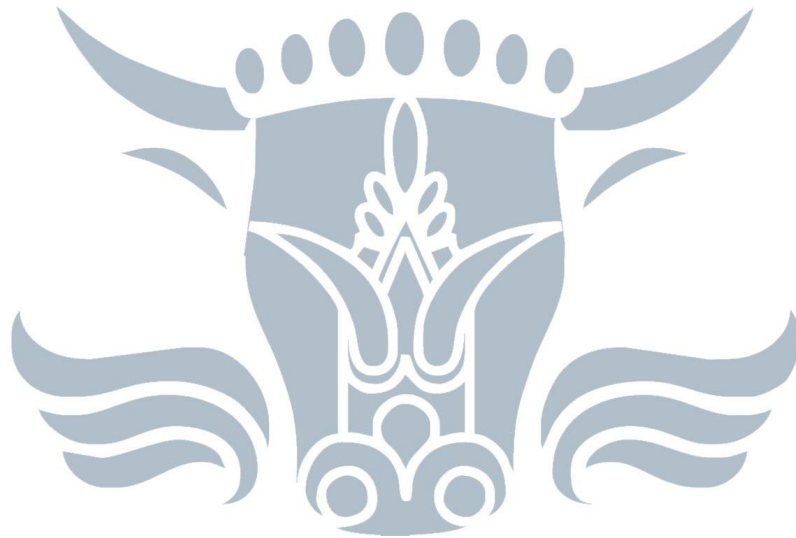


مجموعه مقالات و آموزش های معامله گری

آشنایی با نسبت توقع یا Expectancy استراتژی



ایران بورس آنلاین

IranBourseOnline.co

.....
برای افتتاح حساب، واریز و برداشت ریالی و یا استفاده از منابع آموزشی و تحلیلی رایگان و فارسی روی آدرس
وب سایت ایران بورس آنلاین کلیک کنید و یا به پیج ما در شبکه های اجتماعی سر بزنید!

کانال یوتیوب: IranBourseOnline

وب سایت: iranbourseonline.co

کانال آپارات: IranBourseOnline

کانال تلگرام: IBOChannel

اینستاگرام: iran_bourse_online

پشتیبانی تلگرام: IranBourseOnline

آشنایی با نسبت توقع یا Expectancy استراتژی

معامله گران باید درک درست و واقعی از انتظارات خود داشته باشند و بدانند که اگر قرار باشد سود کنند، این سود تقریباً چقدر خواهد بود؟ به احتمال زیاد بسیاری از معامله گران فارکس، سهام یا حتی رمزارزها نمی‌دانند که بازدهی و یا ضرر احتمالی سیستم معاملاتی آنها چند است؟ همه می‌خواهند سود کنند، اما کسی نمی‌داند که سیستم معاملاتی آنها چقدر می‌تواند بازدهی داشته باشد.

در واقع همه معامله گران به معامله‌ای که باز است یا می‌خواهند واردش شوند تمرکز می‌کنند و کسی با برآیند معاملات کاری ندارد. اگر می‌خواهید حرفه‌ای معامله کنید، حتماً این مقاله را تا انتها مطالعه کنید. در این مقاله با نسبت توقع آشنا خواهید شد.

فهرست مطالب

- معاملات تصادفی
- هزینه کسب و کار معامله‌گری چقدر است؟
- نسبت توقع یا Expectancy چیست؟
- نسبت توقع به چه دردی می‌خورد؟

برای افتتاح حساب، واریز و برداشت ریالی و یا استفاده از منابع آموزشی و تحلیلی رایگان و فارسی روی آدرس وب سایت ایران بورس آنلاین کلیک کنید و یا به پیج ما در شبکه های اجتماعی سر بزنید!

کانال یوتیوب: IranBourseOnline

وب سایت: iranbourseonline.co

کانال آپارات: IranBourseOnline

کانال تلگرام: IBOChannel

اینستاگرام: iran_bourse_online

پشتیبانی تلگرام: IranBourseOnline

معاملات تصادفی

اکثر معامله گران به طور تصادفی معامله می‌کنند و به نتایج تصادفی هم اهمیت می‌دهند! این گروه از معامله گران به دنبال فرصت هستند و صرفاً می‌خواهند در بازار حضور داشته باشند. این گروه معمولاً به گونه‌ای معامله می‌کنند که انگار هر چه پیش آید خوش آید! معمولاً آن‌ها بعد از مدتی آوارگی در بازار، با زیان و ناامیدی از حرفه معامله‌گری دست می‌کشند.

هزینه کسب‌وکار معامله‌گری چقدر است؟

شاید فکر کنید که خرید کامپیوتر یا دوره‌های آموزشی همان هزینه حرفه معامله‌گری است. این دیدگاه اشتباهی است. در حرفه معامله‌گری شما از استراتژی و سیستم‌های معاملاتی استفاده می‌کنید که برای خود هزینه‌های جداگانه‌ای دارند. منظور هزینه خرید یا ساخت استراتژی نیست. شما وقتی از استراتژی استفاده می‌کنید، برخی از معاملات در زیان بسته خواهند شد.

مجموع زیان‌های معاملاتی که به دلیل استفاده از استراتژی متحمل می‌شوید، همان هزینه استراتژی است. اگر تا به امروز به این نکته توجه نکرده بودید، به احتمال زیاد شما هم جزو معامله‌گرانی هستید که بیشتر روی معامله‌ای که باز است تمرکز دارید و به فکر فردا نیستید! و از همه مهم‌تر دید بلندمدتی به حرفه معامله‌گری ندارید.

.....
برای افتتاح حساب، واریز و برداشت ریالی و یا استفاده از منابع آموزشی و تحلیلی رایگان و فارسی روی آدرس وب سایت ایران بورس آنلاین کلیک کنید و یا به پیج ما در شبکه های اجتماعی سر بزنید!

کانال یوتیوب: [IranBourseOnline](https://www.IranBourseOnline.com)

وب سایت: [iranbourseonline.co](https://www.IranBourseOnline.com)

کانال آپارات: [IranBourseOnline](https://www.IranBourseOnline.com)

کانال تلگرام: [IBOChannel](https://www.IBOChannel.com)

اینستاگرام: [iran_bourse_online](https://www.IranBourseOnline.com)

پشتیبانی تلگرام: [IranBourseOnline](https://www.IranBourseOnline.com)

نسبت توقع یا Expectancy چیست؟

توقع از استراتژی معاملاتی یک پارامتر مهم و تأثیرگذار در کسب و کار شماست! توقعی که از سیستم معاملاتی دارید، همان روابط بلندمدتی است که بین سود، زیان، معامله برنده و معامله بازنده حاکم است. توقعی که از سیستم معاملاتی دارید نشان می‌دهد که معاملات شما چقدر بازدهی و یا زیان خواهند داشت.

ما در این مقاله سعی می‌کنیم تا در ۳ قدم توقعی که از سیستم معاملاتی دارید را محاسبه کنیم. اول سعی می‌کنیم نسبت‌های معاملات برنده و بازنده را محاسبه کنیم. در قدم دوم نسبت ریسک به ریوارد را محاسبه می‌کنیم و در نهایت هم با ترکیب این دو عدد، نسبت توقع سیستم را به دست می‌آوریم. به کمک نسبت توقع هم می‌توانیم انتظارمان از آینده سیستم معاملاتی را شکل دهیم.

نسبت‌های معاملات برنده و بازنده (وین ریت و لوز ریت)

محاسباتی که در این مقاله استفاده می‌شوند خیلی ساده و روان هستند. اول لیست تمام معاملاتی که انجام داده‌اید را آماده کنید. تعداد کل معاملات انجام شده را به دست آورید. حال معاملاتی که برنده بوده‌اند، یعنی به حد سود رسیده‌اند و یا در سود بسته شده‌اند را بشمارید. عدد به دست آمده را بر کل تعداد معاملات تقسیم کنید.

.....
برای افتتاح حساب، واریز و برداشت ریالی و یا استفاده از منابع آموزشی و تحلیلی رایگان و فارسی روی آدرس وب سایت ایران بورس آنلاین کلیک کنید و یا به پیج ما در شبکه های اجتماعی سر بزنید!

کانال یوتیوب: [IranBourseOnline](https://www.IranBourseOnline.com)

وب سایت: [iranbourseonline.co](https://www.IranBourseOnline.com)

کانال آپارات: [IranBourseOnline](https://www.IranBourseOnline.com)

کانال تلگرام: [IBOChannel](https://www.IBOChannel.com)

اینستاگرام: [iran_bourse_online](https://www.IranBourseOnline.com)

پشتیبانی تلگرام: [IranBourseOnline](https://www.IranBourseOnline.com)

تعداد معاملات برنده یا سود ده

نسبت معاملات برنده یا وین ریت (Win Rate):

تعداد کل معاملات انجام شده

فرمول وین ریت

به طور مثال اگر ۵۰ معامله انجام داده‌اید و ۱۵ معامله به حد سود خورده‌اند، کافی است ۱۵ را بر ۵۰ تقسیم کنید. عدد به دست آمده همان نسبت معاملات برنده یا وین ریت است (در اینجا می‌شود ۰/۳ یا اگر ضرب در صد کنید می‌شود ۳۰ درصد). پس سیستم معاملاتی شما در تمام ۵۰ معامله‌ای که انجام داده‌اید در ۳۰ درصد مواقع برنده بوده و در ۷۰ درصد باقی مانده بازنده (لوز ریت).

نسبت ریسک به ریوارد

محاسبه نسبت ریسک به ریوارد هم ساده است. سود تمامی معاملات برنده را با هم جمع کنید و بر تعداد معاملات برنده تقسیم کنید. با این کار متوسط بازدهی معاملات به دست می‌آید. سپس زیان تمام معاملات بازنده را جمع بزنید و بر تعداد کل معاملات بازنده تقسیم کنید تا متوسط زیان معاملات مشخص شود.

مجموع سود معاملات برنده

متوسط سود معاملات برنده:

کل تعداد معاملات برنده

فرمول محاسبه متوسط سود هر معامله

برای افتتاح حساب، واریز و برداشت ریالی و یا استفاده از منابع آموزشی و تحلیلی رایگان و فارسی روی آدرس وب سایت ایران بورس آنلاین کلیک کنید و یا به پیج ما در شبکه های اجتماعی سر بزنید!

کانال یوتیوب: IranBourseOnline

وب سایت: iranbourseonline.co

کانال آپارات: IranBourseOnline

کانال تلگرام: IBOChannel

اینستاگرام: iran_bourse_online

پشتیبانی تلگرام: IranBourseOnline

متوسط زیان هر معامله بازنده: $\frac{\text{مجموع زیان معاملات}}{\text{کل تعداد معاملات بازنده}}$

فرمول محاسبه متوسط زیان هر معامله

حال کافی است متوسط سود معاملات را بر زیان معاملات تقسیم کنید تا نسبت ریسک به ریوارد به دست آید.

نسبت ریسک به ریوارد: $\frac{\text{متوسط سود هر معامله}}{\text{متوسط زیان هر معامله}}$

فرمول محاسبه نسبت ریسک به ریوارد

به طور مثال اگر متوسط سود در هر معامله ۵۰۰ دلار و متوسط زیان هر معامله بازنده ۱۰۰ دلار باشد، نسبت ریسک به ریوارد می‌شود ۵/ یعنی سود معاملات برنده ۵ برابر زیان معاملات بازنده است.

نسبت توقع یا Expectancy ratio

حال می‌توانیم نسبت توقع سیستم معاملاتی را محاسبه کنیم. خیلی ساده نسبت ریسک به ریوارد را به وین ریت ضرب می‌کنیم. سپس نسبت معاملات بازنده را از آن کم می‌کنیم و عدد به دست آمده همان نسبت توقع است.

برای افتتاح حساب، واریز و برداشت ریالی و یا استفاده از منابع آموزشی و تحلیلی رایگان و فارسی روی آدرس وب سایت ایران بورس آنلاین کلیک کنید و یا به پیج ما در شبکه های اجتماعی سر بزنید!

کانال یوتیوب: IranBourseOnline

وب سایت: iranbourseonline.co

کانال آپارات: IranBourseOnline

کانال تلگرام: IBOChannel

اینستاگرام: iran_bourse_online

پشتیبانی تلگرام: IranBourseOnline

نسبت توقع:

نسبت معاملات بازنده - (نسبت ریسک به ریوارد * وین ریت)

فرمول محاسبه نسبت توقع

در مثال‌های بالا نسبت ریسک به ریوارد برابر ۵ و وین ریت هم ۳۰ درصد بود. پس ۵ ضرب در ۳۰ درصد می‌شود، ۱۵۰ درصد. حال اگر ۷۰ درصد یا لوز ریت را از آن کم کنیم، می‌شود ۸۰ درصد یا $0/80$ این همان نسبت توقع است. یعنی استراتژی که از آن استفاده می‌کنید، به طور متوسط بازدهی آن $0/80$ برابر زیان‌های تحقق یافته است. شما با مقایسه نسبت توقع سایر استراتژی‌های می‌توانید بهتر در رابطه با انتخاب آن‌ها تصمیم‌گیری کنید. به یاد داشته باشید که نسبت توقع بالای صفر قابل قبول است و اعداد منفی به معنی زیان ده بودن آن است.

شما می‌توانید نسبت توقع را از فرمول دیگری هم به دست آورید. کافی است وین ریت را در سود متوسط معاملات ضرب کنید و سپس حاصل ضرب لوز ریت در متوسط زیان معاملات را از آن کم کنید.

نسبت توقع:

نسبت معاملات بازنده - (نسبت ریسک به ریوارد * وین ریت)

فرمول دیگری برای محاسبه نسبت توقع

در مثال بالایی، وین ریت ۳۰ درصد و سود متوسط هم ۵۰۰ دلار بود. لوز ریت یا نسبت معاملات بازنده ۷۰ درصد و زیان متوسط هم ۱۰۰ دلار بود. پس $(100 * 0/7) - (500 * 0/3)$ می‌شود: $0/8$ یا ۸۰ درصد.

برای افتتاح حساب، واریز و برداشت ریالی و یا استفاده از منابع آموزشی و تحلیلی رایگان و فارسی روی آدرس وب سایت ایران بورس آنلاین کلیک کنید و یا به پیج ما در شبکه‌های اجتماعی سر بزنید!

کانال یوتیوب: [IranBourseOnline](https://www.IranBourseOnline.com)

وب سایت: [iranbourseonline.co](https://www.IranBourseOnline.com)

کانال آپارات: [IranBourseOnline](https://www.IranBourseOnline.com)

کانال تلگرام: [IBOChannel](https://www.IBOChannel.com)

اینستاگرام: [iran_bourse_online](https://www.IranBourseOnline.com)

پشتیبانی تلگرام: [IranBourseOnline](https://www.IranBourseOnline.com)

نسبت توقع به چه دردی می خورد؟

- نسبت توقع نشان می دهد که سود معمول هر معامله ای که انجام می شود تقریباً چقدر خواهد بود؟ اعداد مثبت نشانگر سود هستند. اما اگر این عدد منفی باشد، به معنی زیان ده بودن استراتژی است.
- نسبت توقع استراتژی تنها برای مجموع معاملات مناسب است. یعنی باید تعداد معاملات زیاد باشد تا بتوان از این نسبت استفاده کرد. معمولاً نسبت توقع برای تعداد معاملات بالای ۵۰ عدد مناسب است.
- در طول زمان شاید نسبت توقع تغییر کند. به هر حال این ذات بازار است که هر لحظه در حال تغییر است و انتظارات ما هم با آن تغییر می کند. تغییر در نسبت توقع معاملات می تواند به ما کمک کند تا دید و درک بهتری از عملکرد خود داشته باشیم.
- اگر میزان سودآوری معاملاتی که انجام می دهید با نسبت توقع همخوانی نداشته باشد، به احتمال زیاد یا شرایط بازار به طور کلی تغییر کرده و یا شما در پیاده سازی استراتژی معاملاتی ضعیف عمل کرده اید. در هر صورت بایستی در عملکرد خود تجدید نظر کنید.
- اگر نسبت توقع معاملات در حال بهبود و ارتقا است، بایستی خیلی فوری علت آن را پیدا کنید. عاملی که باعث چنین بهبودی در عملکرد شما شده مهم است.

IranBourseOnline.co

برای افتتاح حساب، واریز و برداشت ریالی و یا استفاده از منابع آموزشی و تحلیلی رایگان و فارسی روی آدرس وب سایت ایران بورس آنلاین کلیک کنید و یا به پیج ما در شبکه های اجتماعی سر بزنید!

کانال یوتیوب: IranBourseOnline

وب سایت: iranbourseonline.co

کانال آپارات: IranBourseOnline

کانال تلگرام: IBOChannel

اینستاگرام: iran_bourse_online

پشتیبانی تلگرام: IranBourseOnline