勝率40%でも、本当に勝てるのか？

負けが「6割」でも資産が増える「期待値」の正体と、その絶対条件。

Presented by 鼻ツっぺ

NotebookLM

10回中6回
負けるんだよ？
無理でしょ

40%でも勝てるって
聞いたけど…

答えは「条件付きでYES」。

ただし、この「条件」を外すと普通に負けます。
多くの人はここで誤解して退場していきます。

NotebookLM

1回の勝敗ではなく、100回の「平均」で見る。

勝率
(Win Rate):
40%

リスクリワード
(Risk:Reward):
1：2

$$0.6 \times (1R \times (+2R))$$

$$= +0.2R$$

勝った時に2倍取れるなら、10回中6回負けても
トータルではプラスになる。これが「期待値」です。

NotebookLM

現実は、綺麗に「勝ち・負け」が交互に来ない。

6連敗してから4連勝。トータルの勝率は
計算通りでも、途中経過はぐちゃぐちゃです。

NotebookLM

7連敗・8連敗は「普通」に起きる。

僕も昔、5連敗した時に
『この手法ダメだ』と思って
変えてしまいましたが、
それは完全な早まりでした。

これは数学的に「普通に起こる範囲」です。
珍しいことでもなんでもありません。

NotebookLM

メンタルが崩れると、確率が壊れる。

連敗は異常じゃない。40%の勝率なら、むしろ自然なこと。

NotebookLM

条件①：机上の空論ではなく「実現RR」を見る。

Math of Failure

$$0.4 \times (1.2R) - 0.6 \times (1R) = -0.12R$$

設定上の数値ではなく、「実際に取れた利益の平均」がプラス期待値でなければ、資金は減り続けます。

NotebookLM

条件②：試行回数が足りないと意味がない。

20回やって「15回負けたからダメだ」と判断するのは早すぎます。
特にスイングトレードは時間がかかるため、「正しいのに負け続ける」期間が長くなります。

NotebookLM

条件③：資金管理がないと連敗で即死する。

勝率40%で戦うなら、連敗をサバイブできるロット（1%目安）で設計すること。

NotebookLM

条件④:「ずっと負けてる感覚」に耐える心理耐性。

勝率40%の世界では、
6割負けるのが「正常」です。
「自分はダメだ」と自己否定せず、
淡々とルールを守る力が
求められます。

NotebookLM

勝率40%が向いている手法とは？

Trend Following (トレンドフォロー)

Small Losses, Big Wins.

Breakout (ブレイクアウト)

False breaks are costs. Real breaks are profit.

「負けは多いが、勝った時に大きく伸びる」スタイルにフィットします。

NotebookLM

今日から始めるアクションプラン

- [ ] **Record Realized RR (実現RRを記録する)**
  Not the planned target, but the actual average profit per trade.
- [ ] **Anticipate Streaks (連敗を想定する)**
  Accept that 10 consecutive losses will happen.
- [ ] **Judge after 100 (100回試行する)**
  Do not evaluate the strategy before 100 trades.
- [ ] **Survival Sizing (資金管理)**
  Set risk to ~1% to survive the drawdown.

NotebookLM

最後に：本当の敵は「確率」ではなく「自分」

4つの条件（実現RR、試行回数、資金管理、メンタル）が揃って初めて、勝率40%は最強の武器になります。

連敗の見え方が変われば、トレードはもっと楽になる。応援してるよ！

- 鼻ツっぺ

NotebookLM

RESOURCES

Formula:

Expectancy =
(Win % x Avg Win) –
– (Loss % x Avg Loss)

Checklist:

1. Realized RR > 1:2
2. Sample Size > 100
3. Risk per trade = 1%

Save this slide for reference.

NotebookLM

Presented by 鼻ツっペ

Thank you for reading.

NotebookLM