

【23_230技術系メルマガ】損切幅とリスクリワードの関係

〇〇さん

こんにちは、クロです。

今日の話は、多くの人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といえます。

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、本題です。

「■ なぜ、僕は『損切幅を小さくしたい』のか？」

まず、皆さんにひとつ問いかけをしたいと思います。

～～

・10pipsの損切幅で30pipsのリワードを狙うトレード

・30pipsの損切幅で90pipsのリワードを狙うトレード

これらはリスクリワード1:3を狙うという意味では同じトレードと言えますが

どちらか一貫してやるとしたら、あなたはどちらを選びますか？

～～

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。