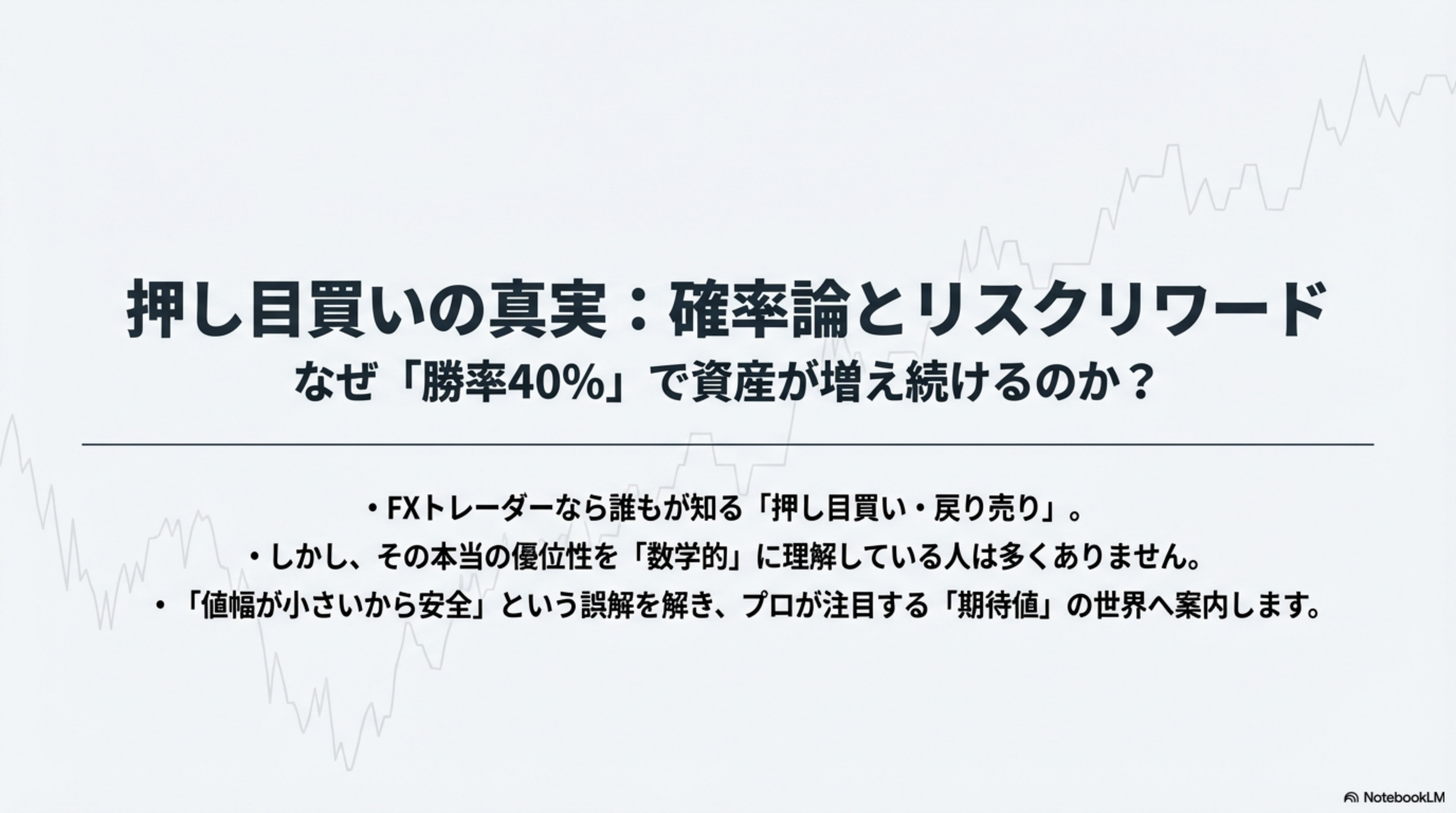




押し目買いの真実：確率論とリスクリワード

なぜ「勝率40%」で資産が増え続けるのか？

- FXトレーダーなら誰もが知る「押し目買い・戻り売り」。
- しかし、その本当の優位性を「数学的」に理解している人は多くありません。
- 「値幅が小さいから安全」という誤解を解き、プロが注目する「期待値」の世界へ案内します。

よくある勘違い：「損切り幅が狭い = リスクが小さい」？

多くのトレーダーはこう考えます。

「押し目買いは損切りラインが近いから、リスクが小さくて安全だ」。

実は、これこそが最大の誤解です。

プロのトレードにおいて、リスクの大きさは「値幅 (pips)」では決まりません。



大前提のルール：定率投資法

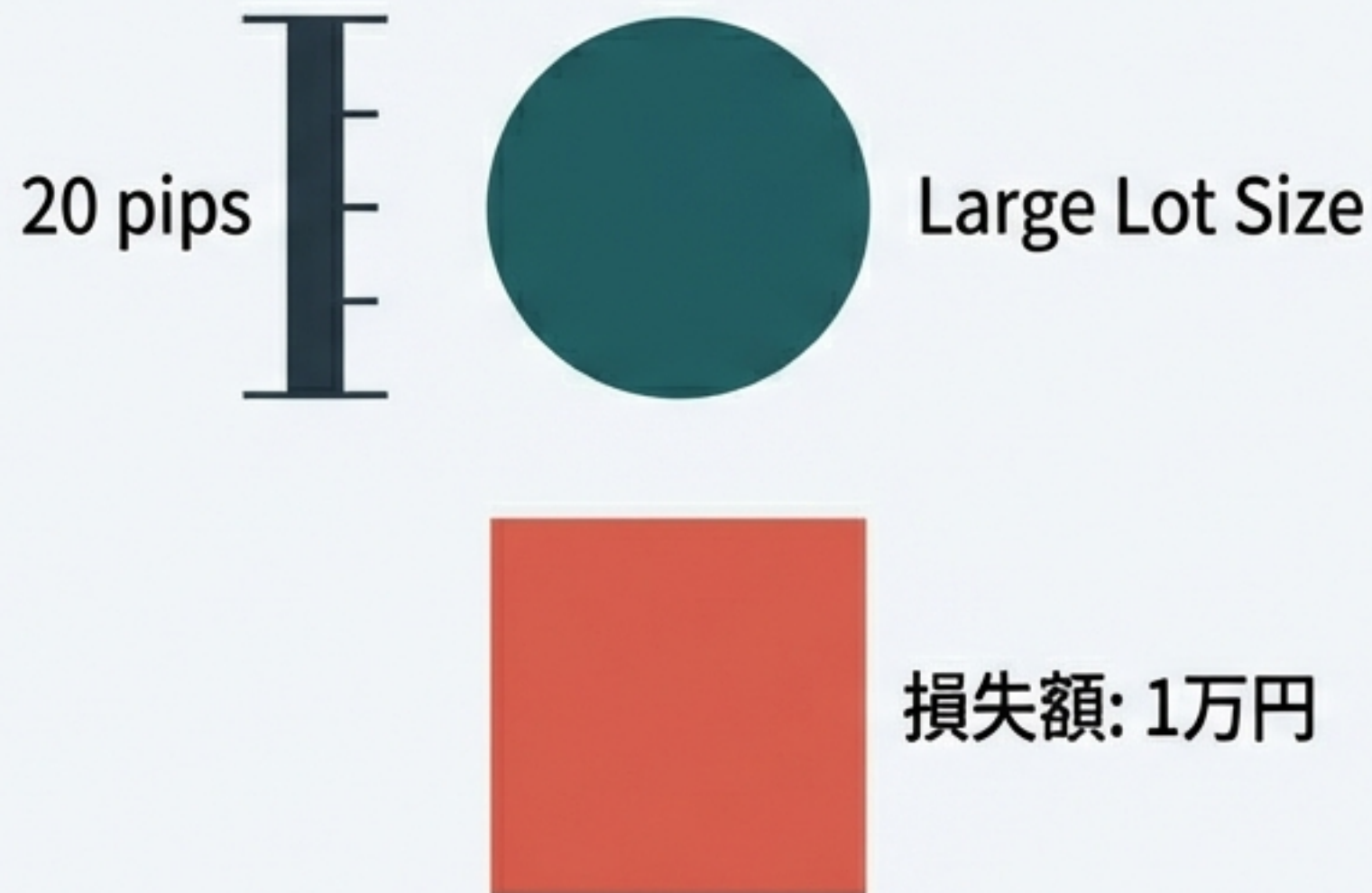
$$\text{1回のトレードのリスク} = \text{資金総額} \times 1\%$$

リスクは常に固定 (Fixed)

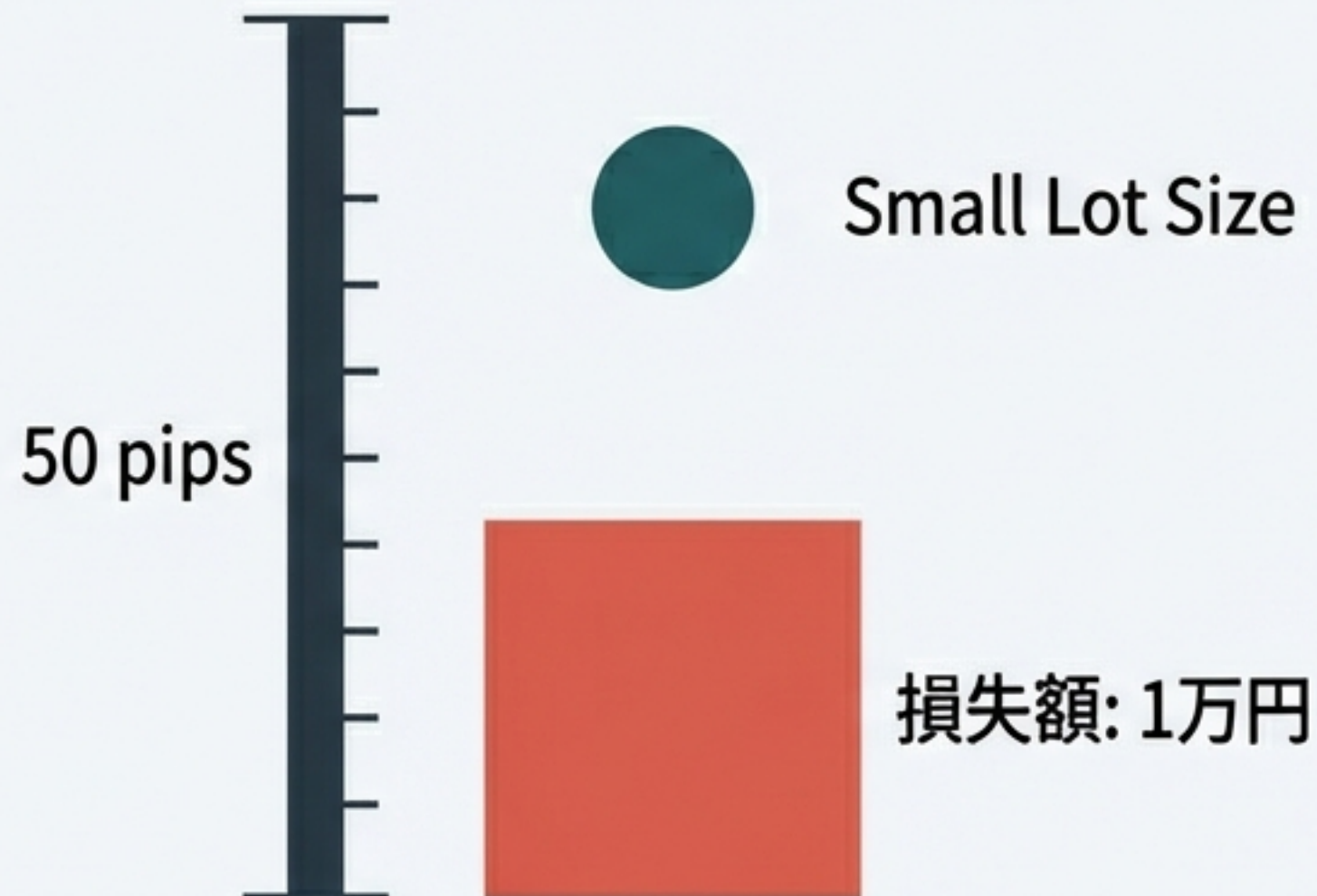
- 定義: 1回のトレードの損失額を、資金の一定比率（例：1%）に固定する手法。
- 鉄則: どのような相場状況でも、この「損失額」は常に一定です。
- つまり、リスクは常に固定（Fixed）されており、エントリーの場所によって変動してはいけません。

値幅とロットサイズの「シーソー関係」

パターンA (Pattern A)



パターンB (Pattern B)



結論：損切り幅が狭くても広くても、負けた時の損失額（ダメージ）は同じ「1万円」です。
「押し目だから安全」のではなく、「リスクは常に1Rで固定」なのです。

本当の優位性は「リワードの拡張性」にある

リスクが常に一定 ($-1R$) なら、どこで勝負が決まるのか？

答えは、「同じリスクで、どれだけ大きなリワードを狙えるか」です。

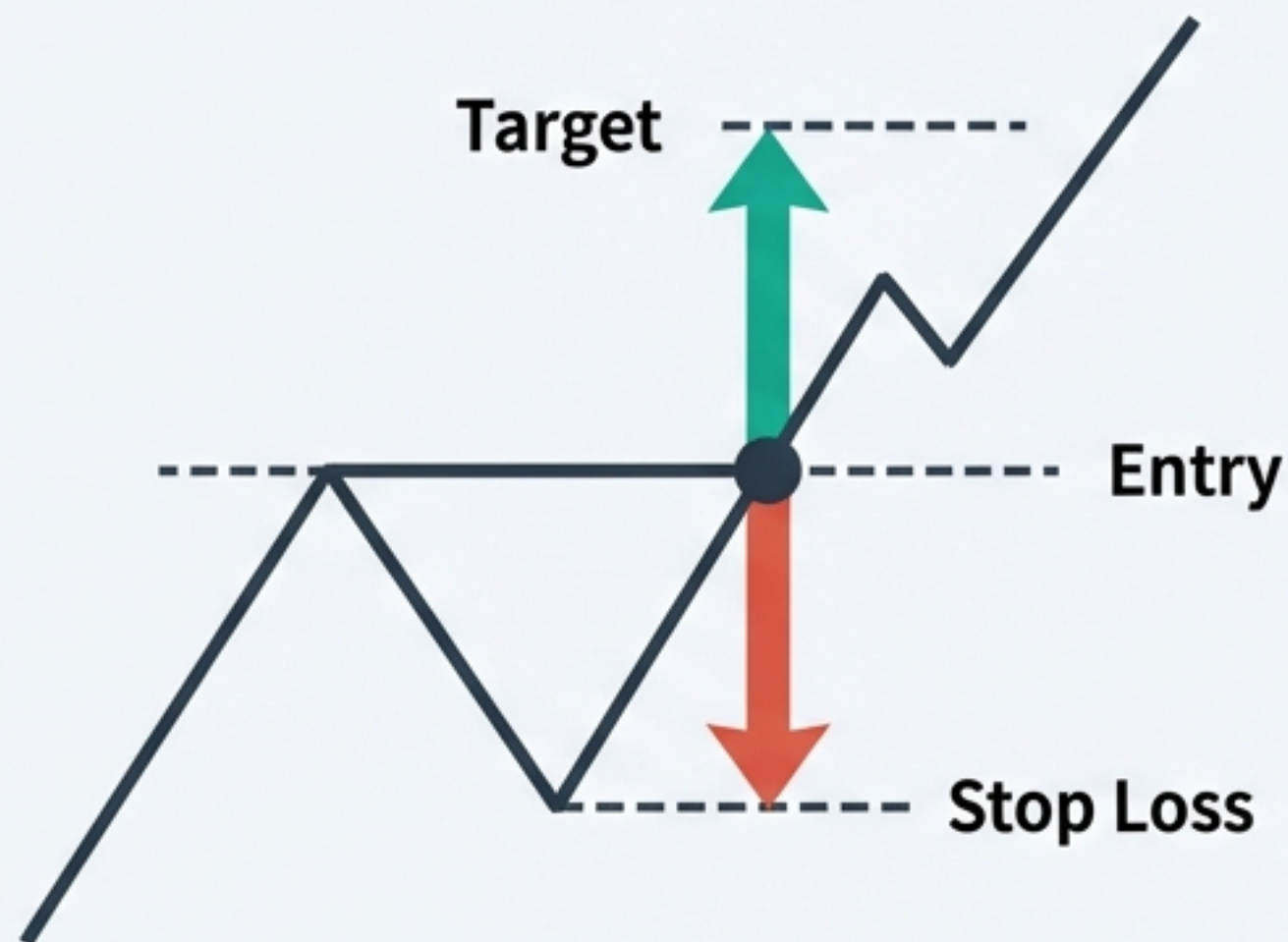
押し目買いの構造：

- 損失： $-1R$ （固定）
- 利益目標：直近高値、さらにその上の更新分。



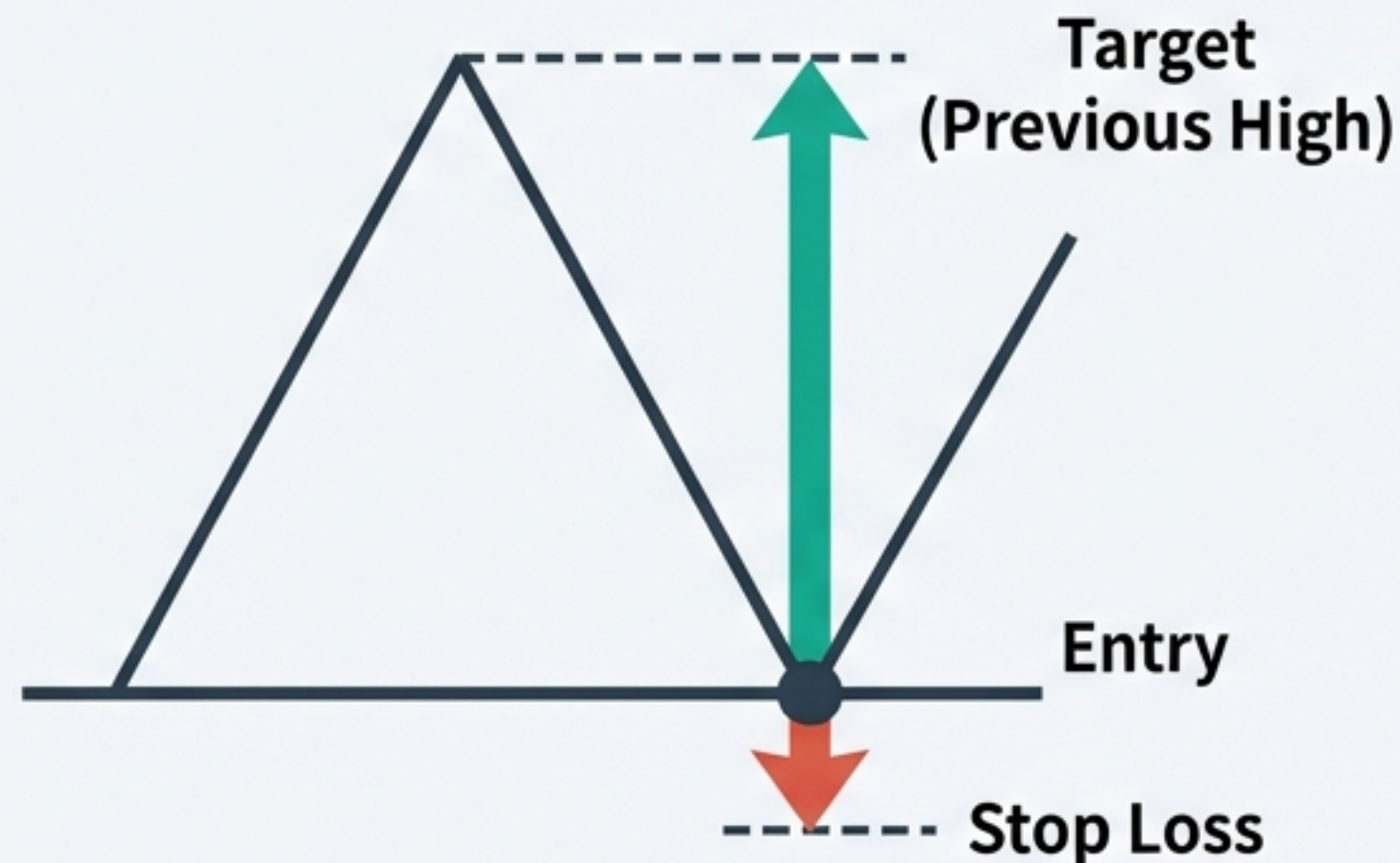
構造比較：ブレイクアウト vs 押し目買い

ブレイクアウト (Breakout)



R:R = 1:1

押し目買い (Dip Buy)



R:R = 1:2.5

ブレイク手法は構造的に1:1になりやすいが、押し目手法は構造的に1:2.5以上が狙える。

感情を排して「数字」で考える：期待値の方程式



$$\text{期待値} = (\text{勝率} \times \text{利益額}) + (\text{負率} \times \text{損失額})$$

トレードの正解は、チャートの形ではなく「計算式」の中にあります。

勝率50%が必要だと思い込んでいませんか？

リスクリワード構造が変われば、必要な勝率は劇的に下がります。

シミュレーションA：「1対1」の罠

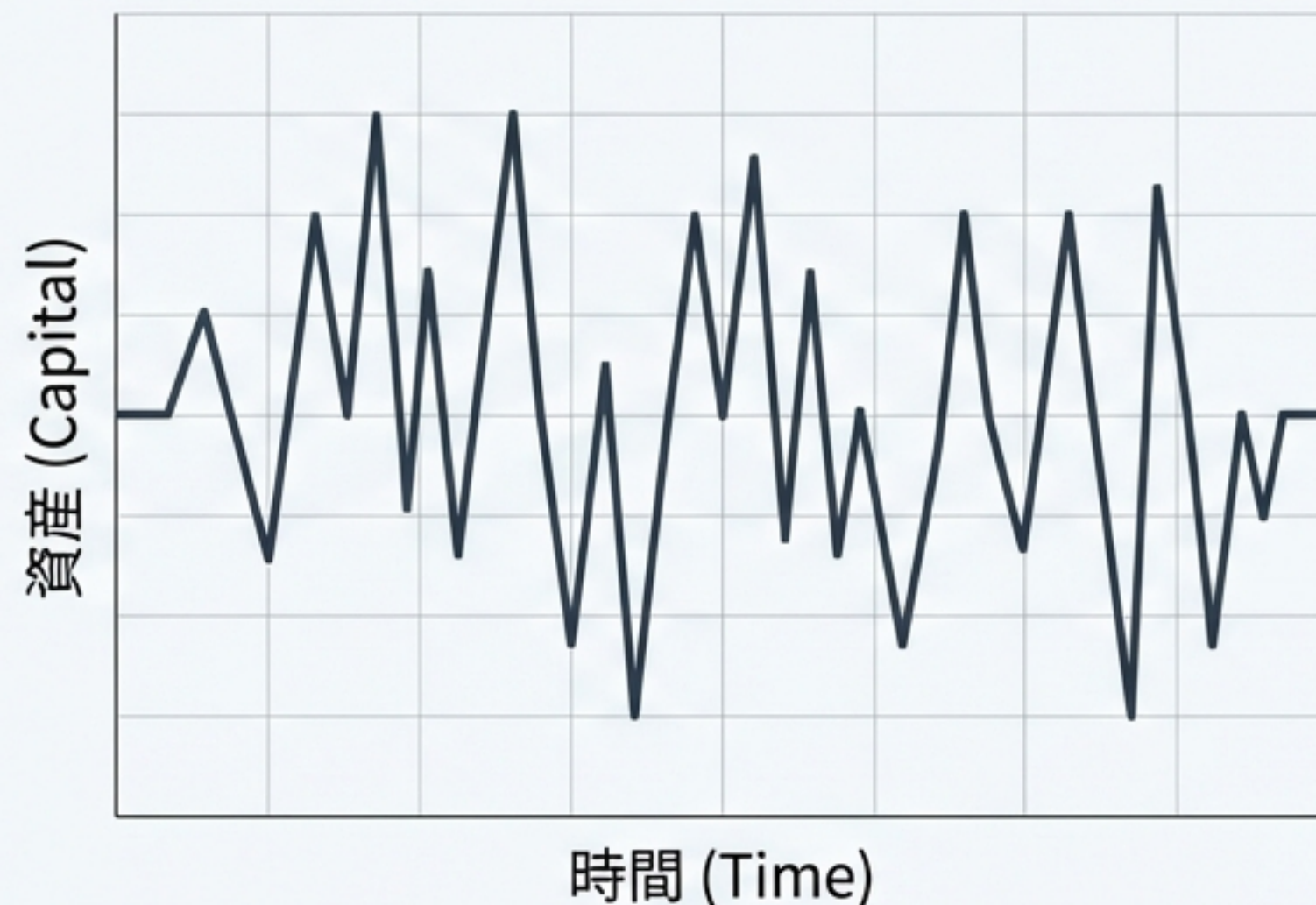
条件:

リスクリワード 1:1

勝率: 50%

計算: $0.5 \times (+1R) + 0.5 \times (-1R) = 0$

結果: ± 0 (プラスマイナスゼロ)



どれだけ頑張ってトレードしても、資産は増えません（スプレッド分だけマイナス）。
これが多くのトレーダーが陥る「勝率50%の壁」です。

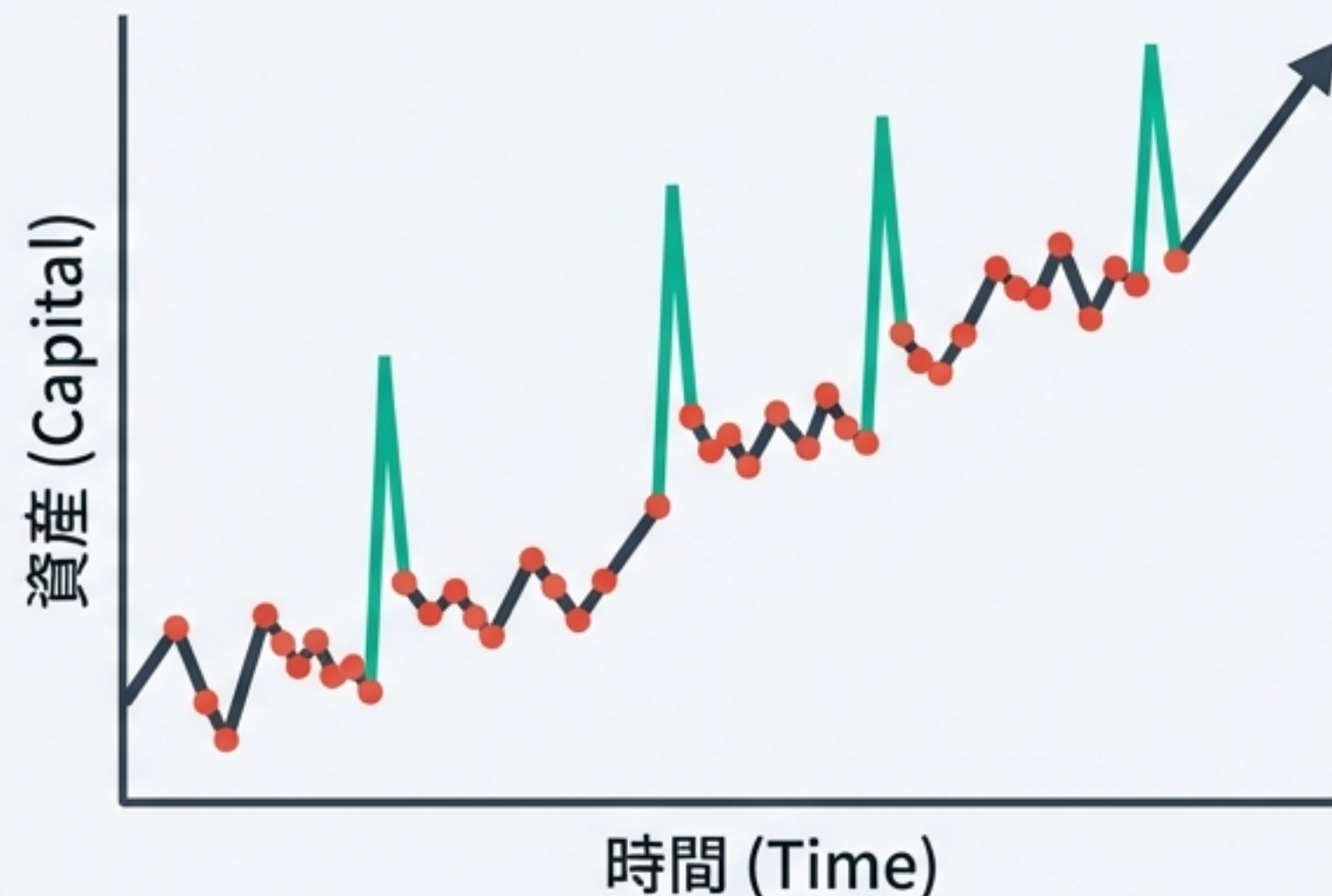
シミュレーションB：勝率43%の魔法

条件：押し目買い（1:2.5）

勝率：43%（負け越し）

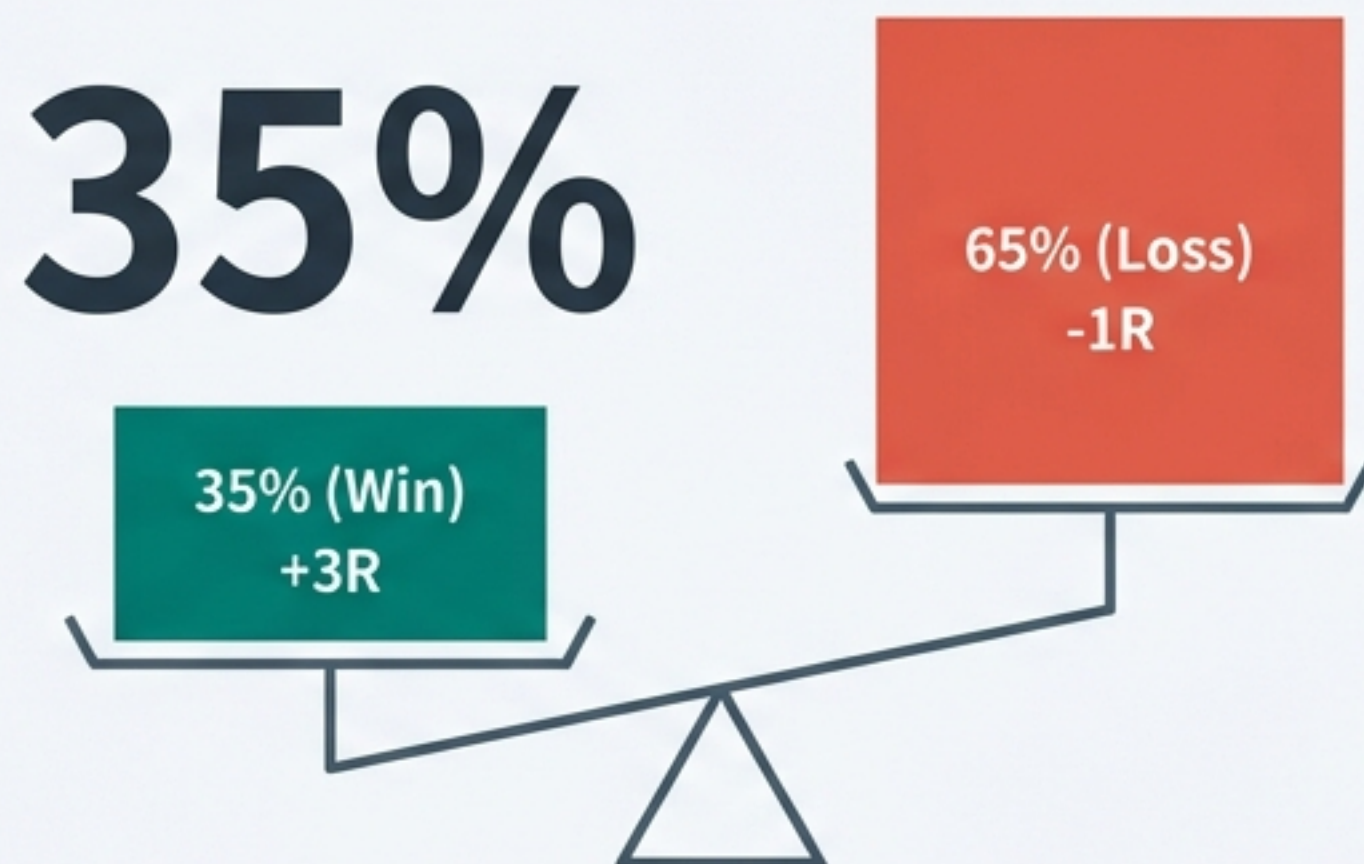
計算： $0.43 \times (+2.5R) + 0.57 \times (-1R)$

結果： $+0.505R$ (利益)



勝率が50%を下回っていても、期待値は明確にプラスです。
これが「リスクリワードの非対称性」が生む優位性です。

極端な例：勝率35%でも資産は増える



条件: リスクリワード 1:3、勝率 35%

$$\text{計算: } 0.35 \times (+3R) + 0.65 \times (-1R) = +0.4R$$

- 意味: 10回中6.5回負けても、トータルでは勝ち越せます。
- 「負けてはいけない」というプレッシャーから解放されることが、メンタル安定につながります。

具体的な金額で見る「5万円の差」

資金100万円、1回のリスク1%（1万円）で10回トレードした場合

戦略A（Strategy A）

勝率 50%

RR 1:1

結果: 5勝5敗

収支: 0円

戦略B（Strategy B）

勝率 43%

RR 1:2.5

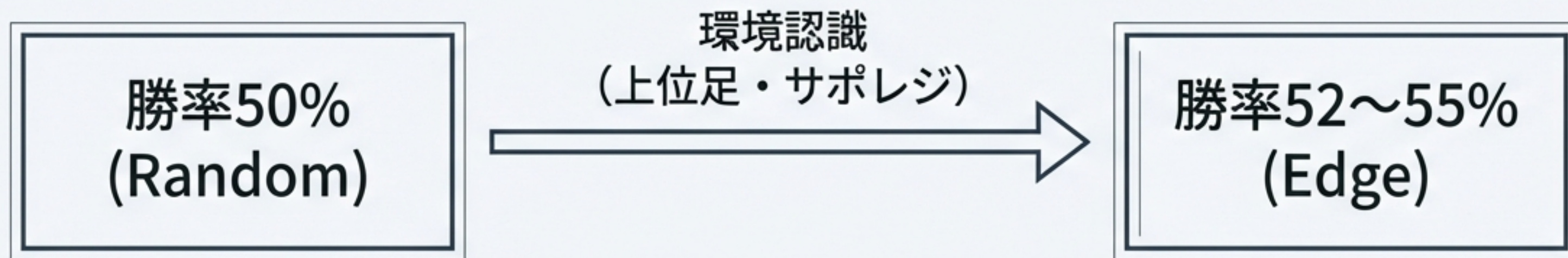
結果: 4.3勝5.7敗

収支: +50,500円

勝ち: +10.75万円 / 負け: -5.7万円

結論: 勝率が低い戦略Bの方が、圧倒的に利益が残ります。

「環境認識」が確率を増幅させる



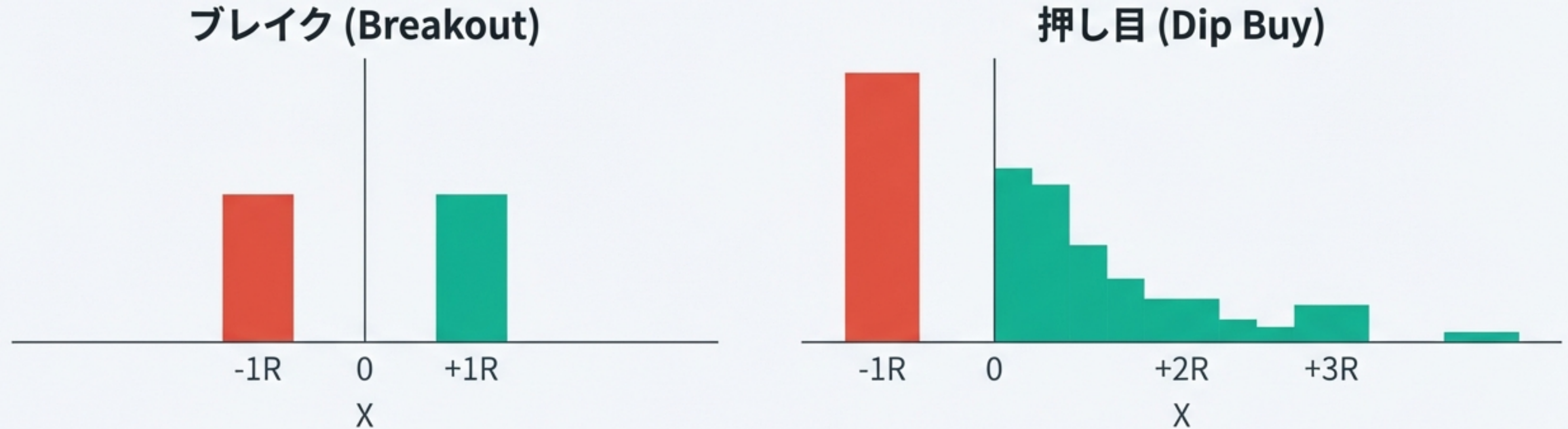
Multiplier Effect

勝率50% × 1:2.5 = 期待値 +0.75R

勝率55% × 1:2.5 = 期待値 +0.925R

わずか5%の勝率アップが、高いリスクリワードと掛け算され、利益を跳ね上げます。

利益の分布図：右側に歪んだカーブ



- ブレイク手法: 左右対称の分布。安定しているが増えない。
- 押し目手法: 右に歪んだ (Skewed) 分布。負けは多いが、勝った時のインパクト (右側のテール) が全てをカバーします。

陥りやすい罠とメンタル管理

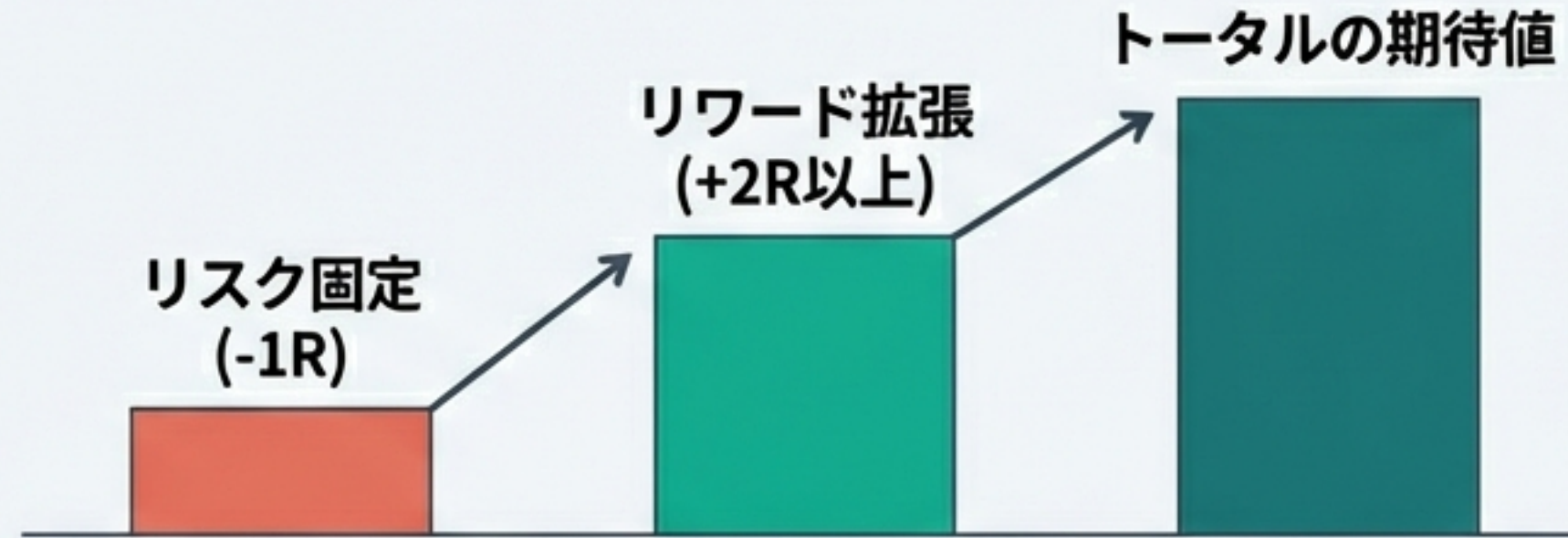
⚠ 絶対にやってはいけないこと (Don'ts)

- 「押し目だから安全」と勘違いしてロットを張る。 (リスク一定の原則崩壊)
- 無理に勝率60~70%を目指す。 (エントリーチャンス減少、利確が早まる)

メンタルの壁 (Mental Barriers)

- 勝率40%台は、連敗が当たり前です。
- 「手法が間違っているのでは？」と疑わず、30~50回の試行回数で統計を見てください。
- 大数の法則を信じて、ルールを守り抜く力が試されます。

結論：勝率40%で十分に勝てる



確率は「勝率を上げる」ためではなく、
「リスクとリワードの掛け算を最適化する」ためにあります。

まとめ：

1. リスクは常に-1Rで固定する（定率投資法）。
2. 同じリスクで+2R以上を狙う（リワード拡張）。
3. 勝率にこだわらず、トータルの期待値を追う。

完璧なトレードは必要ありません。ただ、淡々と「有利な確率」を積み重ねてください。