

【22_319技術系メルマガ】リスクリワードの非実用性

〇〇さん

こんにちは！クロガキ(クロ)です。

トレードで『トータルの勝ち』を得るために必要な要素として

僕が常々意識しているのは、『勝率』と『リスクリワード』のバランスを考慮した

一貫性のあるトレードルールです。

ただ、この『リスクリワード』というのなかなかクセモノで、捉え方を間違えると全然勝てないトレードルールになってしまいます。

今日のメルマガでは、そんな「意外とやっぺりしまいがち」な実用的でないリスクリワードの考え方から脱却し

使える技術に変える考え方を整理したいと思います。

リスクリワード比というのは、殆どの方がご存じだと思いますが一応説明しておく

例えば 10pipsの損切幅(リスク)に対して30pipsの利益(リワード)を取るならば

『リスクリワード比 1:3 のトレード』という事になります。

ちなみに、これもちょっと考えると分かることなのですが

『勝率』と『リスクリワード』というのは逆相関の関係にあります。

要は『リスクリワード比』を大きくする(取るリスクに対して求めるリワードを大きくする)ほど、『勝率』は下がるし

逆に『勝率』を上げようとするほど『リスクリワード比』は1:1に近づく傾向があります。

トレードは、これまでに繰り返し伝えているように、1回1回の勝ち負けを積み重ねた結果として

『トータルの利益をプラスにすること』が目的となるので

両者のバランスのベストを探るのも、自分の型を作るうえで重要となるわけです。

僕の場合、現状の型における最適条件として考えているのが

『勝率60%程度』『リスクリワード比1:2~3』となっています。

ここでもう一つ考えておきたいのは、リスクリワード比の中に収める『実際の損切 / 利確幅』です。

どういう意味か。

同じ『リスクリワード 1:3』で考えるとしても

- ① 損切幅10pipsに対し、利確幅30pips
- ② 損切幅30pipsに対し、利確幅90pips

これらは、実質どちらも同じ『リスクリワード比 1:3』には違いありませんが

両者の条件でそれぞれ実際にトレードをしてみると、勝率も利回りも大きく変わってきます。

仮に、あまりボラが出ない相場において、②の条件でトレードしたとしても

ほとんどのポジションは利確できずに損切を量産してしまうかもしれません。

つまり、「現実的でない利幅を狙っているのに気づかず、リスクリワードの数字だけを追う」のではダメだということです。

この点に気づいて、僕にメールを送ってくださった方がいるので

その方の本文を一部ご紹介します。

▼本文引用はコチラ▼

https://kuro-gaki.com/muhai_saisoku/others/2022-11-12.png

この方が検証されているように、自分が取引する通貨ペアにおいて

そもそも自分の狙っている利幅が取れるほど、ボラが出ているのか？も考慮して

自分の取るリスクと狙うリワードのバランスを考えないと

結局『勝率』とのバランスが取れずに勝てないルールになってしまうこともあり得るのです。

今自分が作ろうとしている型・トレードルールにおけるトレードのサイズをよく考えて

繰り返し実践できるルールとしての『リスクリワードの最適バランス』を決めるようにしてみてください。