

【22_107/思考系メルマガ】『トレードスタイル』に合わせた『リスク管理』の考え方

〇〇さん

こんにちは！クロガキ(クロ)です。

今日は1日大阪で色んな人と久しぶりに話をさせて貰ってますが、やはり直接顔を合わせて話をするのはいいですね。

会話って表情も含めてのコミュニケーションなんだなとつくづく感じました。

明日は名古屋に立ち寄って、夜頃に東京へ戻る予定ですが、感染対策だけは十分気を付けて道中楽しみたいと思います。

(姉者からの激しいお土産リクエストも忘れておりません 笑)

さて、今日のテーマです。

□
■ トレードスタイルによって『リスク』に対する考え方は変わる

これ、当たり前の話だよなと思いつつも、今までキチンと体系化して話をしたことがなかったなあと

先週、クロガキ講座(2回目zoom)を実施していて思い立ったので

翌日にモーニングライブのテーマとしても扱わせて貰いました。

▼先日のモーニングライブ▼

<https://youtu.be/n3yY0AxN8xs>

ライブの中でも言及しているように、自分の取るポジションがデイトレなのか、(セミ)スイングなのかによって

保有しているポジションに対するリスクへの考え方が結構変わってきます。

各論に入る前に

そもそも何故、ここまで『リスクの違い』を明確に意識しておく必要があるのでしょうか？

それは、『保有時間の差』によって生じる『リスクの“内容”』が大きく変わってくるからです。

映像の中でも言及しているように

スイングトレードの場合、当然ながら 保有時間 が長くなりますよね。

そうすると、「不可測な事態」に巻き込まれて大きなロスカットが起こるリスクが生じるわけです。

(過去の例:リーマンショック、スイスショック、ギリシャショック、アップルショック、チャイナ・・・多いな！ 笑)

ただでさえ先の値動きがどうなるか分からない相場において

時間と共に増大する『不確実性』によってもたらされるリスクは思っている以上に大きいものです。

だからこそ、自分の中の『ルール(型)』に沿った分割決済等の“利益を確保”するリスクヘッジは欠かすことが出来ません。

実際ガッキーの場合、その管理をしっかり行うことによって、リスクを制御しています。

一方で、僕がやっているような短期デイトレの場合、細かい全決済によって着実に利益を積むことができるので

「時間の不確実性」によるリスクはあまり考慮する必要がありません(ゼロではない)。

一方で気を付けないといけないのは、その短い保有時間によって得られる利益(リワード)が

取るリスクに見合っているか？(=『リスクリワードバランス』)です。

例えば、勝率が5割程度の場合、複数回のトレードで期待値を1以上(トータルで利益が残る状態)にするには

リスクリワード比は1:2以上は確保しなくては利益が残りません。

ここで、チキン利確などを繰り返してしまい、1:1程度の比率でトレードをしても

いい所トントン、むしろスプレッド分の差で負け続けてジリ貧の損切り貧乏になってしまいます。

勝率が半々で、リスクとリワードが同等なわけですから、理論上そうなるのは当然ですよ。

このように言葉にして整理してみると、スイング・デイトレ それぞれのトレードにおいて

『トータル利益をプラスで終わらせる』為に意識しなければならないポイントが大きく変わる事が分かりますね。

このような言語化を自分の中で着実に行う事で、自分の適性に合った『型(スタイル)』を創っていく事が出来ます。

自分ならどう考えるか？どうすればストレスなくトレードができそうか？を、普段から付けているであろうトレードノートなどにも書いて

みなさんなりの『言語化』をしてみてくださいね。