

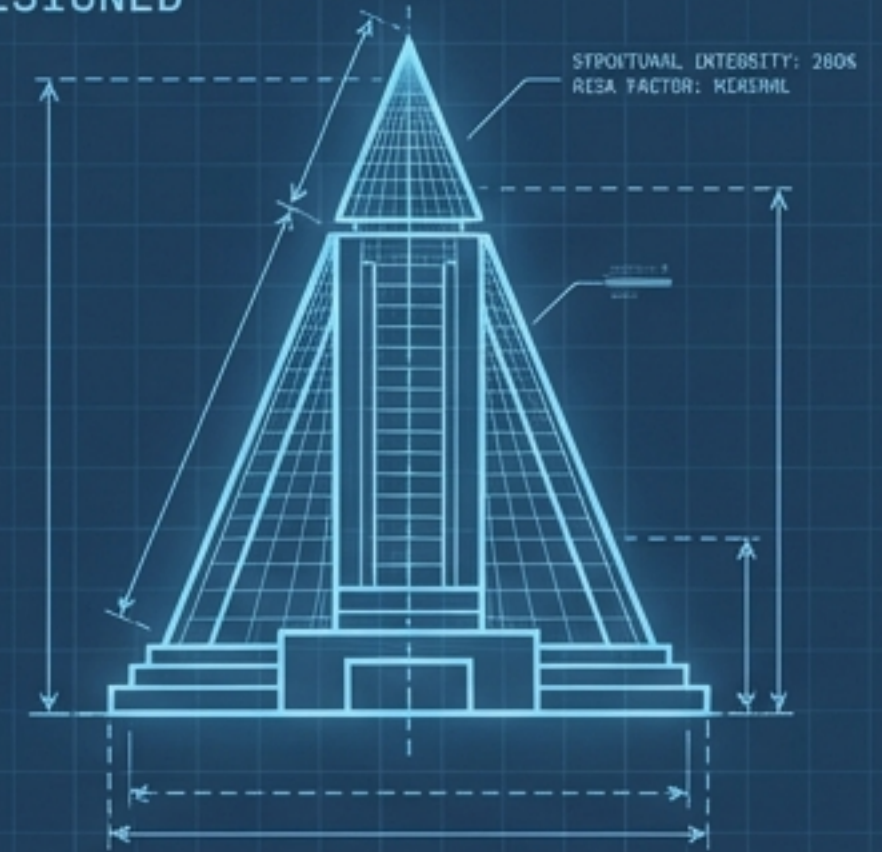
生存を設計せよ： 破産確率という真実

Design Your Survival: Understanding Risk of Ruin

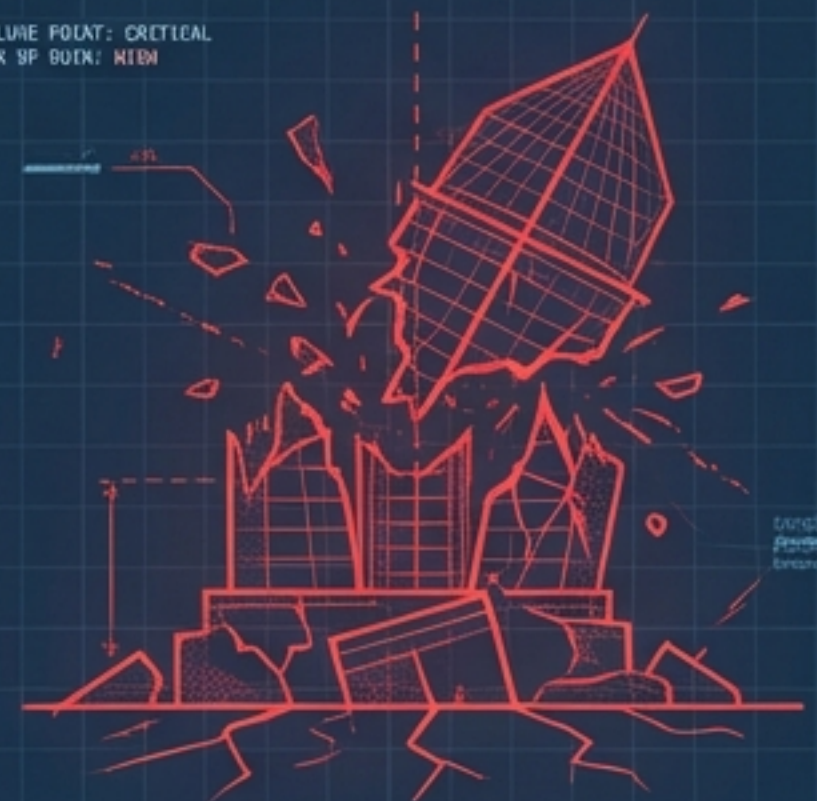
「このロットで続けたら、いつか資金は溶けますか？」

多くのトレーダーは「勝率」や「月利」を気にします。しかし、最も重要な問いは「あなたの戦略の破産確率は何%ですか？」ということ。ここを感覚で決めるのは、設計図なしでビルを建てるのと同じ。いつか必ず崩壊します。

DESIGNED



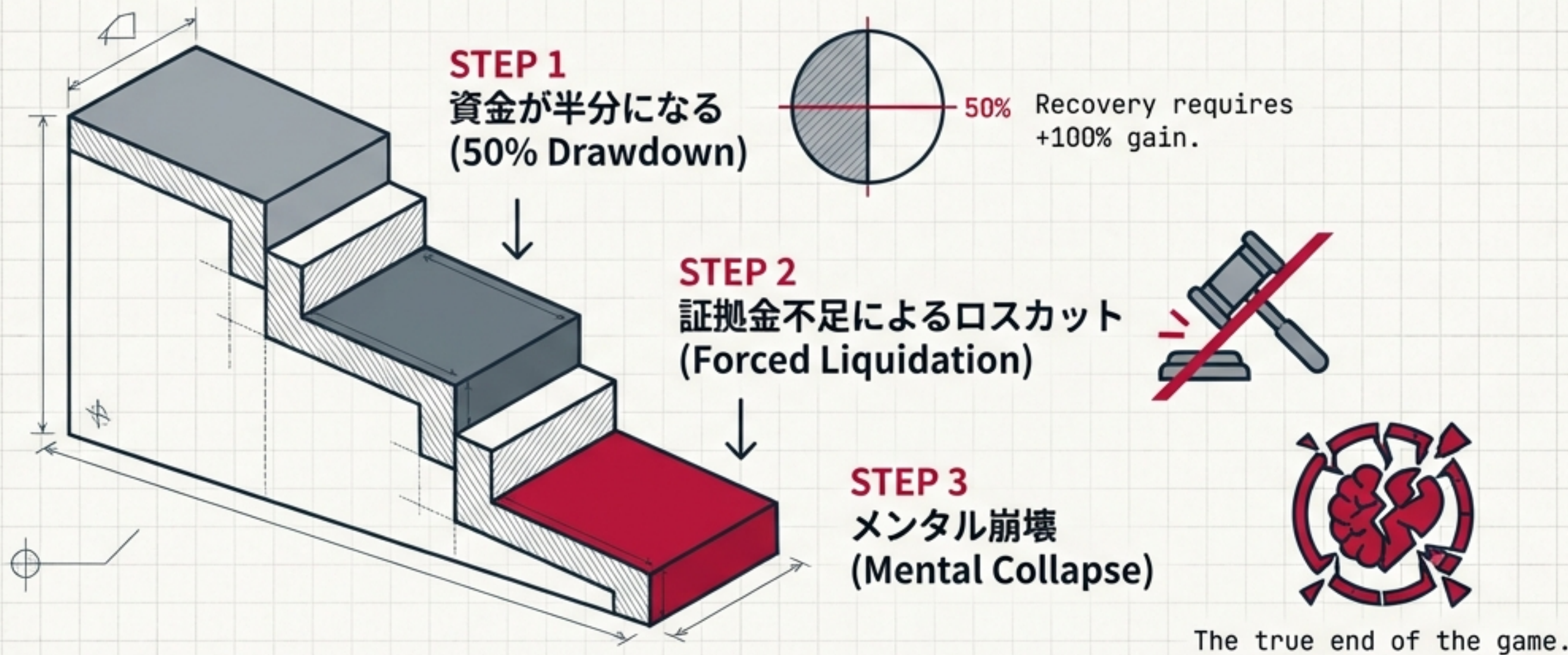
FAILURE POINT: CRITICAL
RISK SP. HIGH



INTUITIVE

「破産」とは口座残高ゼロのことではない

Ruin Is Not Just Zero. It Is the Inability to Continue.



メンタル崩壊。資金が残っていても、心が折れたら**実質的な破産**。
トレードは「**続けられるかどうか**」がすべて。退場したら、その時点で終わりです。

生存を決める3つのレバー

勝率
(Win Rate)

Hard to Control

×

リスクリワード
(Risk Reward)

Strategic Design

=

1回のリスク%
(Risk Per Trade)

THE CRITICAL LEVER

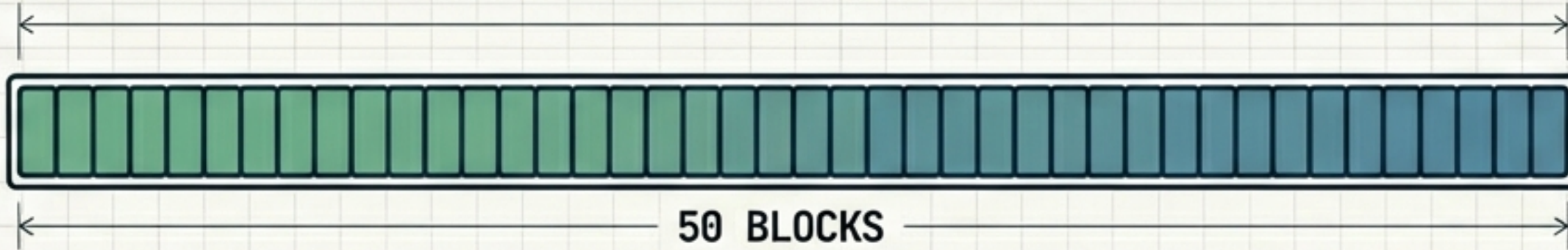
難しい数式を覚える
必要はありません。

重要なのは、「1回
のリスク%」が小さ
ければ、破産確率は
劇的に下がるという
事実です。

お金ではなく、「資金単位数（ライフ）」を数える

Risk 1%

JetBrains Mono



50 Lives

Risk 5%

JetBrains Mono



10 Lives

資金単位数（ライフ）の定義

資金単位数 = 許容ドローダウン ÷ 1回のリスク%

Noto Serif JP Regular

Allowable Drawdown

JetBrains Mono

$50\% \div 1\% = 50 \text{ Units}$

JetBrains Mono

$50\% \div 5\% = 10 \text{ Units}$

JetBrains Mono

単位数が小さいほど、破産確率は指数関数的に跳ね上がります。

Noto Serif JP Regular

ケーススタディ①：コイントスの罠

Win Rate: **50%**

Noto Serif JP Regular

JetBrains Mono

Risk Reward: **1:1**

Noto Serif JP Regular

JetBrains Mono

Risk: **1%**

Noto Serif JP Regular

JetBrains Mono

Expectancy: **ZERO (優位性なし)**

Noto Serif JP Regular

JetBrains Mono



一見「悪くない」に見えますが、期待値はゼロ。優位性がない戦略は、時間をかけるほど不利になります。長期的な破産確率は限りなく高くなります。

Noto Serif JP Regular

ケーススタディ②：勝率40%でも「不死身」の設計

Case Study 2: The Sniper Blueprint

Win Rate: 40% (Low)

Noto Serif JP Regular

JetBrains Mono

Risk Reward: 1:2 (High)

Noto Serif JP Regular

JetBrains Mono

Risk: 1% (Safe)

Noto Serif JP Regular

JetBrains Mono

VISUAL MATH

Noto Serif JP Regular

Wins: 4 x (+2) = +8

Losses: 6 x (-1) = -6

Total = +2



10回中6回負けても、トータルはプラス。資金単位数も50あるため、破産確率はほぼゼロに近い超安全な設計です。

Noto Serif JP Regular

ケーススタディ③：リスク設定ひとつで天国から地獄へ

(Case Study 3: The Greed Error)

Win Rate: 40%

Noto Serif JP Regular

JetBrains Mono

Risk Reward: 1:2

Noto Serif JP Regular

JetBrains Mono

Risk: 5%

Noto Serif JP Regular

JetBrains Mono

VISUAL CALCULATION Noto Sans JP Bold

Funds Unit: $50\% \div 5\% = 10 \text{ Units}$



戦略（勝率・RR）は同じなのに、リスクを5%にしただけで、たった10連敗で終了ラインへ。リスク設定の変更だけで、破産確率は激変します。

Noto Serif JP Regular

「10連敗」は不運ではなく、確定事項

Probability: $0.6^{10} \approx 0.6\%$

Frequency: ~6 times in 1,000 trades



0.6%は低い数字に見えますが、1000回トレードすれば約6回は必ず遭遇します。
連敗は「来るもの」として設計しなければなりません。

連敗が来た時、あなたはようになるか？

1% RISK (Blue Zone)



Damage: -10%

Mental State: Calm / Recoverable

Status: **ALIVE**

5% RISK (Red Zone)



Damage: -50%

Mental State: Panic / Collapse

⚠ Status: **GAME OVER** ↘

「こんなはずじゃなかった」とパニックになるのは、準備不足の証拠です。

なぜみんな「破産確率」を見ないのか？



重要なのは「勝てる確率」ではなく「生き残れる確率」。

破産確率を下げる3原則



当サイトの結論：基本は1%固定

最大連敗をほぼ
吸収できる
(Absorbs Streaks)



メンタルが安定する
(Mental Stability)

複利運用に適している
(Good for Compounding)



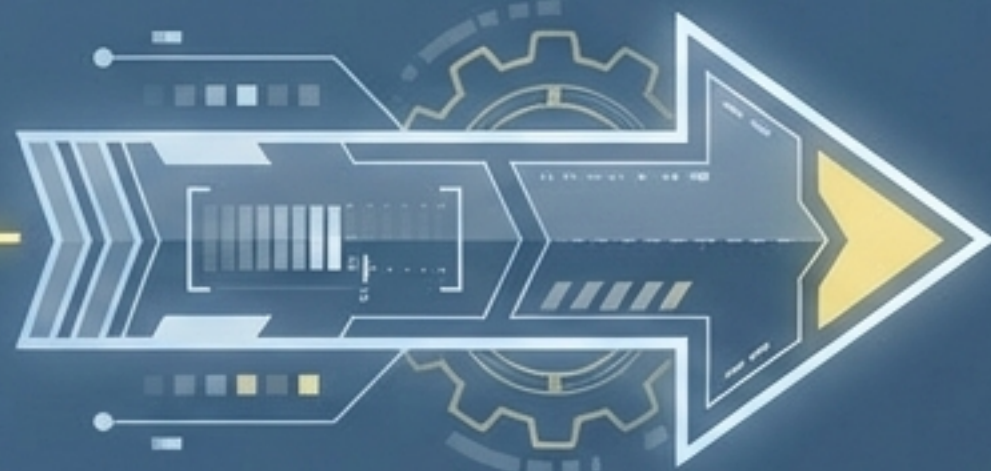
3%以上は理論上成立しても、連敗時の損失加速とメンタル崩壊リスクが高く、長期的には合理的ではありません。

「運ゲー」から「設計されたゲーム」へ

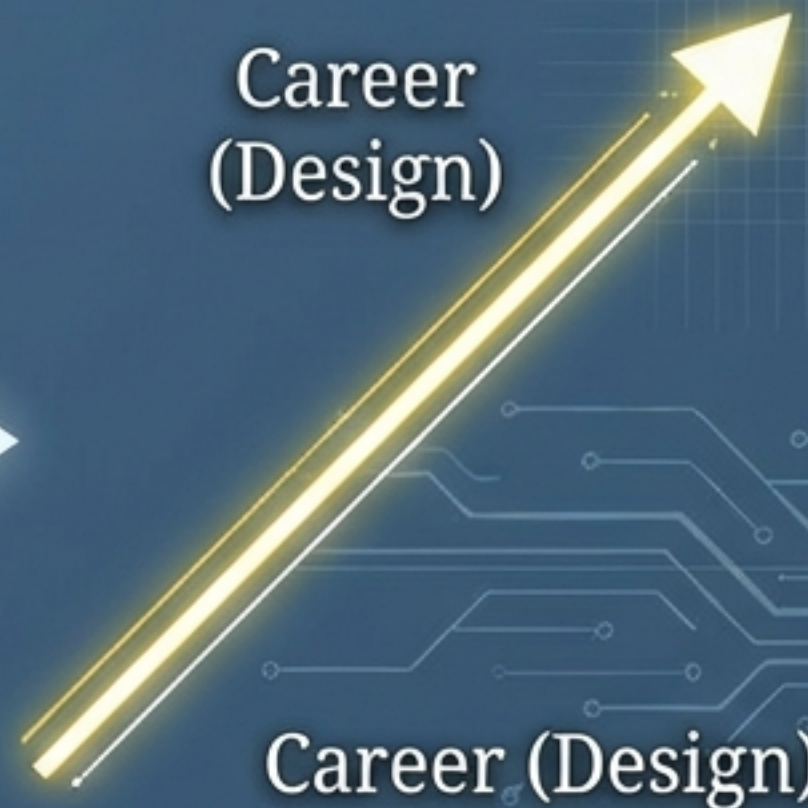
Gambling (Luck)



Risk Calculation



Career
(Design)



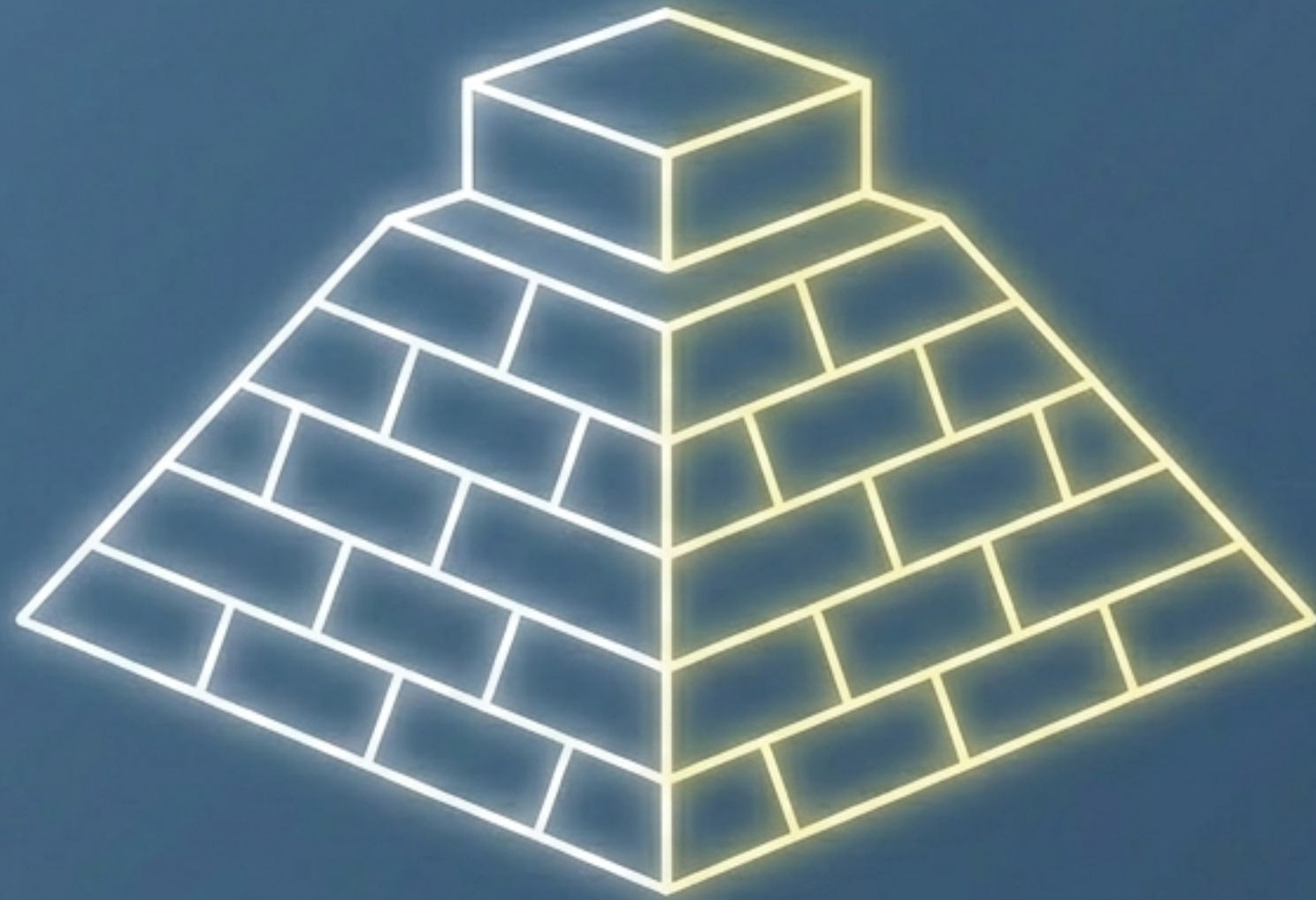
Career (Design)

勝率 (Win Rate) < 生存率 (Survival Rate)

月利 (Monthly Profit) < 寿命 (Longevity)

ロットを決める前に破産確率を考える。
これができた瞬間、トレードはギャンブルではなくなります。

まずは1%から。長く、強く生き残ろう。



破産確率の話は地味ですが、トレードの未来を決定づける知識です。
焦らず、1%で積み上げていきましょう。
地味ですが、それが本当の強さです。

Presented by 鼻ツッペ