

### ■資金に対して－2%の損切り

$$1,000,000 \text{ 円} \times 2\% = 20,000 \text{ 円} \Rightarrow 980,000 \text{ 円}$$

$$980,000 \text{ 円} \times 2\% = 19,600 \text{ 円} \Rightarrow 960,400 \text{ 円}$$

$$960,400 \text{ 円} \times 2\% = 19,208 \text{ 円} \Rightarrow 941,192 \text{ 円}$$

$$941,192 \text{ 円} \times 2\% = 18,823 \text{ 円} \Rightarrow 922,369 \text{ 円}$$

$$922,369 \text{ 円} \times 2\% = 18,447 \text{ 円} \Rightarrow 903,922 \text{ 円}$$

### ■資金に対して－5%の損切り

$$1,000,000 \text{ 円} \times 5\% = 50,000 \text{ 円} \Rightarrow 950,000 \text{ 円}$$

$$950,000 \text{ 円} \times 5\% = 47,500 \text{ 円} \Rightarrow 902,500 \text{ 円}$$

$$902,500 \text{ 円} \times 5\% = 45,125 \text{ 円} \Rightarrow 857,375 \text{ 円}$$

$$857,375 \text{ 円} \times 5\% = 42,868 \text{ 円} \Rightarrow 814,507 \text{ 円}$$

$$814,507 \text{ 円} \times 5\% = 40,725 \text{ 円} \Rightarrow 773,781 \text{ 円}$$

### ■ポジションサイジング

$$\text{許容損失額} \div \text{損切り幅 (pips)} = \text{打てる取引量 (lot)}$$

#### ・100pips の損切り幅

$$20,000 \text{ 円} \div 1 \text{ 円 (100pips)} = 2 \text{ 万通貨}$$

$$50,000 \text{ 円} \div 1 \text{ 円 (100pips)} = 5 \text{ 万通貨}$$

#### ・50pips の損切り幅

$$20,000 \text{ 円} \div 0.5 \text{ 円 (50pips)} = 4 \text{ 万通貨}$$

$$50,000 \text{ 円} \div 0.5 \text{ 円 (50pips)} = 10 \text{ 万通貨}$$

#### ・20pips の損切り幅

$$20,000 \text{ 円} \div 0.2 \text{ 円 (20pips)} = 10 \text{ 万通貨}$$

$$50,000 \text{ 円} \div 0.2 \text{ 円 (20pips)} = 25 \text{ 万通貨}$$

・ 10pips の損切り幅

$$20,000 \text{ 円} \div 0.1 \text{ 円 (10pips)} = 20 \text{ 万通貨}$$

$$50,000 \text{ 円} \div 0.1 \text{ 円 (10pips)} = 50 \text{ 万通貨}$$

■ 100 万の資金で打てる取引量

ポンド円 133.530 円の時

・ 1 万通貨エントリーした際の証拠金、証拠金維持率は??

$$133.530 \text{ 円} \times 10,000 \text{ (通貨分)} = 1,335,300 \text{ 円 分の取引}$$

$$1,335,300 \text{ 円} \times 4\% = 53,412 \text{ 円 (証拠金)}$$

$$1,000,000 \text{ 円 (資金)} - 53,412 \text{ 円 (証拠金)} = 946,588 \text{ 円 (残り資金)}$$

(証拠金維持率 約 1,872%)

1 万通貨でトレード  $\Rightarrow$  1 円動くと  $\pm 1$  万円

1,000,000 円の資金で

証拠金維持率 100%を下回る価格は  $\Rightarrow$  38.87 円 (94.66 円の変動)

$$1,000,000 \text{ 円 (資金)} - 946,600 \text{ 円 (約 94 円の変動)} = 53,400 \text{ 円 (残り資金)}$$

$$53,412 \text{ 円 (証拠金)} \Leftrightarrow 53,400 \text{ 円 (残り資金)} \quad \text{証拠金維持率 100\%}$$

$$53,412 \text{ 円 (証拠金)} \Leftrightarrow 26,700 \text{ 円 (残り資金)} \quad \text{証拠金維持率 50\%}$$

$$\text{※証拠金維持率} \Rightarrow \text{有効証拠金} \div \text{必要証拠金} \times 100\%$$

133.530 円 エントリー時の価格

38.87 円 証拠金維持率 100%になる価格

94 円も変動したらヤバイ

長期間かからないと起こりうる可能性は低い

・ 3 万通貨エントリーした際の証拠金、証拠金維持率は??

$$133.530 \text{ 円} \times 30,000 \text{ (通貨分)} = 4,005,900 \text{ 円 分の取引}$$

$$4,005,900 \text{ 円} \times 4\% = 160,236 \text{ 円 (証拠金)}$$

$$1,000,000 \text{ 円 (資金)} - 160,236 \text{ 円 (証拠金)} = 839,764 \text{ 円 (残り資金)}$$

(証拠金維持率 約 624%)

3 万通貨でトレード ⇒ 1 円動くと±3 万円

1,000,000 円の資金で

証拠金維持率 100%を下回る価格は ⇒ 105.537 円 (27.99 円の変動)

$$1,000,000 \text{ 円 (資金)} - 839,700 \text{ 円 (27.99 円の変動)} = 160,300 \text{ 円 (残り資金)}$$

$$160,236 \text{ 円 (証拠金)} \Leftrightarrow 160,300 \text{ 円 (残り資金)} \quad \text{証拠金維持率 100\%}$$

$$160,236 \text{ 円 (証拠金)} \Leftrightarrow 80,150 \text{ 円 (残り資金)} \quad \text{証拠金維持率 50\%}$$

$$\text{※証拠金維持率} \Rightarrow \text{有効証拠金} \div \text{必要証拠金} \times 100\%$$

133.530 円 エントリー時の価格

105.537 円 証拠金維持率 100%になる価格

28 円も変動したらヤバイ

・ 5 万通貨エントリーした際の証拠金、証拠金維持率は??

$$133.530 \text{ 円} \times 50,000 \text{ (通貨分)} = 6,676,500 \text{ 円 分の取引}$$

$$6,676,500 \text{ 円} \times 4\% = 267,060 \text{ 円 (証拠金)}$$

$$1,000,000 \text{ 円 (資金)} - 267,060 \text{ 円 (証拠金)} = 732,940 \text{ 円 (残り資金)}$$

(証拠金維持率 約 374%)

5 万通貨でトレード ⇒ 1 円動くと±5 万円

1,000,000 円の資金で

証拠金維持率 100%を下回る価格は  $\Rightarrow$  118.871 円 (14.65 円の変動)

1,000,000 円 (資金)  $-$  732,500 円 (14.65 円の変動) = 267,500 円 (残り資金)

267,060 円 (証拠金)  $\Leftrightarrow$  267,500 円 (残り資金) 証拠金維持率 100%

267,060 円 (証拠金)  $\Leftrightarrow$  133,530 円 (残り資金) 証拠金維持率 50%

※証拠金維持率  $\Rightarrow$  有効証拠金  $\div$  必要証拠金  $\times 100\%$

133.530 円 エントリー時の価格

118.871 円 証拠金維持率 100%になる価格

14 円変動したらヤバイ

1 カ月で動く可能生あり

・ 10 万通貨エントリーした際の証拠金、証拠金維持率は??

133.530 円  $\times$  100,000 (通貨分) = 13,353,000 円 分の取引

13,353,000 円  $\times$  4% = 534,120 円 (証拠金)

1,000,000 円 (資金)  $-$  534,120 円 (証拠金) = 465,880 円 (残り資金)  
(証拠金維持率 約 187%)

10 万通貨でトレード  $\Rightarrow$  1 円動くと  $\pm 10$  万円

1,000,000 円の資金で

証拠金維持率 100%を下回る価格は  $\Rightarrow$  128.871 円 (4.66 円の変動)

1,000,000 円 (資金)  $-$  465,900 円 (4.66 円の変動) = 534,100 円 (残り資金)

534,120 円 (証拠金)  $\Leftrightarrow$  534,100 円 (残り資金) 証拠金維持率 100%

534,120 円 (証拠金)  $\Leftrightarrow$  267,060 円 (残り資金) 証拠金維持率 50%

※証拠金維持率  $\Rightarrow$  有効証拠金 $\div$ 必要証拠金 $\times 100\%$

133.530 円 エントリー時の価格

128.871 円 証拠金維持率 100%になる価格

4.66 円変動したらヤバイ

1～2 週間以内で動く可能生あり

1 万通貨エントリー  $\Rightarrow$  94 円の変動に耐えられる

3 万通貨エントリー  $\Rightarrow$  28 円の変動に耐えられる

5 万通貨でエントリー  $\Rightarrow$  14 円の変動に耐えられる

10万通貨でエントリー  $\Rightarrow$  4.66円の変動に耐えられる