

反省

①エントリー○ 損切○ エントリーをずらしても余裕で損切だった。

②エントリー△ 損切○ 今日は全部エントリーをずらすと決めていたのに、大チャンスと思って反射的に通常のポイントでエントリーしてしまった。結局はずらしても2〜3ティック損切幅大きくしないと損切になっていたから結果は損切で変わらない。損切ラインに一瞬でもタッチしたら即切るからこの値幅は自分の値幅ではなかった。

③エントリー○ 利確×

トレンドが継続するパターンとしたら、かなりもったいない利確。トータル的にこの早利確が期待値を下げる。ここは本来損切になる場面だった。5分線を越えて下落がずどんと行きかけたが、上に行こうとしていたと感じたから利確してしまった。いったん8219円まで下落したが戻って5分線を越えてもみもみして一回5分線まで落ちたところで利確上げたそうなもみもみだった。やはり損切が続くと、オーバーキルを狙わず、ある程度伸ばしたら利確したい欲が勝る。収支バリアがあれば握れるのだがまだ甘い。

④エントリー○ 利確×

これも5分線で利確してしまった。やはり初手で損切が続くと、ビビって握力がかなり弱くなる。

連敗というのもあって、期待値を完全に信じる事が出来ていない。

期待値と言っても、取引終了になってエントリーできなくなった後に大チャンスが来たら、

値幅取れる場面を逃してトータルマイナスになるから判断が難しい。

自分のやり方では、取引初手から4回連続で損切になったら取引終了になるから、1万円の損失限定ルールは試行回数をたくさん行えない確率の方が大きくなってしまいうという思いがよぎる。最近の傾向として、利益を増やしたいから、エントリーポイントを少し緩めてエントリー増やして利益を大きくしようとしていた。結局は、増やしたポイントの期待値を計算してみたら、期待値がマイナスでかつ勝率が20〜25%くらいだから、損失限定の1万円では試行回数がすくなくすぎて、値幅が取れるポイントにたどり着くまでに取引終了になっていた。リスク許容度に応じて手法は選別していくことが大事だと連敗とデータから実感した。1万円の損失以内では勝率が50%で6日に1回自分の損切平均額2500円を4回連続で引いてしまう確率がある。

40%になると3日に1回で、20%だと、4日に3日となる。なので、どれだけ期待値が高くても、損切額と損失限定の観点から、勝率が20%では、勝ちを引くまでにほぼ取引終了するから勝てるのが運レベルになる。その手法は、まず初手で繰り出していたからそりゃトータルどうしても勝てないよねという感じ。期待値計算して良かった。試行回数が少ない状態でこれだから本当に勝てないやり方。今日は勝率40%で期待値+の手法しかしていないから勝つべくして勝ったと思う。

現在が一番良い手法→試行回数38回、勝率53%、負率47%、平均利益11592円、平均損失2444円、総利益231840円、総損失44000円、期待値4943円、PF5.3、R:R4.7

勝率が50%で、6日に1回4連続で損切になる確率がある。40%で、3日に1回4連続損切になる確率がある。

一番良い手法のデータが100回分揃ったとして、勝率が50%で期待値が3000円くらいになったとしても、6日に1回負けるけど、エントリーが5回で1日15000円取れて、3回だとしても9000円。試行回数を増やして期待値3000円くらいと勝率50%くらいに収束するなら、下手に他の上がりそうとかさがりそうという根拠が薄いエントリーをしない方が明らかに良いじゃんというのを確率的に頭に落とし込むと良いかも。絶対勝てる手法は無いから、収束する確率だけを信じて、期待値がプラスな一貫したトレードを本当のチャンスでのみ取引すれば勝つべくして勝てる。

自分の進むべき道はこれだと思う。自分が取れない値幅に関しては無視して、一貫スタイルで行けばトータルで負けることはなさそう。あとは、期待値を減らして勝率を上げる利確の仕方だったりとかを、壁打ちしまくって一番良い塩梅のエントリー・利確を磨いていけば未来ありそう。