

【22_330技術系メルマガ】ベストなリスクリワードバランスの求め方

〇〇さん

こんにちは！クロガキ(クロ)です。

今回もフォームにリクエストしてくれた方の質問を一つテーマとしてピックアップします。

▼質問はコチラ▼

https://kuro-gaki.com/muhai_saisoku/others/2022-11-27.png

僕が、トレードするときに何故リスクリワード『1:2~3』という数字にしたのか？

それ以上大きい(小さい)と何か問題なのか？

気になっている人も結構多かったのかもしれない。

そこで今回は、僕が何故トレードルールを決める際に、リスクリワードバランスがこの数字に至ったのかを解説します。

□
■ ベストバランスは『トレードの規模』と『現実的な値動き幅』で決まる

この辺は、言葉にしてみると「あたりまえ」に聞こえる話かもしれないのですが

まず、どれだけのリワードを取りに行くかは

・自分が普段のエントリーで許容するリスクの幅(損切幅)

と

・狙う波のサイズ(目安として、デイトレならH1足の1波、セミスイングならH4足の1波くらい)

で決まります。

また、その決めたサイズでトレードするにあたって、自分が狙う波のサイズが『通常どの程度の値動き幅』なのか？

これは、過去チャートの検証で傾向を捉えることではじめて分かるポイントです。

僕の場合、ロンドン初動に的を絞った短期デイトレであり、欧州通貨を中心にトレードすると決め

そのあたりを集中的に検証した結果として

- ・普段のエントリーで許容する損切幅は『8～12pips』

- ・ロンドン初動の1～2時間では、欧州通貨の平均的な変動幅は30～50pipsくらい

と、現時点で認識しています(これは定期的に確認する)。

その結果に基づいて、僕は1トレードあたりに狙うリワード幅は20～30pips程度が適当であると判断し

そこからリスクリワードバランス『1:2～3』としたのです。

従って、これは現状の傾向から決めている数字なので、今後収益の変動などを確認して傾向が変わってくれば

それに応じてバランスのルールも微妙に調整される可能性はあります。

「決めたら終わり」ではなく、常日頃の検証、振り返りによって『あくまで相場に合わせて調整する』意識を持つことが重要です。