

【22_272技術系メルマガ】『損切幅』と『リスクリワード』の話

〇〇さん

こんにちは！クロガキ(クロ)です。

さて、ここ数日『技術系』カテゴリが連続していて恐縮ですが、、、

今回も最近いただいた質問の中から、結構重要度の高いテーマを持ってきました。

特に今日の話は、多くの方が一度は考えたことがあるけども

それに対して深く自分の行動(トレード)に落とし込むことまではしていない内容かもしれません。

ですが、これが『本当の意味でのリスクリワードへの意識』であり『リスク管理』の根幹をなす大事なポイント。

そして、ここを意識するかしないかで、自分が相場で行き残り“続けられる”確率が大きく変わると言っても過言ではありません。

是非、これを機に自分はどうか？と考えてみてください。

では、前置きが長くなりましたが本題へ行きましょう。

□
└─ ■ なぜ、僕は『損切幅を小さくしたい』のか？
└──────────────────┘

今回のテーマも、メルマガ読者の方からの質問がベースになっています。

内容を要約したので、先に読んでみてください。

～～

フツとわいた疑問なのですが、ここ数日のようにボラが高い

例えばSLがいつもなら15~20程度のSLが40~50pなどだった場合

自分パターンがきたとしても見送りますか？

それとも1:3確保できるならエントリーしますか？

私は迷ってしまって入れません。

クロさんはどうなんだろうとどうしても知りたくなってしまいました。

~~

これに対しては、いろんな考え方があると思います。

例えば、リスクリワードのバランスだけを考えるなら

仮に損切幅が20pipsあったとしても、「結果として60pips利確できればいいじゃない」という考えもあるし

それ自体は、リスクリワードをルールとしているのであれば「理屈としては」間違っていないと思います。

それでも僕は、今ではそのようなトレードはやっていません。

なぜかという、それでは『リスク“金額”が自分の許容範囲を超えてしまう』からです。

以前どこかでも何度か話したことがあります、僕が1回のトレードで許容する損失は

『元金に対して5%程度まで』としています。

その枠内に収まるように損切のpips幅を極力小さくし、最大限のロットを張って一撃必殺のトレードをする。

そして、ここがポイントになるのですが

リスクの幅を小さくすることによって『相対的なリワード値』も小さくなるので

その分早く利確できるので、エントリーの精度次第では勝てる確率が上がり、ポジションの保有時間も最小限に抑えることができます。

この違い、言葉だけだと分かりづらいので簡単な図を作りました。

▼損切幅を小さくするか、大きくするかの違い(画像)▼

https://kuro-gaki.com/muhai_saisoku/others/2022-09-29.png

このへんも、トレードにおいて何を自分が一番重視するかで基準は変わってきますが

僕が最も重視している『損は極力小さくする』という基準に沿って考えれば

『損切幅をなるべく小さくし、相対的なリワード幅が大きくなりすぎないようにする』事で

保有時間の短いデイトレを 回転効率良く 実行できます。

それによって、回数を重ねるほどトータルの利益が残るルールで運用できていれば

1回1回トレードの結果に一喜一憂することもなく、楽な気持ちで取り組めるようになるのです。

同じ『リスクリワード』を意識するのでも『絶対的な損切幅』に対する許容範囲を決めておかないと

際限なく大きな損切を置きながら「現実的なボラから乖離したリワード」を狙わなくてはいけなくなり、それでは当然ながら勝ちが残らず負け続けることになります。

例えば、日足ベースのローソク足実体で100pips動くかどうかといった通貨(例えばオージードルなどの資源国通貨)で

1回の短期デイトレで60pips狙いに行くのが、現実的なリワードと言えるでしょうか？

僕ならまずやりません(笑)

こういった考えも、検証だけでなく実チャートでのフォワードテストで調整をしながら

『自分にとって最適な損切幅』を規定することで、併せてリスクリワードのバランスを考慮した運用を行うのが

最も手堅く、地に足着いた方法であると思います。