

分解モンテカルロ法は、FX(外国為替証拠金取引)におけるポジションサイジング(ロット管理)の手法の一つで、カジノゲームなどで用いられる従来のモンテカルロ法をFX向けに改良したものです。考案者はict119氏とされています。

この手法の理論的な骨子は、損失が発生した後の回収プロセスを重視し、機械的なルールに基づいてベット額(ロット数)を調整することで、感情に左右されずにリスクを管理し、最終的に利益を確保することを目指す点にあります。

具体的な運用ルール(理論)は以下の通りです：

1. 初期数列の設定: まず、「0, 1」という数列から開始します。
2. ベット額(ロット数)の決定: 数列の両端にある数字(左端と右端)を合計した数を、次の取引のベット額(ロット数)とします。初期状態では $0 + 1 = 1$ 単位となります。
3. 勝ちトレードの場合: 取引で利益が出たら、数列の両端の数字を1つずつ削除します。
4. 負けトレードの場合: 取引で損失が出たら、その取引で使ったベット額(両端の数字の合計値)を、数列の右端に新たに追加します。
5. サイクルの完了: 数列の数字がすべて削除された時点で1サイクルが完了します。この手法の重要な特徴として、1サイクルが完了した際には、必ず初期ベット額の1単位分の利益が確定するように設計されています。
6. 分解ルール(独自規則): もし数列の数字が1つだけ残った場合、その数字を、合計すると元の数字になるような2つの数字に分解して書き直します(例: 数列に「2」だけが残った場合、「1, 1」と書き換える)。これが従来のモンテカルロ法にはない独自の特徴であり、「分解」モンテカルロ法と呼ばれる所以です。このルールにより、プロセスが途中で停止することなく、必ず数列解消(=1単位の利益確定)に向かって進むことが保証されます。

この理論に基づく主な特徴と利点は以下の通りです：

- 損失回収を前提とした設計: 勝ち続けている時は基本的に発動せず、損失が出始めた段階で、その損失を着実に回収することに主眼が置かれています。
- 緩やかなロット増加: マーチンゲール法のように損失時にロット数が急激に倍増するのではなく、比較的緩やかに増加するため、証拠金への負担が少ないとされます。
- 連敗への耐性: FXでは連敗も起こりえますが、この手法は連敗に強いとされています。連敗中は初期のベット額(1単位)が維持されやすく、連敗から脱却した後に本格的な損失回収プロセスが始まるため、大きなドローダウンを避けやすい構造になっています。
- システム化への適合性: 数列を用いた完全に機械的なルールであるため、自動売買プログラム(EA)に実装しやすいです。
- **50%以下の勝率での収益可能性:** 勝率が固定されていないFX市場において、このベットシステムを用いることで、勝率が50%を下回る状況でも利益を確保できる可能性があるとし唆されています。

要約すると、分解モンテカルロ法の理論は、**「初期リスクを抑え("0, 1"スタート)、損失発生時に機械的ルール(数列操作と分解ルール)に従ってロットを調整し、最終的に1単位の利益を確保するサイクルを繰り返すことで、感情を排し、連敗に耐えながらリスクを管理する」**という考え方に基づいています。