

53. Volatilite Nedir? Forex'te Nasıl Yorumlanır?

Strateji ve Yönetim | Orta Makale (~300-500 kelime)

Volatilite Nedir?

Volatilite, fiyatın belirli bir zaman diliminde ne kadar geniş dalgalandığını ölçer. Yüksek volatilite = büyük fiyat hareketleri = hem yüksek kâr hem yüksek kayıp potansiyeli. Düşük volatilite = dar hareket, düşük risk ve getiri. Forex'te volatilite hem enstrümana hem de seans zamanına göre değişir.

ATR ile Volatilite Ölçümü

Average True Range (ATR), seçilen dönemdeki ortalama günlük fiyat aralığını verir. ATR değeri yüksek = volatil piyasa → stop-loss daha geniş tutulmalı. ATR değeri düşük = sakin piyasa → daha yakın stop mümkün ama gerçekçi hedef de daha kısadır.

VIX ile Küresel Volatilite

VIX (Volatilite Endeksi), S&P 500 opsiyon fiyatlarından hesaplanan küresel korku barometresidir. VIX 20'nin üzerindeyse piyasada stres var; 30'u aşınca panik ortamı söz konusudur. Yüksek VIX dönemlerinde güvenli liman (USD, CHF, JPY, altın) talebi artar.

Volatilitiyi Stratejiyle Eşleştirmek

Yüksek volatilite dönemlerinde: daha geniş stop-loss, daha küçük lot büyüklüğü, daha az işlem. Düşük volatilite dönemlerinde: trend takip stratejileri zorlanır; range stratejileri daha etkilidir. Stratejiyi piyasa rejimiyle uyumlu tutmak performansı artırır.