SF EDUCATION
все об аналитике, финансах и бизнесе

SF Education

Математическое ожидание

Спикер: Александр Рябинин

SF EDUCATION
все об аналитике, финансах и бизнесе

Вводная

Сегодня мы рассмотрим, что такое математическое ожидание, вспомним про риск-менеджмент и посмотрим как их анализировать на практике.

SF EDUCATION
все об аналитике, финансах и бизнесе

Математическое ожидание

Математическое ожидание - каков процент прибыльных сделок по отношению к убыточным вы совершаете. Разберем на примере:

У вас 10 сделок. 3 убыточных и 7 положительных.

Значит ваше матожидание = 70%. То есть мы можем прогнозировать, что ТС продолжит поддерживать это значение. И на основе этого понимать свою ТС и риски.



SF EDUCATION
все об аналитике, финансах и бизнесе

Риск-менеджмент

Это уже соотношение риска к прибыли.

Допустим, вы открываете позицию и сразу выставляете по своей ТС, СЛ и ТП.

Стоп-лосс у нас будет 2%, а тейк-профит 6%.

Соответственно, наш риск менеджмент составляет 1 к 3. То есть одна прибыльная сделка может перекрыть 3 убыточные сделки.

А теперь давайте их попробуем соединить на практике и посмотрим, как это работает на самом деле.

Контакты



sf.education

https://t.me/sf_education

sf_education

https://seekingalpha.com/author/societe-financiers

https://vk.com/sfeducation

https://www.facebook.com/sfeducationru

https://www.youtube.com/c/SFEducationnew