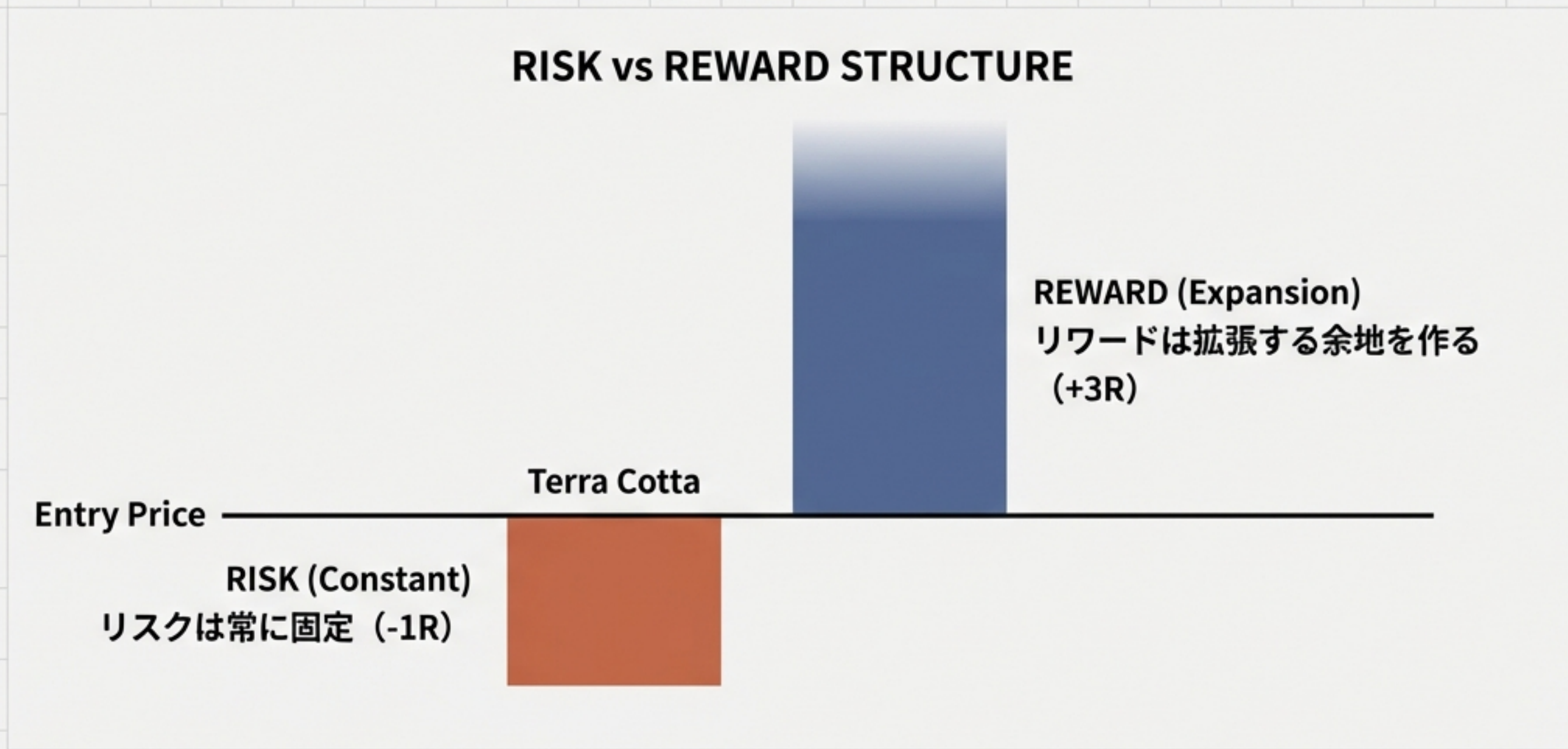
Key Formula

$$(0.35 \times 3R) - (0.65 \times 1R) = +0.4R$$

Roboto Mono

# 1:3は「勝率を捨てる」戦略ではない

リワードの「拡張」こそが目的



「勝率を下げる」のではなく、「分布が歪むためのスペース」を確保する戦略。

# 理論値 vs 実現値

実現リスクリワード (Realized Risk Reward)

机上の理論ではなく、実際のトレードにおける「平均損失」と「平均利益」の比率。

Theory (理論)

Loss: Perfect  $-1.0R$

Profit: Perfect  $+3.0R$

Status: Idealized (理想)

Reality (現実)

Loss:  $-0.6R$ ,  $-0.8R$ ,  $-1.0R$  (Variable)

Profit:  $+1.8R$ ,  $+2.5R$ ,  $+3.2R$  (Variable)

Status: Realized (実現)

完璧に1:3で決済する必要はない。平均値が歪んでいれば勝てる。

# 実際のトレードデータ例

-----  
STRATEGY TARGET: 1 : 3  
-----

AVG LOSS (平均損失): **-0.85 R**  
(Early cuts included)

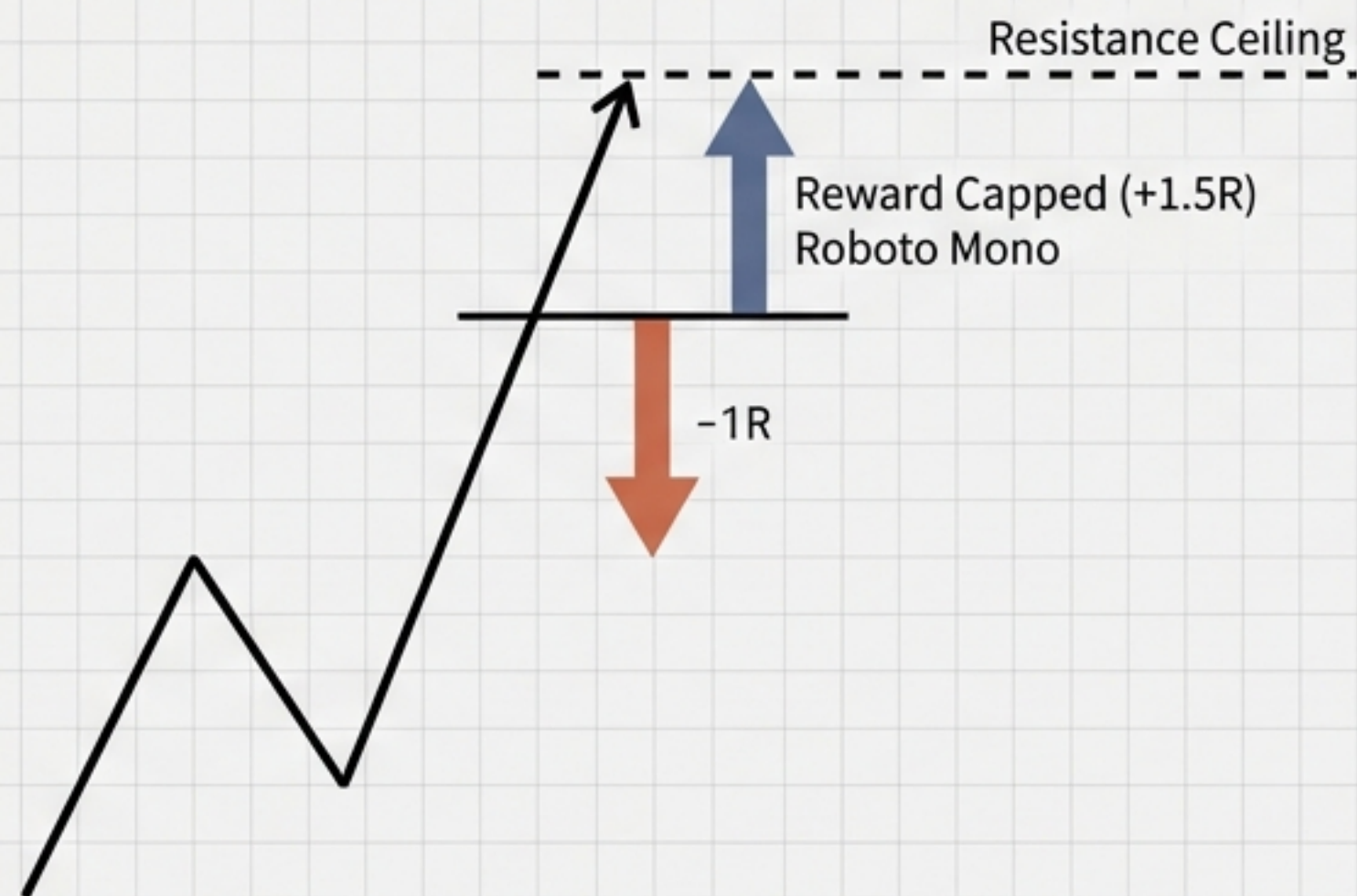
AVG PROFIT (平均利益): **+2.60 R**  
(Partial exits included)

-----  
REALIZED RR: **3.06**  
-----

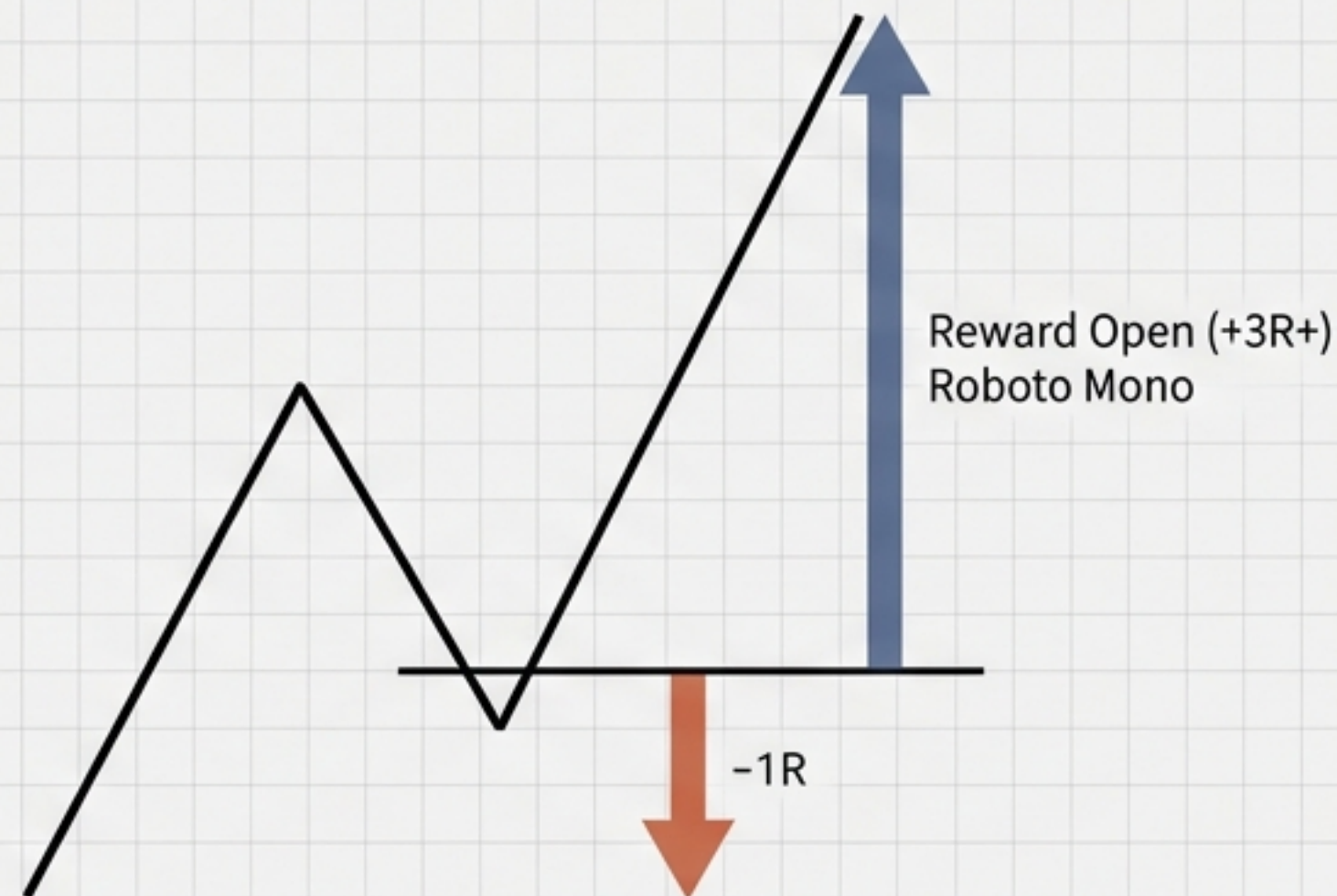
損失を早めに切る管理  
を行うことで、理論値  
(3.0) 以上のパフォーマンス  
を実現できる。

# なぜ「押し目・戻り目」が最強なのか？

## Scenario A: Chasing (飛び乗り)

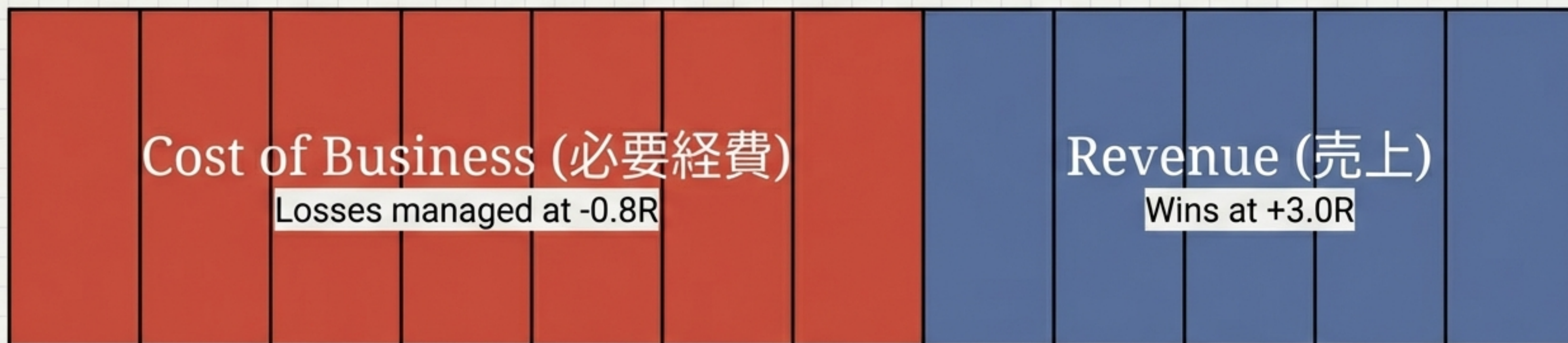


## Scenario B: Dip Buying (押し目)



Key Insight: 押し目買いは「シグナル」ではなく、非対称性を作るための「構造」である。

# 連敗は「必要経費」である



35% win rate means losing 6 or 7 times is normal. Don't panic. Manage the cost.  
(連敗を恐れるな。コストとして管理せよ。)

# 微差が大差を生む：シミュレーション

## Stack A: Theoretical Extreme (Standard Drawdown)

|   |               |
|---|---------------|
| - | (-3,000円 x 6) |
| - | (-3,000円 x 6) |
| - | (-3,000円 x 6) |
| - | (-3,000円 x 6) |
| - | (-3,000円 x 6) |
| - | (-3,000円 x 6) |
| + | (+9,000円 x 1) |

Total: **-9,000円**

## Stack B: Managed Reality (Managed Drawdown)

|   |               |
|---|---------------|
| - | (-2,400円 x 6) |
| - | (-2,400円 x 6) |
| - | (-2,400円 x 6) |
| - | (-2,400円 x 6) |
| - | (-2,400円 x 6) |
| - | (-2,400円 x 6) |
| + | (+8,100円 x 1) |

Total: **-6,300円**

2,700円 Difference  
in just one cycle.

(30回のトレードで、この差が生死を分ける)

# 予言者になるな、管理者になれ

The Prophet (予言者)

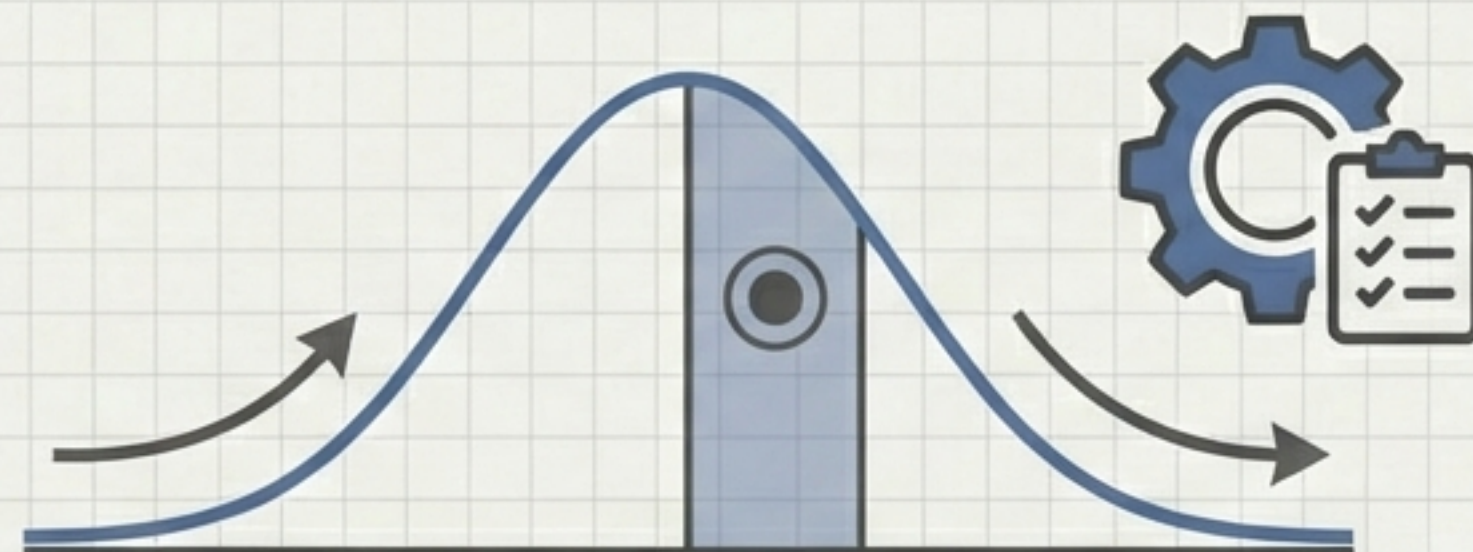
Will it go Up or Down?  
(上がるか下がるか?)



Focus: Prediction (未来予知)  
Emotion: Anxiety (不安)

The Manager (管理者)

Does this fit the distribution?  
(分布のデザインに合うか?)



Focus: Execution (淡々とした執行)  
Emotion: Calm (冷静)

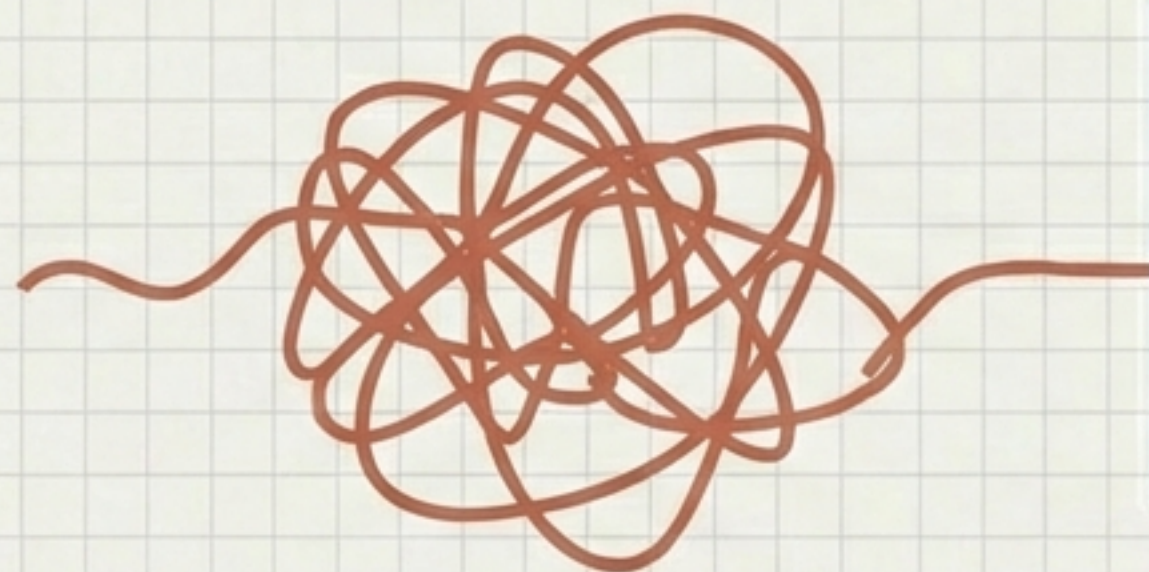
Don't guess the future. Skew the graph.

(未来を当てる必要はない。グラフを歪ませるだけでいい。)

# 確率論は「精神安定剤」になる

## Before

I lost... I made a mistake.  
→ Self-doubt



Probability Theory  
(確率論)

## After

I lost... This is part of  
the 65% distribution.  
→ Data entry



「次の1回の勝ち負け」ではなく、「次の100回の分布」を見る。

# まとめ：確率論的トレーダーへの道



Win Rate is Irrelevant  
勝率を追わず、期待値を追う。



Pursue Asymmetry  
損益分布を右に歪ませる。



Track Realized RR  
机上の空論ではなく、実現値を管理する。



Track Realized RR  
机上の空論ではなく、実現値を管理する。



Accept the Cost  
連敗はビジネスの必要経費である。



Stop Predicting  
予言者ではなく、分布の管理者になる。

Noto Serif JP

Design the shape of your profit and loss. (損益の「形」をデザインせよ)