

Как правильно рассчитать вероятность выигрыша

При выставлении очередного лота на рынке Forex важно понимать, с какой вероятностью может быть достигнут выигрыш и проигрыш. Это поможет более объективно оценивать свои шансы и точнее задавать диапазоны срабатывания TakeProfit и StopLoss.

Предположим, что Выставляете новый ордер на покупку по некоторой (не важно какой) валютной паре. При этом, опытный трейдер, как правило, устанавливает границы срабатывания данного ордера при выигрыше TakeProfit и при проигрыше StopLoss. Схематично данная ситуация показана ниже на рисунке.

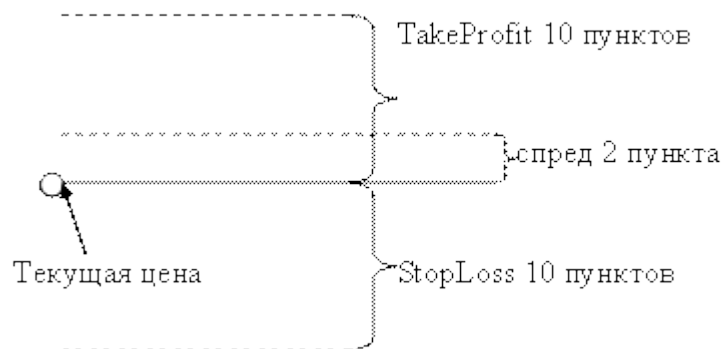


Рис. 1

Здесь спред в 2 пункта – это комиссия, которая берется дилинговым центром, при выставлении ордера. Для разных валютных пар она разная, но в качестве примера была взята эта величина как наиболее часто используемая при торговле.

Теперь зададимся вопросом: с какой вероятностью тренд в будущем достигнет уровня TakeProfit? Для ответа на этот вопрос необходимо знать модель (закон изменения) графиков валютных пар на рынке Forex. Если принять модель тренда, рассмотренную [здесь](#) (* равновероятную), то окажется, что вероятность достижения уровней TakeProfit и StopLoss, отображенных на рисунке, одинакова и равна 0,5. То есть, в половине случаев будет достигнута верхняя граница и в половине – нижняя. Но, учитывая величину спреда в 2 пункта, выигрыш составит 8 пунктов, а проигрыш – 10 пунктов. В итоге, в среднем, трейдер будет терять деньги, если не сможет построить прогноз движения тренда с вероятностью более 0,5 (50%). Или же применить стратегию, которая сможет компенсировать возможные проигрышы.

Если в представленном примере поднять уровень TakeProfit на 2 пункта и сделать его величиной в 12 пунктов от цены ордера, тогда величина выигрыша и проигрыша будет одинаковой и равна 10 пунктам (рис. 2). Но что станет с величинами вероятностей достижения этих границ?

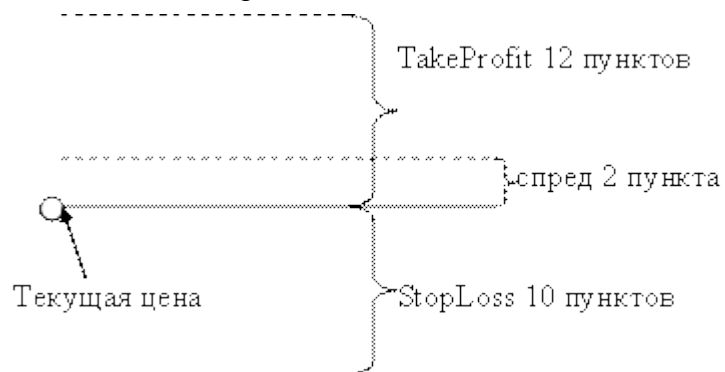


Рис. 2

Так как расстояние в 12 пунктов больше расстояния в 10 пунктов, то тренд, в соответствии с выбранной моделью, чаще будет достигать границы StopLoss и в процентном отношении это составит величину:

$$10/(12+10)*100\% = 45,45\%$$

То есть, в 45% случаев будет достигаться граница TakeProfit, а в $100-45=55\%$ случаях – граница StopLoss. Тогда, в среднем, трейдер будет зарабатывать

$$0,4545*10-0,5455*10=-0,91 \text{ пункт.}$$

Этот пример показывает, что при увеличении значений TakeProfit и StopLoss величина спреда в меньшей степени оказывает влияние на суммарную величину заработка трейдера. Так, в первом случае она составляла -1 пункта, а во втором, -0,91 пункта. К сожалению, свести эту величину к нулю или сделать положительной – невозможно простым изменением границ TakeProfit и StopLoss, но Вы можете их выбрать такими, чтобы обеспечить желаемую (разумную) вероятность их достижения, минимизируя возможный средний проигрыш.

Ссылка на первоисточник: <http://sernam.ru/forex.php>