

آموزش استفاده از همبستگی نماد ها (Correlation) در معاملات

اجرا : مهندس علی نورانی
تحلیلگر ارشد کارگزاری بین المللی ویندزور



سلب مسئولیت و هشدار ریسک :

ابزار های مالی همراه با مارجین از ریسک بالایی برخوردار هستند و ممکن است برای همه سرمایه گذاران مناسب نباشد. معامله با این ابزار های مالی مناسب سرمایه گذارانی که بدنبال سود های تضمین شده هستند، نمی باشد. توصیه می شود در صورت لزوم بدنبال مشاوره سرمایه گذاری مستقل باشید.

این ارتباط تنها با هدف ارائه اطلاعات ایجاد گردیده است و هیچ کدام از اطلاعات ارائه شده به منزله پیشنهاد خرید یا فروش ابزار های معاملاتی نمی باشد، و نباید آن را به عنوان اساس تصمیم گیری معاملاتی بخدمت گرفته شود. بر همین اساس، مشتریان باید در نظر داشته باشند که ارتباطات و اطلاعات موجود مطابق با قانون طراحی شده برای ترویج استقلال تحقیقات سرمایه گذاری نمی باشد، و منوط به هر گونه ممنوعیت در خرید و فروش پیش از انتشار پژوهش سرمایه گذاری نیست. شرکت ویندزور بروکر با مسئولیت محدود تضمینی در قبال درستی یا کامل بودن اطلاعات ارائه شده یا تحلیل مشخص شده ندارد و برای هر مشتری و یا هر شخص ثالث برای درستی اطلاعات و یا هر گونه نرخ بازار که از طریق این خدمات به مشتری ارائه میگردد مسئولیتی ندارد و همچنین در قبال هر تاخیری، عدم دقتی، اشتباهی، وقفه یا انتشار با تاخیر بدلائل تجهیزاتی، و برای هر گونه خسارات مستقیم و غیر مستقیم که از این موقعیت تاخیری، بی دقتی، اشتباه، وقفه و یا قطع شدن خدمات ایجاد گردد مسئولیتی ندارد.

همبستگی نمادهای معاملاتی Correlation

نماد های معاملاتی شامل کالا ها، فلزات، سهام ها، شاخص ها و جفت ارزها جزیره های مجزا از هم نیستند و در رفتار قیمت و در نظام عرضه و تقاضا از یکدیگر تاثیر می گیرند. میزان همبستگی می تواند به معامله گران برای **انتخاب سبد معاملاتی** مناسب و همینطور **ترکیب نماد ها** و **کاهش ریسک** کمک کند. همبستگی می تواند بدلیل اشتراکها بصورت تقریبا همزمان ایجاد شود و یا نماد معاملاتی **پیشرو** باشد و نماد های همبسته با آن از تغییرات قیمت در نماد پیشرو تاثیر بگیرند.

ضریب همبستگی Correlation Coefficient

بر اساس میزان همبستگی میان دو نماد معاملاتی مانند دو جفت ارز معاملاتی ، ضریبی بدست می آید که می تواند بین مثبت یک (+1) تا منفی یک (-1) متغیر باشد. البته می توان این نسبت را بصورت درصد هم در نظر گرفت. در این شرایط ضریب مثبت یک به معنای همبستگی کامل و همسوئی کامل است و ضریب منفی یک بمعنای همبستگی کامل و حرکت در خلاف جهت یکدیگر است. بر همین قاعده صفر و اعداد نزدیک به صفر به معنای غیر همبسته بودن دو نماد است.

ضریب همبستگی Correlation Coefficient

Hourly

	EURUSD	GBPUSD	USDCHF	USDJPY	EURJPY	USDCAD	AUDUSD	EURAUD	USDZAR	USDHKD
EURUSD	100	64.4	-86.1	-35.1	78.7	-71.1	73.4	-17.5	-85	-44.5
GBPUSD	64.4	100	-68.9	-6.3	61.7	55.1	10.0	11.0	56.0	10.1
USDCHF	-86.1	-68.9	100	44.6						
USDJPY	-35.1	-6.3	44.6	100						
EURJPY	78.7	61.7	-58.5	30.1	100					
USDCAD	-71.1	-55.1	70	41.7		100				
AUDUSD	73.4	49.8	-70.8	-17.6			100			
EURAUD	-17.5	-14.8	25.9	-5.3				100		
USDZAR	-85	-56.9	74.9	46.8					100	
USDHKD	-44.5	-48.4	37.1	-27.4						100

4 hours

	EURUSD	GBPUSD	USDCHF	USDJPY	EURJPY	USDCAD	AUDUSD	EURAUD	USDZAR	USDHKD
EURUSD	100	43.2	-66	-53.9	34.5	-26.1	-2.8	39.4	1	-3.5
GBPUSD	43.2	100	29.1	-70	-37.1	-39.6	10.5	20.0	72.7	17.5
USDCHF	-66	29.1	100	12.7	-48.4	-23				
USDJPY	-53.9	-70	12.7	100	60.5	28				
EURJPY	34.5	-37.1	-48.4	60.5	100	6.2				
USDCAD	-26.1	-39.6	-23.2	28	6.2	100				
AUDUSD	-2.8	48.5	54.7	-26.2	-32	-78	100			
EURAUD	39.4	-28.8	-74.8	4.2	42.1	62.1		100		
USDZAR	1	-73.7	-69.6	37.1	41.9	63.1			100	
USDHKD	-3.5	-47.5	-47.4	24	23.4	63.1				100

Daily

	EURUSD	GBPUSD	USDCHF	USDJPY	EURJPY	USDCAD	AUDUSD	EURAUD	USDZAR	USDHKD
EURUSD	100	71.9	-61.6	-67.9	69.8	-71.3	-42	75.4	24.1	38.2
GBPUSD	71.9	100	-3.9	-33.5	64.7	-81.3	-34.8	57.4	30.1	55.9
USDCHF	-61.6	-3.9	100	51.3	-34.1	2.1	14.3	-38.2	9.8	20.5
USDJPY	-67.9	-33.5	51.3	100	5.2	54.9	62	-75.6	-45.3	-45.3
EURJPY	69.8	64.7	-34.1	5.2	100	-43	3.6	28.6	-11.9	7.5
USDCAD	-71.3	-81.3	2.1	54.9	-43	100	55.4	-72.2	-46.9	-75.2
AUDUSD	-42	-34.8	14.3	62	3.6	55.4	100	-91.3	-84.6	-66.1
EURAUD	75.4	57.4	-38.2	-75.6	28.6	-72.2	-91.3	100	72	65
USDZAR	24.1	30.1	9.8	-45.3	-11.9	-46.9	-84.6	72	100	58.7
USDHKD	38.2	55.9	20.5	-45.3	7.5	-75.2	-66.1	65	58.7	100

ضریب همبستگی Correlation Coefficient

همبستگی و همسوئی کامل	+1	_____
همبستگی بالا	+0.8<	_____
همبستگی متوسط	+0.6<	_____
همبستگی پایین	-0.4< >+0.4	_____
همبستگی متوسط در خلاف جهت	-0.6>	_____
همبستگی بالا در خلاف جهت	-0.8>	_____
همبستگی کامل در خلاف جهت	-1	_____

استفاده از همبستگی نماد ها در معاملات

۱- با تعیین همبستگی نماد ها میزان ریسک معاملات همزمان در نماد های مختلف بدرستی تعیین می شود

برای معامله دو نماد با همبستگی بالا و در جهات همسو، باید ریسک قابل قبول میان این دو معامله تقسیم شود

برای معامله خلاف جهت دو نماد با همبستگی بالا، باید در نظر گرفته شود، که این معاملات می تواند همدیگر را پوشش داده و مانند معاملات هجینگ عمل کنند

استفاده از همبستگی نماد ها در معاملات

۲- می توان بجای معامله در دو نماد همبسته ، نماد دارای موقعیت معاملاتی بهتر را انتخاب کرد

۳- برای اطمینان از تحلیل صورت گرفته میتواند از نمادهای دارای همبستگی بالا کمک گرفت. بعنوان مثال اگر شکست یا برگشتی از یک محدوده با اهمیت مانند مقاومت، حمایت و یا خط روند در نماد مورد نظرایجاد گردد، برای تایید عبور و اعتبار سنجی آن می توان نماد دارای همبستگی بسیار بالا با نماد مورد نظر را هم بررسی نمود، که آیا شکست و یا برگشت معتبر ایجاد شده است و یا خیر.

استفاده از همبستگی نماد ها در معاملات

۴- با استفاده از ترکیب نمادهای معاملاتی و بویژه جفت ارزها می توان ریسک معامله را با معامله در نماد های جانبی و متقاطع کاهش داد.

بعنوان مثال فرض کنید که در تایم فریم میان مدت (H4) برای جفت ارز **EURUSD** روند قیمت صعودی و سیگنال قیمت خرید است و بلعکس در نماد **GBPUSD** روند قیمت در همین تایم فریم میان مدت نزولی و سیگنال فروش ایجاد شده است. این اتفاق نشان می دهد که **دلار در تحولات ایجاد شده نقش کمتری** داشته است و یورو و پوند در جهاتی خلاف هم در حرکت هستند و میتوان برای کاهش ریسک در دو معامله ، **یک معامله در نماد متقاطع** انجام داد.

EUR/USD   EUR/GBP 
GBP/USD 

EUR/USD   EUR/GBP 
GBP/USD 

نمونه هایی از ترکیب نماد ها برای رسیدن به نماد های Cross یا متقاطع

EUR/USD   EUR/JPY 
USD/JPY 

GBP/USD   GBP/AUD 
AUD/USD 

EUR/USD   EUR/JPY 
USD/JPY 

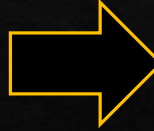
GBP/USD   GBP/AUD 
AUD/USD 

نمونه هایی از ترکیب نماد ها برای رسیدن به نماد های Cross یا متقاطع

USD/CHF   CHF/JPY 
USD/JPY 

USD/CAD   CAD/JPY 
USD/JPY 

USD/CHF   CHF/JPY 
USD/JPY 

USD/CAD   CAD/JPY 
USD/JPY 

استفاده از نماد های پیشرو در تحلیل و معامله

در موضوع همبستگی بین نماد های معاملاتی، برخی از کالاها یا ارزها پیشرو هستند، یعنی تغییرات در این نماد ها می تواند بر ارزها یا کالا ها و همینطور بر شاخص ها و سهام ها تاثیرگذار باشد.

از این جمله می توان به یکی از **پیشرو ترین** نماد های معاملاتی یعنی **نفت** اشاره کرد که **افزایش** آن می تواند **تقاضا** برای **سهام** شرکت های صنعتی را تغییر دهد و مثلا **تقاضا** برای **شرکت های اتومبیل سازی** را کاهش دهد و یا موجب **کاهش تقاضا** برای **دلار آمریکا**، **ین ژاپن** گردد و **تقاضا** برای **دلار کانادا** را افزایش دهد. همینطور می تواند **بدلیل ایجاد تورم بین المللی**، **توجه و تقاضا برای طلا** را افزایش دهد.

افزایش تقاضا برای یورو در جفت ارزهای شامل آن می تواند **تقاضا** برای **فرانک سوئیس** را افزایش دهد. **کاهش تقاضا برای دلار** در جفت ارزهای شامل آن می تواند **تقاضا برای طلا** را افزایش دهد.



[telegram.me/WindsorBrokers](https://t.me/WindsorBrokers)



aparat.com/WindsorBrokers



instagram.com/fa.WindsorBrokers



facebook.com/Windsorfarsi



fa.windsorbrokersiran.com

سلب مسئولیت و هشدار ریسک :

ابزار های مالی همراه با مارجین از ریسک بالایی برخوردار هستند و ممکن است برای همه سرمایه گذاران مناسب نباشد. معامله با این ابزار های مالی مناسب سرمایه گذارانی که بدنبال سود های تضمین شده هستند، نمی باشد. توصیه می شود در صورت لزوم بدنبال مشاوره سرمایه گذاری مستقل باشید.

این ارتباط تنها با هدف ارائه اطلاعات ایجاد گردیده است و هیچ کدام از اطلاعات ارائه شده به منزله پیشنهاد خرید یا فروش ابزار های معاملاتی نمی باشد، و نباید آن را به عنوان اساس تصمیم گیری معاملاتی بخدمت گرفته شود. بر همین اساس، مشتریان باید در نظر داشته باشند که ارتباطات و اطلاعات موجود مطابق با قانون طراحی شده برای ترویج استقلال تحقیقات سرمایه گذاری نمی باشد، و منوط به هر گونه ممنوعیت در خرید و فروش پیش از انتشار پژوهش سرمایه گذاری نیست. شرکت ویندزور بروکر با مسئولیت محدود تضمینی در قبال درستی یا کامل بودن اطلاعات ارائه شده یا تحلیل مشخص شده ندارد و برای هر مشتری و یا هر شخص ثالث برای درستی اطلاعات و یا هر گونه نرخ بازار که از طریق این خدمات به مشتری ارائه میگردد مسئولیتی ندارد و همچنین در قبال هر تاخیری، عدم دقتی، اشتباهی، وقفه یا انتشار با تاخیر بدلائل تجهیزاتی، و برای هر گونه خسارات مستقیم و غیر مستقیم که از این موقعیت تاخیری، بی دقتی، اشتباه، وقفه و یا قطع شدن خدمات ایجاد گردد مسئولیتی ندارد.