

【22_128技術系メルマガ】アッチを立てるとコッチが立たず～勝率とリスクワードのバランス～

〇〇さん

こんにちは！クロガキ(クロ)です。

今日も週末、トレードから一歩引いて居られる貴重な時間です。

そんな時こそ僕は、一定数の検証をやった後は

関係ないジャンルの読書をしたり、今日のメルマガテーマとなるような自分の思考回路の整理に時間を充てます。

今日のテーマも、トレードと丁度距離を取っている今のタイミングで考えを整理しておくの良いと思う話です。

□
■ 『勝率』×『リスクワード』=『利回り』 の方程式を成り立たせるバランス

トレードにおいて『勝率』を重視するか、『リスクワード』を重視するかは

それぞれの流儀によって変わるところだと思います。

ですが、だいぶ前にツイートしたのですが

『勝率』と『リスクワード』の間にはある程度反比例の相関があります。

▼当時のツイート▼

<https://twitter.com/fxrealtradelive/status/1456204473219510280?s=20&t=0DICAcrRosdAksH2T4NhEg>

単純な話ですが『勝率』を高くしたければ、なるべく保有時間を短くするために「リワード」を抑え

かつ、損切の幅(「リスク」)を大きくすれば、結果として勝てる確率は高くなります。

ですが、これでは当然ですが、9勝1敗でも利益が残らない可能性があります。

一方で『リスクリワード比』を大きくするほど、1回の勝ちで大きく利益を得られる可能性があるの
で

「勝率」が下がったとしても、トータルの利益が残せる可能性は出てきます。

ただ、リワードを大きく求めすぎて10回トレードしても10回負けているようでは

ただの「損切貧乏」になってしまうだけで、これもまた利益が残りません。

結局どうしなければいけないのかというと、『型』でトレードの仕方に一貫性を持たせる事を前提と
して

『勝率』と『リスクリワード』のバランスを最適化する必要があります。

現状、僕の『型』においては 『勝率:60~70% リスクリワード:1:2~3』が

最適値と考えていて

大体この基準値に収まっていて、オーバートレードになっていなければ

運用が安定していると解釈しています。

〇〇さんの中では、このように自分の収益の『最適水準』を把握しているでしょうか？

これを把握するには、型を仮組みしてからのフォワードテストでパフォーマンスを確認しないとい
けません。

手間も時間も掛かる作業ですが、ここを手を抜かずにやるかやらないかで

中長期スパンでのトレードにおけるパフォーマンスの安定性に大きく影響してきます。

ある程度この基準が決まっていれば、仮に何回かのトレードの中で連敗を喫したとしても

『確率の偏り』の範疇と認識できるうちなら、手法の改善を要するかを焦って判断する必要もなく
なります。

余談ですが、勝率が7割あったとしても、状況によって2～3連敗することはあり得ます。
(逆に、4～5連勝する事も往々にしてあるということです)

「トレードを確率論的思考で行う」というのは、即ち上に挙げたような状況も受け容れて、一貫した行動を取り続けるということです。

それを、1つの結果に惑わされず同じ行動をやり続けられるようにするためにも

『勝率』と『リスクリワード』両者のバランスの最適値を把握しておくことも重要です。

これまた、一朝一夕で身につけられる話ではないので、時間を掛けて取り組まなければいけません

このような意識も、長期的に相場で戦い続けるうえでは大事な考え方になりますので、頭の片隅に置いて頂ければと思います。