

【22_223技術系メルマガ】『リスク管理』から観る『勝率とリスクリワード』

〇〇さん

こんにちは！クロガキ(クロ)です。

今日の記事は、昨日の『目線』に関する話と紐づけて
テクニカル分析をより盤石なものとするための『リスク管理』について
整理していきたいと思います。

□
└─ ■ 『リスク管理』は「資金の管理」だけではたりない
└──────────────────────────

トレードの世界では、「資金管理」が重要であることは皆さん口をそろえて言っていますし
僕もその考えには 半分賛成 です。

なぜ「半分」かという、単純にそれだけでは足りないからです。

資金管理というと、基本的な考えとしては

「自分の口座に入っている資金の 〇%以内 に収まるロットで取引する」といった決めごとを作る
ものが多いですね。

実際、それをルールとしている人も多いはずですし、僕の中にもその規格はあります。
(クロの場合、トータル資金に対して5%くらいまで)

ただここで考えないといけないのは、損失をパーセンテージで規定したとしても

そのルールを守ったことによって『トータルで稼げるのか？』を総合的に見て行かなくては行けない
という事です。

そのためには、自分のトレードの型の精度(勝率、トレード頻度、利回りの傾向)と関連付けして考える必要があります。

いくら損失幅をコントロールしてても、トレードすればするほど負ける型であれば

それは稼ぐトレードに繋がらないですからね。

この話になると今度は、「大事なのは勝率だ!」「いやリスクリワードだ!」と大論争が時々起こります(笑)

こういう話を聞くときに気を付けないといけないのは

人は「一見分かり易い答え=事実・真実」と捉えたい傾向がある と言う事です。

「これさえやればいい」

「あなたに足りないのは、あと〇〇だけ」とか

目にすると「そうなんだ!」と閃きにも似た気持ちの良い感情に心が踊ってしまいそうになります。

ですが、本当に大事なものは「要素が何か」ではなく『各要素のバランス』です。

この整合性を考えて結論を導くのは非常に難しく、時間と手間をかけて精査しないとイケません。

が、多くの方はそれを面倒だと考えるので、金目当ての発信者はその思考を利用して来るわけです。(気をつけましょうね)

さて、『リスク管理』に話を戻しますが

トレードにおけるリスク管理として押さえておくべき重要なポイントは

先に紹介した『資金管理』に加え『リスクリワードと勝率のバランス』を見る事です。
(タイトル回収、お疲れ様でした 笑)

トレードの性質上、当然のことですが

リスクリワードと勝率というのは、逆の相関を取るものです。

omukuroファームの分科会まとめ役をやってくれている、仲間のチュパさんが先日分かり易いツイートをしてくれました。

▼仲間(チュパさん)のツイート▼

<https://twitter.com/chupa0224/status/1551393785254641664?s=20&t=G9W4QeCmPmHE5IPQ1coIA>

単純な話、勝率を追い求めるとリスクリワードは悪くなる

一方、リスクリワードを大きくするほど、利確できる確率が減るので、勝率が下がる。

これは、どちらが良い悪いという話ではなく

自分の型の性質、自分の生活スタイル、負けに対するストレスの感じ方の違いなど

思いつく要素を総合的にみて『自分にとってベストなバランス』を決め、ルール化する事で

『トレード全体のリスク管理』を考慮したトレードスタイルを確立出来るのです。

ちなみに、今現在の僕のトレードスタイルは

リスクリワード1:2~3を徹底して、勝率6~7割のトレード

1回に負うリスクは5%程度としたうえで、ロンドン初動~NY時間にトレードすることとし

最近は朝活のエントリーは抑えています(ここ3カ月の成績が悪かったため)。

こうすると、1日のトレード回数は精々1~2回。今週はまだ2回くらいしかトレードしていませんが

恐らく月の利回りは少なくとも30%は行くだらうと見えています。

結局、『リスク管理』というのも、要素を整理してルール化してしまえば

あとは決まっている事なのでいちいち考える事もしません。

最終的にトレードの収益がプラスになって終わることが重要なので

そのためにはどの要素のバランスをとって、ルール化していけばいいのかをしっかりと理解しておきましょう。

その要素の整理を行うのも、検証母数を集める大事な目的のひとつと言えます。

この辺については、また別のテーマでも深掘りしていきますね。