

آیا بدون اینکه بدانید دارید ریسک خود را دو برابر می کنید؟



در مقاله امروز از مجموعه مقالات **آموزش فارکس**، از ریسک ها و خطرات نهفته در معامله چندین جفت ارز بصورت همزمان با شما خواهیم گفت!  
زمانیکه چندین جفت ارز را همزمان در حساب معاملاتی خود معامله می کنید، همیشه اطمینان حاصل کنید که از پهنه ی ریسک خود (میزان ریسکی که خود را در معرض آن قرار داده اید) آگاه هستید.

به عنوان مثال، بیشتر اوقات، معامله AUD/USD و NZD/USD اساساً همچون باز کردن دو معامله یکسان است زیرا آنها معمولاً همبستگی مثبتی دارند.

شاید فکر کنید که با معامله زدن روی جفت ارزهای مختلف، دارید ریسک خود را پخش می کنید یا به معاملات خود تنوع می بخشید، اما بسیاری از جفت ارزها معمولاً هم جهت با هم حرکت کنند.

بنابراین به جای پایین آوردن ریسک، دارید ریسک خود را بزرگتر می کنید! در واقع ناآگاهانه، دارید خود را در معرض ریسک بیشتری قرار می دهید.

به چنین حالتی مواجهه ی بیش از حد با ریسک گویند.

بیاید مثالی را مرور کنیم که در آن دو جفت ارز در یک دوره یک هفته‌ای همبستگی بسیار بالا دارند. این دو جفت ارز عبارتند از: **EUR/USD** و **GBP/USD**

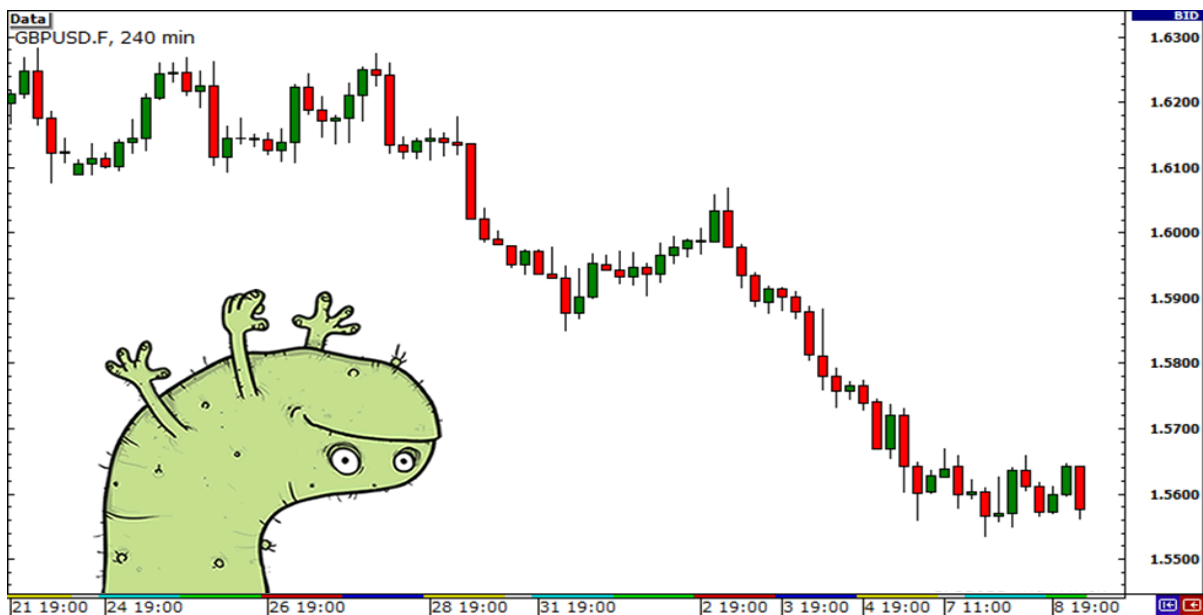
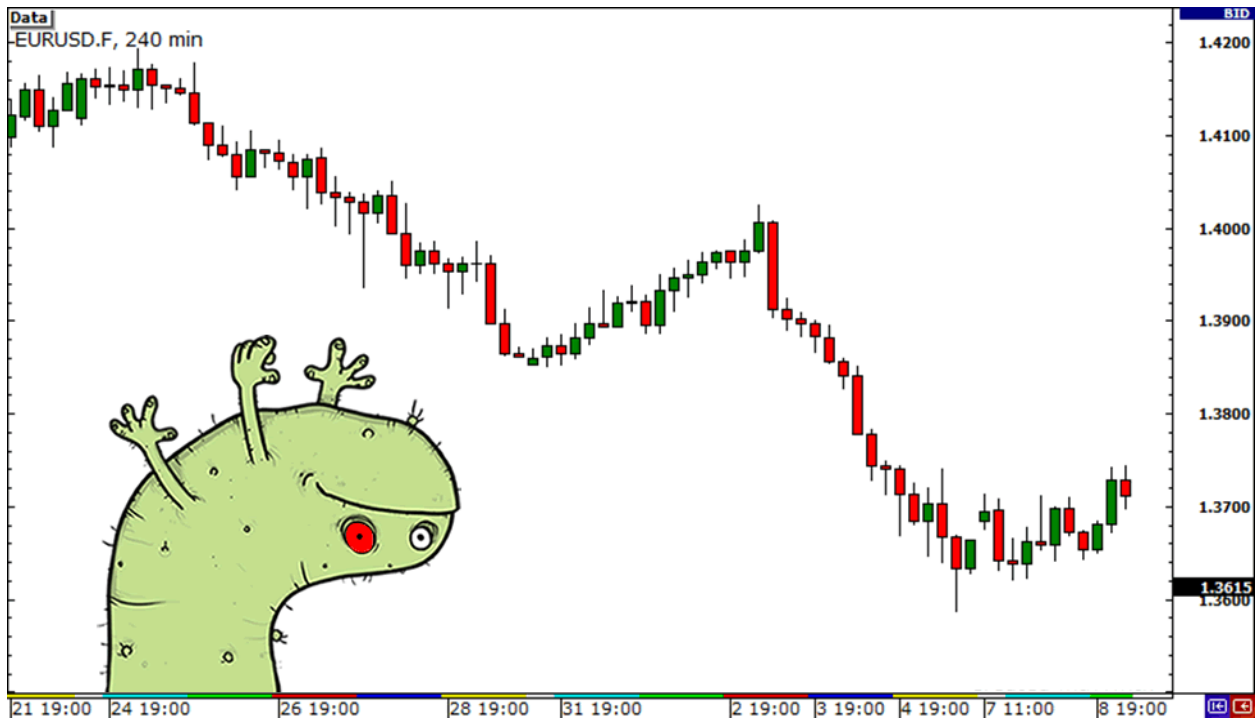
	EUR/USD	USD/JPY	USD/CHF	GBP/USD	USD/CAD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
۱ هفته	-0.23	-1.00	0.94	-0.98	0.98	0.93	0.93	0.86	
۱ ماه	0.63	-0.98	0.13	-0.90	0.90	0.96	0.91	0.86	
۳ ماه	-0.62	-0.92	0.83	0.14	0.63	0.42	0.61	0.75	
۶ ماه	-0.62	-0.85	0.31	-0.35	0.61	0.65	0.28	0.71	
۱ سال	-0.69	-0.98	0.88	-0.93	0.95	0.96	0.66	0.02	

بر اساس جدول بالا، با توجه به ضریب همبستگی جذاب **0.94**، بدیهی است که همبستگی بالایی بین این دو جفت ارز وجود دارد. می توانیم بگوییم **EUR/USD** کره بادام زمینی روی حلوا شکری **GBP/USD** است.

نکته مهم این است که این دو جفت ارز مثل مسابقات قایق رانی دو نفره با هم و همزمان پارو می زنند.

## مثال شماره 1 از همبستگی ارزی: EUR/USD و GBP/USD

برای اینکه به شما ثابت کنیم که ارقام دروغ نمی گویند، در زیر نمودارهای 4 ساعته این دو جفت ارز ارائه می گردد. دقت کنید که چگونه هر دو جفت ارز هم جهت حرکت کردند... یعنی نزولی.



با توجه به موضوع درس امروز یعنی ریسک، می‌بینیم که باز کردن یک پوزیشن روی هر دو جفت ارز EUR/USD و GBP/USD مانند دو برابر کردن یکی از پوزیشن هاست.

به عنوان مثال، اگر شما 1 لات یورو/دلار و 1 لات پوند/دلار خرید زدید، اساساً انگار 2 لات یورو/دلار خرید زده اید، زیرا به هر حال هر دو جفت ارز یورو/دلار و پوند/دلار هم‌جهت با هم حرکت می‌کنند.

به عبارت دیگر، شما دارید ریسک خود را افزایش می‌دهید. و اگر هم EUR/USD و هم GBP/USD بخرید، دو بار شانس اشتباه کردن را برای خود ایجاد نمی‌کنید! فقط و فقط یک شانس برای خود ایجاد کرده اید زیرا اگر EUR/USD ریزش کند و استاپ شما بخورد، GBP/USD نیز به احتمال زیاد ریزش می‌کند و شما را باز هم استاپ اوت می‌کند (یا برعکس).

شما همچنین نباید همزمان EUR/USD بخرید و GBP/USD را بفروشید زیرا اگر EUR/USD به پرواز درآید، احتمالاً GBP/USD نیز به پرواز در می‌آید و در چنین حالتی چه خواهد شد؟

اگر فکر می‌کنید سود یا زیان شما همیشه صفر خواهد بود، بدانید در اشتباه هستید ارزش‌های پیپ در EUR/USD و GBP/USD متفاوت است و فقط به این دلیل که دو جفت ارز همبستگی بالایی با هم دارند به این معنی نیست که همیشه آنها دقیقاً به یک مقدار پیپ با هم نوسان می‌کنند.

**نوسانات در داخل جفت ارزها ثابت نیستند.**

EUR/USD می‌تواند 200 پیپ بالا رود، در حالی که GBP/USD تنها 190 پیپ افزایش یابد. اگر این اتفاق بیفتد، ضررهای حاصل از معامله پوند/دلار شما (به دلیل

پوزیشن فروش)، اگر همه سود را خنثی نکند، بیشتر سود حاصل از معامله یورو/دلار شما را از بین خواهد برد.

حالا بیایید تصور کنیم که EUR/USD جفت ارزی بود که 190 پیپ افزایش می یافت و GBP/USD نوسان بزرگتر 200 پیپ را داشت. قطعاً ضرر شناسایی می کردید!

خرید گرفتن روی یک جفت ارز و فروش گرفتن روی یک جفت ارز دیگر که همبستگی بالایی با هم دارند، به شدت بی فایده و بی ثمر و شاید زیان آور باشد. علاوه بر اینکه دو بار اسپرد می پردازید، سود خود را نیز به حداقل می رسانید زیرا ضرر یک جفت ارز سود جفت ارز دیگر می بلعد و خنثی می کند. و حتی بدتر از آن، ممکن است به دلیل تفاوت در ارزش پیپ و نوسانات همیشه متغیر جفت ارزها، ضرر شناسایی کنید.

## مثال شماره 2 از همبستگی ارزی: EUR/USD و USD/CHF

بیایید مثال دیگری را با هم مرور کنیم. این بار EUR/USD و USD/CHF

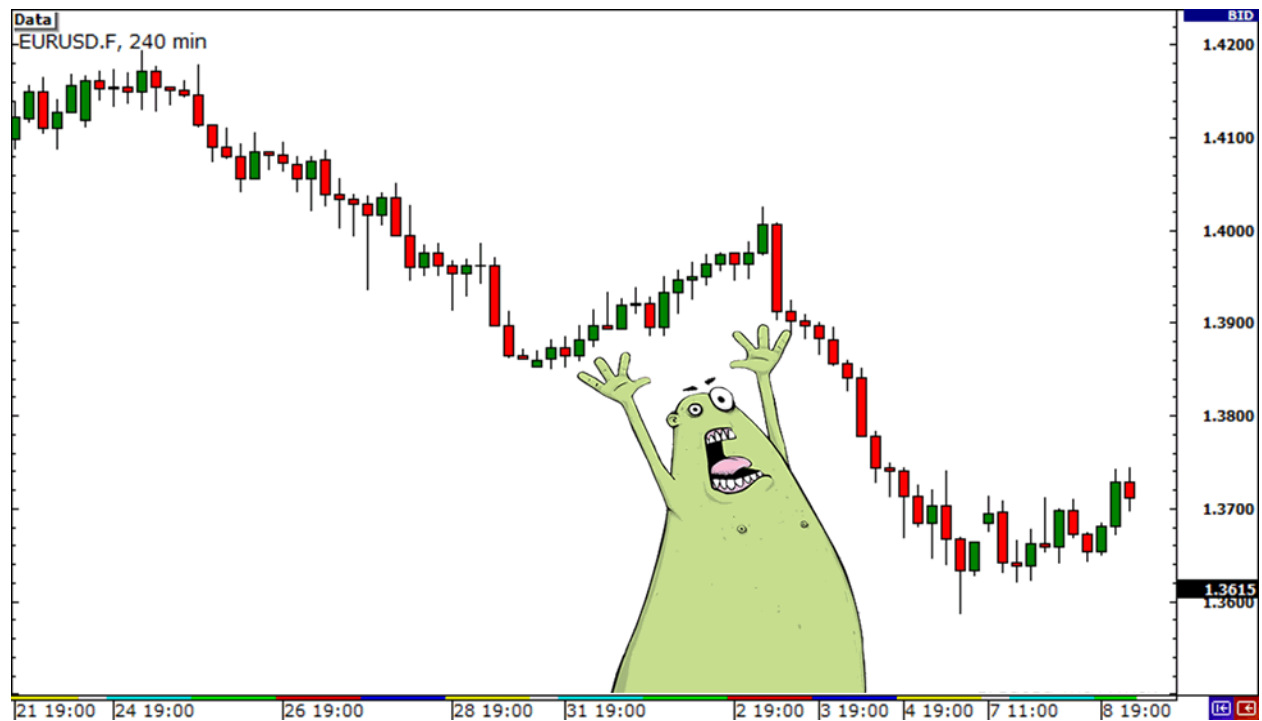
لحظاتی پیش همبستگی مثبت قوی یورو/دلار و پوند/دلار را شاهد بودیم، اما در همین حال یورو/دلار همبستگی بسیار منفی با USD/CHF دارد.

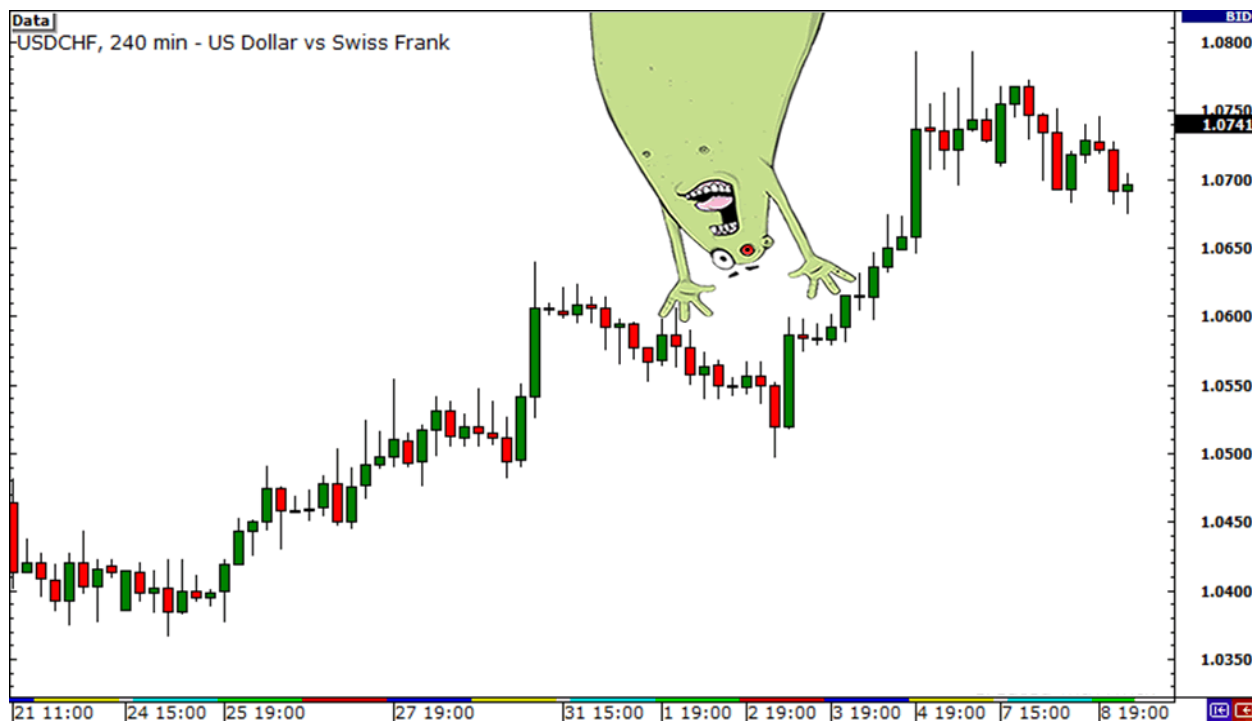
اگر ما به همبستگی هفتگی آنها نگاهی اندازیم، می بینیم که آنها دارای ضریب همبستگی کامل -1.00 است. بعبارتی ای ایهاالناس دیگه ازین بیشتر نمی شود دو جهت ارز خلاف هم باشند! مثل تام و جری!



EUR/USD و USD/CHF مثل آتش و آب هستند، مثل مرد عنکبوتی و گرین گابلین، مثل پرسپولیس و... باشه. باشه. گرفتید.

این دو جفت ارز کاملاً در جهت خلاف هم حرکت می کنند. نگاهی به نمودارهای آنها اندازید:





گرفتن پوزیشن های برعکس بر روی دو جفت ارز با همبستگی بالا و منفی شبیه به گرفتن یک پوزیشن روی دو جفت ارز با همبستگی بسیار بالا و مثبت است.

**خرید زدن روی EUR/USD و فروش گرفتن روی USD/CHF مشابه دو برابر کردن یک پوزیشن است.**

به عنوان مثال، اگر شما 1 لات یورو/دلار خرید زده و 1 لات دلار/فرانک فروش بگیرید، اساساً دارید 2 لات یورو/دلار می خرید، زیرا اگر یورو/دلار بالا برود، USD/CHF کاهش می یابد و شما روی هر دو جفت ارز کسب سود می کنید.

با این حال مهم است بدانید که اگر چنین کاری را انجام دهید، دارید ریسک خود را افزایش می دهید.

اگر به مثالی که در آن روی EUR/USD خرید و روی USD/CHF فروش گرفته اید بازگردیم، در صورتیکه EUR/USD ریزش کند، به احتمال زیاد هر دو معامله شما استاپ اوت شده و منجر به دو بار ضرر می شوند.

شما می‌توانید براحتی روی یورو/دلار خرید گرفته و یا روی دلار/فرانک فروش بگیرید و ریسک خود را به حداقل برسانید. (بعبارتی هر دو کار را با هم نکنید).  
از سوی دیگر، خرید (یا فروش) گرفتن روی هم EUR/USD و هم USD/CHF به طور همزمان معمولاً بی‌فایده و بی‌ثمر و شاید زیان‌آور باشد زیرا شما با گرفتن هر دو پوزیشن اساساً دارید یکی از معامله‌ها را برای خود خنثی می‌کنید.  
از آنجایی که هر دو جفت ارز خلاف جهت هم حرکت می‌کنند، انگار از هم متنفرند، یک معامله به سود می‌نشیند، اما معامله دیگر ضرر می‌شود.

بنابراین شما یا در نهایت سود کمی خواهید داشت زیرا یکی از جفت ارزها سود جفت ارز دیگر می‌بلعد و از بین می‌برد،

یا ممکن است به دلیل اختلاف در ارزش پیپ و مقدار نوسان و تلاطم خیلی مجلسی ضرر شناسایی کنید.