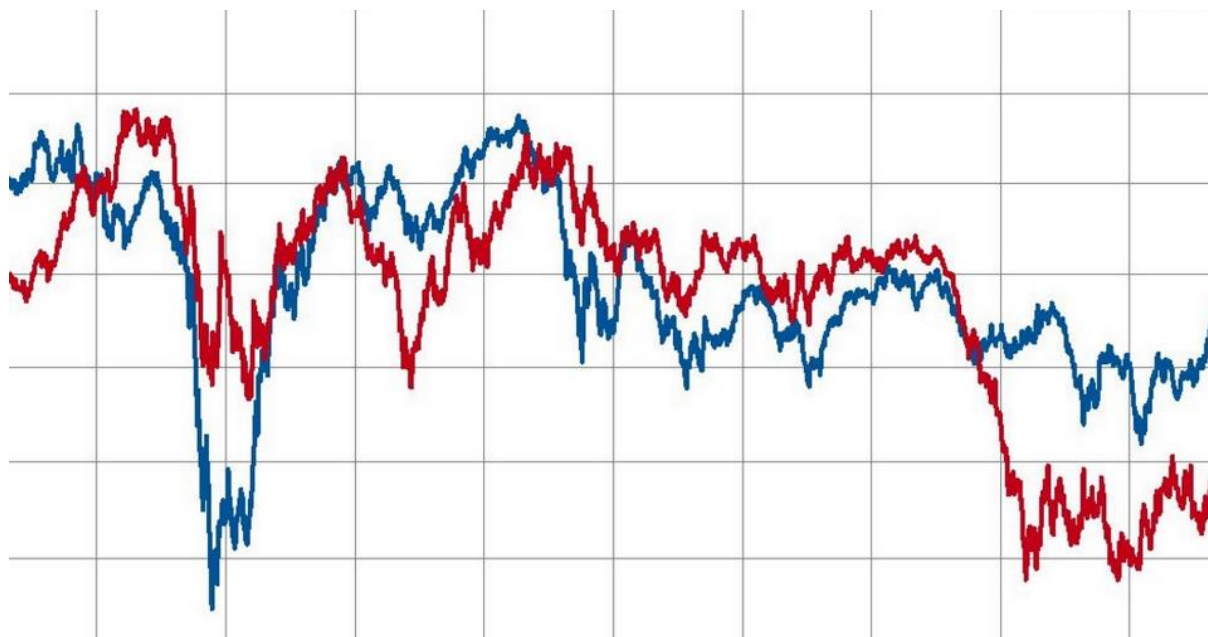


توصیف همبستگی بین ارز ها

انتشار: سایت فراچارت

Farachart.com

مترجم: اسماعیل صالح



آیا تا به حال توجه کرده اید که وقتی قیمت یک جفت ارز خاص افزایش می یابد، قیمت جفت ارز دیگری کاهش می یابد؟ یا اینکه وقتی دقیقاً همان جفت ارز سقوط می کند به نظر میرسد که جفت ارز دیگری از آن پیروی کرده و سقوط می کند؟

اگر پاسخ شما "بله" است، پس شما شاهد پدیده ی همبستگی بین ارزها بوده اید.

اگر پاسختان "خیر" می باشد، شما باید از انجام کارهایی که اهمیت کمتری دارند مثل خوابیدن، خوردن، بازی کردن (بازی هایی مثل انگری بردز و کندی کراش....!!) و غیره دست بکشید و زمان بیشتری را به مشاهده و بررسی نمودارها اختصاص دهید.

اما نگران نباشید چون ما قصد داریم که اصول اولیه آن را برای شما واکاوی کنیم.

همبستگی ارز:

نیمه ی اول... ساده می باشد. ارز... نیازی به توضیح ندارد.

نیمه ی دوم... باز هم ساده است. همبستگی: ارتباط بین دو چیز

همبستگی ارز چیست؟

در دنیای مالی، همبستگی یک وسیله ی آماری می باشد که نشان می دهد چگونه دو اوراق بهادار در ارتباط با یکدیگر حرکت می کنند.

همبستگی ارز (فراچارت: Currency Correlation)، بنابراین، به ما می گوید که آیا دو جفت ارز هم جهت، خلاف جهت یا کاملاً بصورت تصادفی نسبت به یکدیگر در طی یک بازه ی زمانی حرکت می کنند.

وقتی که با ارزها معامله می کنید باید حتماً خاطرتان باشد که چون ارزها به صورت جفتی معامله می شوند بنابراین هیچ جفت ارزی به صورت جدا و منفرد نیست.

اگر شما می خواهید فقط بر روی یک جفت ارز معامله کنید که هیچ در غیر این صورت اگر می خواهید چند جفت ارز را با هم معامله کنید خیلی مهم است که بدانید چگونه جفت ارز های مختلف در ارتباط با یکدیگر حرکت می کنند، به ویژه اگر با این موضوع که چگونه ارتباط بین ارز ها می تواند مقدار ریسک درگیر شما را تحت تاثیر قرار می دهد آشنایی ندارید.

اگر شما در حال معامله با چند جفت ارز به طور همزمان می باشید و هیچ درکی از کاری که میکنید نداشته باشید، خودتان را به کشتن می دهید! ناپود می شوید! بیشتر از این نمیتوانیم روی این موضوع تاکید داشته باشیم.

اینجا، شما می آموزید که همبستگی ارز چیست و چگونه از آن استفاده کنید تا یک معامله گر باهوش تر شوید و تصمیمات کنترل ریسک معتبری اتخاذ کنید.



همبستگی به صورت ضریب همبستگی که بین -1 و $+1$ می باشد، محاسبه می شود.

همبستگی مثبت کامل (با ضریب همبستگی $+1$) بیانگر این است که دو جفت ارز در 100% مواقع همجهت هم حرکت خواهند کرد

همبستگی منفی کامل (با ضریب همبستگی -1) بیانگر این است که دو جفت ارز در 100% مواقع خلاف جهت هم حرکت خواهند کرد.

اگر همبستگی صفر باشد، گفته می شود که حرکت بین دو جفت ارز همبستگی صفر دارند یا فاقد همبستگی می باشند. و کاملاً غیر وابسته بوده و نسبت به هم کاملاً تصادفی حرکت می کنند. ما دقیقاً نمیدانیم که چطور یک جفت ارز در ارتباط با جفت ارز دیگر حرکت می کند.

چگونه جدول های همبستگی ارز را بخوانیم

آیا شما یک یادگیرنده ی بصری هستید؟ آیا شما از دیدن زنان زیبا یا مردان خوش اندام لذت می برید؟ اگر پاسختان بله است، بسیار خوب است پس ادامه می دهیم.

نگاهی به جدول های زیر بیندازید.

هر جدول ارتباط بین هر جفت ارز اصلی را (به رنگ نارنجی) و جفت ارز دیگر (به رنگ سفید) را در یک بازه های زمانی متفاوت نشان می دهد.

به خاطر داشته باشید، همبستگی ارزی به صورت اعشاری تحت عنوان ضریب همبستگی ارز نشان داده شده است. یک عدد بین **-1.00 و 1.00**

ضریب **1+** یا نزدیک به آن نمایانگر این است که دو جفت ارز همبستگی مثبت قوی با هم داشته و به احتمال بسیار بالا هم جهت با یکدیگر حرکت خواهند کرد.

به همین صورت، ضریب **1-** یا نزدیک به آن بیانگر این است که دو جفت ارز همبستگی قوی داشته، اما یک همبستگی منفی، که منجر به این می شود که خلاف جهت هم حرکت می کنند.

ضریب صفر یا نزدیک به آن بیانگر ارتباط و همبستگی ضعیف یا تصادفی می باشد.

EUR/USD Correlations

EUR/USD	USD/JPY	USD/CHF	GBP/USD	USD/CAD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	-0.23	-1.00	0.94	-0.98	0.98	0.93	0.93	0.86
1 month	0.63	-0.98	0.13	-0.90	0.90	0.96	0.91	0.86
3 month	-0.62	-0.92	0.83	0.14	0.63	0.42	0.61	0.75
6 month	-0.62	-0.85	0.31	-0.35	0.61	0.65	0.28	0.71
1 year	-0.69	-0.98	0.88	-0.93	0.95	0.96	0.66	0.02

USD/JPY Correlations

USD/JPY	EUR/USD	USD/CHF	GBP/USD	USD/CAD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	-0.23	0.22	-0.21	0.07	-0.22	0.07	0.14	-0.20
1 month	0.63	-0.52	-0.35	-0.58	0.46	0.64	0.89	0.77
3 month	-0.62	0.52	-0.62	-0.40	-0.30	0.09	0.24	-0.35
6 month	-0.62	0.78	0.14	0.43	-0.70	-0.63	0.58	-0.68
1 year	-0.69	0.74	-0.51	0.67	-0.69	-0.69	0.09	-0.20

USD/CHF Correlations

USD/CHF	EUR/USD	USD/JPY	GBP/USD	USD/CAD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	-1.00	0.22	-0.95	0.98	-0.99	-0.95	-0.93	-0.83
1 month	-0.98	-0.52	-0.24	0.89	-0.93	-0.94	-0.87	-0.79
3 month	-0.92	0.52	-0.79	0.14	-0.78	-0.57	-0.62	-0.67
6 month	-0.85	0.78	-0.07	0.66	-0.88	-0.86	0.06	-0.74
1 year	-0.98	0.74	-0.87	0.96	-0.98	-0.98	-0.58	-0.01

GBP/USD Correlations

GBP/USD	EUR/USD	USD/JPY	USD/CHF	USD/CAD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	0.94	-0.21	-0.95	-0.90	0.94	0.87	0.88	0.64
1 month	0.13	-0.13	-0.24	-0.26	0.31	0.20	-0.10	-0.39
3 month	0.83	-0.62	-0.79	0.21	0.70	0.49	0.41	0.26
6 month	0.31	0.14	-0.07	0.17	-0.02	-0.16	0.49	-0.45
1 year	0.88	-0.51	-0.87	-0.89	0.87	0.86	0.69	-0.45

USD/CAD Correlations

USD/CAD	EUR/USD	USD/JPY	USD/CHF	GBP/USD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	-0.98	0.07	0.98	-0.90	-0.98	-0.98	-0.97	-0.88
1 month	-0.89	-0.58	0.89	-0.26	-0.96	-0.96	-0.83	-0.70
3 month	0.14	-0.40	0.14	0.21	-0.41	-0.56	-0.23	-0.02
6 month	-0.35	0.43	0.66	0.17	-0.83	-0.77	0.16	-0.45
1 year	-0.93	0.67	0.96	-0.89	-0.97	-0.96	-0.59	0.13

AUD/USD Correlations

AUD/USD	EUR/USD	USD/JPY	USD/CHF	GBP/USD	USD/CAD	NZD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	0.98	-0.22	-0.99	0.94	-0.98	0.95	0.92	0.83
1 month	0.90	0.46	-0.93	0.31	-0.96	0.94	0.76	0.67
3 month	0.63	-0.30	-0.78	0.70	-0.41	0.87	0.48	0.28
6 month	0.61	-0.70	-0.88	-0.02	-0.83	0.91	-0.23	0.58
1 year	0.95	-0.69	-0.98	0.87	-0.97	0.99	0.59	-0.0

NZD/USD Correlations

NZD/USD	EUR/USD	USD/JPY	USD/CHF	GBP/USD	USD/CAD	AUD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	0.93	0.07	-0.95	0.87	-0.98	0.95	0.98	0.83
1 month	0.96	0.64	-0.94	0.20	-0.96	0.94	0.90	0.79
3 month	0.42	0.09	-0.57	0.49	-0.56	0.87	0.61	0.17
6 month	0.65	-0.63	-0.86	-0.16	-0.77	0.91	-0.09	0.72
1 year	0.96	-0.63	-0.98	0.86	-0.96	0.99	0.61	0.00

EUR/JPY Correlations

EUR/JPY	EUR/USD	USD/JPY	USD/CHF	GBP/USD	USD/CAD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/GBP
هفتگی	0.93	0.14	-0.93	0.88	-0.97	0.92	0.98	0.81
ماهانه	0.91	0.89	-0.84	-0.10	-0.83	0.76	0.90	0.90
سه ماهه	0.61	0.24	-0.62	0.41	-0.23	0.48	0.61	0.58
شش ماهه	0.28	0.58	0.06	0.49	0.16	-0.23	-0.09	-0.09
سالانه	0.66	0.09	-0.58	0.69	-0.59	0.59	0.61	-0.20

EUR/GBP Correlations

EUR/GBP	EUR/USD	USD/JPY	USD/CHF	GBP/USD	USD/CAD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/JPY
هفتگی	0.86	-0.20	-0.83	0.64	-0.88	0.83	0.83	0.81
ماهانه	0.86	0.77	-0.79	-0.39	-0.70	0.67	0.79	0.90
سه ماهه	0.75	-0.35	-0.67	0.26	-0.02	0.28	0.17	0.58
شش ماهه	0.71	-0.68	-0.74	-0.45	-0.45	0.58	0.72	-0.09
سالانه	0.02	-0.20	-0.01	-0.45	0.13	-0.03	0.00	-0.20

آیا شما بدون این که بدانید ریسک خود را دو برابر می کنید؟



وقتی که شما به طور همزمان چند جفت ارز را با هم معامله می کنید، همیشه مطمئن شوید که از مقدار ریسک خود آگاهی دارید.

شاید اعتقاد شما این باشد که با معامله در جفت ارز های مختلف، ریسک خود را تقسیم می کنید اما بسیاری از جفت ارز ها تمایل دارند که هم جهت حرکت کنند.

اجازه دهید تا به مثالی که شامل دو جفت ارز کاملاً وابسته به هم یک هفته ای نگاهی بیندازیم: EUR/USD و GBP/USD.

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

بر اساس جدول، با یک ضریب همبستگی بسیار خوب 0.94، به صورت واضحی بین این دو جفت ارز همبستگی بالایی وجود دارد. EUR/USD و GBP/USD مثل نان و کره هستند. (همیشه باهم حرکت می کنند) مثل آب و روغن. !

بسیار خوب فکر کنم که متوجه منظورم شدید. نکته این است که این دو جفت ارز دست یکدیگر را گرفته و آهنگ "Kum Ba Yah" (فراچارت: کامبایا یکی از آهنگ های قدیمی ملایم کودکانه هست که موقع بازی و رقص آنها پخش می شده) را خوانده و باهم می پرند! برای اینکه به شما ثابت کنیم که اعداد دروغ نمی گویند، اینجا نمودار چهار ساعته ی آنها را آورده ایم. توجه کنید که چگونه هر دوی آنها در یک جهت به سمت پایین حرکت کرده اند.



بازگردیم به موضوع ریسک، ما می توانیم ببینیم که باز کردن یک پوزیشن یا معامله در هردوی جفت ارز های EUR/USD و GBP/USD مثل این است که در یکی از آنها معامله ی خود را دوبرابر کنیم.

به عنوان نمونه، اگر یک لات EUR/USD و یک لات GBP/USD بخرید، اساسا شما دو لات EUR/USD خریده اید، چون هردوی جفت ارز های EUR/USD و GBP/USD در یک جهت حرکت می کنند.

به عبارت دیگر، شما ریسک خود را افزایش می دهید. اگر شما EUR/USD و GBP/USD بخرید، برای اشتباه کردن شانس دوباره ای ندارید. تمام چیزی که دستگیر شما می شود یک شانس می باشد چون اگر EUR/USD سقوط کند و شما استاپ بخورید، GBP/USD نیز به احتمال زیاد استاپ خورده است (و بالعکس).

شما همچنین نمی بایست به طور همزمان EUR/USD را خریده و GBP/USD را بفروشید چون اگر قیمت EUR/USD افزایش یابد، قیمت GBP/USD نیز افزایش خواهد یافت و این منجر به چه خواهد شد؟

اگر فکر می کنید که سود یا ضرر شما همیشه صفر خواهد بود، در اشتباهید. EUR/USD و GBP/USD دارای ارزش پپ متفاوتی هستند و صرفاً به دلیل اینکه به میزان زیادی همبستگی دارند به این معنی نمی باشد که آنها دقیقاً در رنج پپ یکسانی حرکت می کنند.

در جفت ارزها نوسانات بی ثبات هستند. EUR/USD می تواند 200 پپ افزایش یابد، درحالی که GBP/USD تنها 190 پپ صعود می کند. اگر این اتفاق رخ دهد، ضرر معامله ی GBP/USD شما (به خاطر اینکه معامله فروش داشته اید)، اگر همه ی سود معامله EUR/USD را از بین نبرد بیشتر آن را از بین خواهد برد.

حال بیابید متصور شویم که EUR/USD به اندازه ی 190 پپ افزایش قیمت می یابد، و GBP/USD افزایش قیمت بزرگتر یعنی 200 پپ را داشته باشد. شما قطعاً متضرر خواهید شد.



پس خرید یک جفت ارز و فروش ارزی دیگر که به مقدار زیادی باهم همبستگی دارند نتیجه ی ضرربخشی خواهد داشت.

علاوه بر اینکه برای اسپرد دوبار باید هزینه پردازید، سود خود را به حداقل می رسانید چون یک جفت ارز سود جفت دیگر را از بین می برد. حتی بدتر از این، شما به دلیل تفاوت در ارزش پیپ ها و بی ثباتی دائمی جفت ارزها در نهایت متضرر خواهید شد.

مثال دیگری را بررسی می کنیم. این بار دو جفت ارز EUR/USD و USD/CHF.

در حالی که الان همبستگی قوی مثبت آن را با GBP/USD دیدیم، EUR/USD دارای همبستگی کاملاً منفی با USD/CHF می باشد.

اگر ما به همبستگی یک هفته ای آن نگاه کنیم، ضریب همبستگی کامل -1.00 را دارا می باشد. وارونه تر از این دو جفت ارز نخواهیم داشت! این دو جفت ارز تام و جری هستند تا بن و جری!

EUR/USD و USD/CHF مثل آب و آتش هستند، باگز بانی (فراچارت: بانی خرگوشه) و المر فاد. (فراچارت: کارتون خرگوش و شکارچیه!) سوپرمن و کریپتونیت، بوستون سلتيكس و لس انجلس ليكرز، منچستر يونائتد و ليورپول!

این دو جفت ارز به صورت کاملاً متضاد با یکدیگر حرکت می‌کنند. این نمودارها را نگاه کنید:



گرفتن پوزیشن‌های مخالف در دو جفت ارز که کاملاً همبستگی منفی دارند مثل این است که همان پوزیشن را در دو جفت ارز کاملاً همبسته‌ی مثبت باز کنید.



خرید EUR/USD و فروش USD/CHF دقیقاً مثل این است که یک معامله را دوبار کنید.

به عنوان نمونه، اگر 1 لات EUR/USD خریده و 1 لات USD/CHF بفروشید، اساساً شما 2 لات EUR/USD خریده‌اید، چون اگر قیمت EUR/USD افزایش یابد، USD/CHF کاهش خواهد یافت، و شما در هر دو جفت ارز سود خواهید کرد.

بسیار مهم می‌باشد که شما بدانید که با این کار مقدار ریسک معامله خود را افزایش داده‌اید. بازگردیم به مثالی که در آن شما EUR/USD خریده‌اید و USD/CHF فروخته‌اید، اگر EUR/USD کاهش قیمت شدیدی بیابد، به احتمال خیلی زیاد هر دو معامله‌ی شما استاپ خواهند خورد و منجر به دو معامله‌ی ضرر ده خواهند شد.



شما می توانید ضرر خود را خیلی ساده با تصمیم اینکه یا EUR/USD را بخرید و یا USD/CHF را بفروشید به جای اینکه هر دوی این معاملات را انجام دهید به حداقل برسانید.

به عبارت دیگر، خریدن (یا فروختن) هر دوی EUR/USD و USD/CHF در یک زمان نتیجه ی معکوس خواهد داشت چون شما اساسا هر دو معامله را خنثی می کنید.

چون این دو جفت ارز در جهت مخالف هم حرکت می کنند انگار که از هم متنفر هستند، یک طرف سود ده بوده ولی طرف دیگر ضررده خواهد بود. بنابراین شما یا سود کمی به دست می آورید چون یک جفت ارز سود معامله ی دیگر را از بین می برد.

یا ضرر می کنید چون ارزش پپ و رنج نوسانات دو جفت ارز با هم متفاوت خواهند بود.

چگونه از همبستگی ارز در معاملات خود استفاده کنیم.

از جدول زیر به عنوان یک راهنما برای تفسیر مقادیر ضرایب همبستگی مختلف استفاده کنید.

همبستگی معکوس کامل	-1.0
همبستگی معکوس خیلی قوی	-0.8
همبستگی معکوس قوی	-0.6
همبستگی معکوس معمول	-0.4
همبستگی معکوس ضعیف	-0.2
بدون همبستگی، کاملا تصادفی	0
همبستگی ضعیف	0.2
همبستگی ضعیف	0.4
همبستگی معمول	0.6
همبستگی قوی	0.8
همبستگی کامل	1.0

(فراچارت: در برخی از سایت ها همبستگی ها را می توانید به درصد مشاهده کنید مانند سایت مای اف ایکس بوک) خوب شما الان میدانید که همبستگی ارز چیست و چگونه باید آن را از یک نمودار برداشت کرد. اما شرط می بندم که شما از خود می پرسید که:



چگونه با استفاده از همبستگی ارز معاملات موفق تری را انجام دهیم. برای چه به این مهارت شگرف در جعبه ابزار معاملات خود نیاز دارید؟

چندین دلیل وجود دارد:

1. حذف کردن معاملاتی که معکوس یکدیگرند

استفاده از همبستگی به شما کمک می کند که از معاملاتی که اثر یکدیگر را خنثی می کنند دوری کنید. همانطور که جدول و مثال قبلی توضیح می دهند، ما می دانیم که EUR/USD و USD/CHF به صورت 100% در خلاف جهت همدیگر حرکت می کنند.

بازکردن یک موقعیت خرید در EUR/USD "و" همچنین خرید USD/CHF، بیهوده و گاهی سنگین خواهد بود. افزون بر اینکه باید دو بار اسپرد پردازید، هر حرکتی در قیمت، یکی از جفت ها را بالا برده و جفت ارز دیگر را پایین می آورد.

ما می خواهیم که از این همه سختی و تلاش خود نتیجه و سود بگیریم.

2. سود های افزایشی

یا ضرر های افزایشی.... شما این فرصت را دارید که به منظور به حداکثر رساندن سود، یک موقعیت را دوبار بر کنید. بیایید به ارتباط بین EUR/USD و GBP/USD در مدت زمان یک هفته از مثال قبل نگاهی دوباره بیندازیم.

این دو جفت ارز دارای همبستگی مثبت قوی می باشند که در آن GBP/USD قدم به قدم EUR/USD را دنبال می کند.

باز کردن یک موقعیت خرید در هر دو جفت ارز مثل این است که EUR/USD را معامله کنید و معامله ی خود را دو برابر کنید. شما در واقع دارید از اهرم (Leverage) استفاده می کنید. اگر در جهت مناسب حرکت کند سود بسیاری کسب می شود و اگر در جهت مخالف حرکت کند ضرر بسیاری متحمل خواهید شد.

3. توزیع ریسک

فهم اینکه همبستگی و ارتباط بین ارزها وجود دارد به شما اجازه می دهد که از جفت ارزهای متفاوت استفاده کرده و قدرت دید شما را افزایش می دهد. به جای اینکه همیشه بر روی یک جفت ارز معامله کنید، شما می توانید ریسک خود را بین دو جفت ارز که در یک جهت حرکت می کنند تقسیم کنید.

جفت ارز هایی که همبستگی قوی تا بسیار قوی دارند (بین 0.7) را انتخاب کنید. به عنوان مثال، EUR/USD و GBP/USD تمایل دارند که با هم حرکت کنند. همبستگی ناقص بین این دو جفت ارز به شما این اجازه را می دهد که ریسک خود را کاهش دهید. فرض کنیم که شما معتقدید که ارزش USD افزایش می یابد. (معتقدید که USD گاوای است).

به جای باز کردن دو موقعیت فروش در EUR/USD، شما می توانید یک معامله فروش در EUR/USD و یک فروش دیگر در GBP/USD داشته باشید که می تواند در برابر برخی ریسک ها به عنوان سپر عمل کند و به معاملات کلی شما تنوع ببخشد.

در مواقعی که دلار آمریکا به ارزش خود را از دست می دهد، ممکن است که یورو خیلی کمتر از پوند تحت تاثیر قرار گیرد.



4. محافظت از سرمایه

اگرچه حفاظت از سرمایه می تواند منجر به واقعی کردن سود های کوچکتر می شود، همچنین می تواند ضرر ها را به حداقل برساند. اگر شما یک موقعیت خرید در EUR/USD باز کرده اید و این معامله در خلاف جهت مورد نظر شما حرکت کند، یک موقعیت خرید کوچک در جفتی که در خلاف جهت EUR/USD حرکت می کند مثل USD/CHF باز کنید.

بیشتر ضرر شما جبران می شود!

می توانید از تفاوت ارزش هر پپ در هر جفت ارز استفاده کنید.

به عنوان مثال، درحالی که EUR/USD و USD/CHF دارای همبستگی منفی کامل -1.0 می باشند، ارزش پپ آنها کاملاً متفاوت می باشند. فرض کنید که شما 10,000 معامله ی مینی لات دارید، یک پپ از EUR/USD برابر 1\$ و یک پپ از USD/CHF برابر 0.93\$ می باشد.

اگر شما یک مینی لات EUR/USD بخرید، شما می توانید معامله ی خود را با خریدن یک مینی لات از USD/CHF محافظت کنید. اگر EUR/USD به اندازه 10 سقوط کند، شما به اندازه ی 10\$ متضرر می شوید. اما معامله USD/CHF شما به اندازه ی 9.30\$ بالا خواهد رفت.

به جای اینکه 10\$ پایین باشید، شما فقط 0.70\$ ضرر کرده اید.

اگرچه حفاظت از سرمایه از مدت طولانی است که دستاوردی عالی حساب می شود، ولی معایب خاص خود را دارد. اگر EUR/USD صعود کند، به خاطر ضرر های معامله ی USD/CHF، سود شما محدود خواهد شد.

همچنین، همبستگی هر زمانی ممکن است که تضعیف شود. فرض کنید اگر EUR/USD به اندازه ی 10 پپ پایین بیاید، و USD/CHF فقط 5 پپ افزایش یافته یا حرکت نکند و یا حتی سقوط کند! حساب معاملاتی شما متحمل ضرر سنگینتری خواهد بود.

پس وقتی محافظت سرمایه می کنید (Hedging) مواظب باشید!

5. شکست های قیمت در مقاومت ها (Breakouts) را تایید و از شکست های غیر واقعی (Fakeouts) دوری می کند

شما می توانید از همبستگی ارز برای تایید سیگنال های ورود و خروج معاملات خود استفاده کنید.

به عنوان نمونه، EUR/USD ظاهراً در حال حاضر دارای یک سطح حمایت مهمی می باشد. شما واکنش قیمت (Price Action) را مشاهده می کنید و به دنبال فروش در قسمت پایین رو شکست قیمت هستید.

از آنجایی که شما می دانید EUR/USD با GBP/USD به صورت مثبت و با USD/CHF و USD/JPY به صورت منفی همبستگی دارند، بررسی می کنید که آیا سه جفت ارز دیگر به اندازه ی EUR/USD حرکت می کنند یا خیر.

شما متوجه می شوید که GBP/USD در یک موقعیت سطح حمایت مهمی قرار گرفته است و هر دوی USD/CHF و USD/JPY در سطوح مقاومت کلیدی ای قرار دارند.

این به شما می گوید که حرکت اخیر مربوط به دلار آمریکا بوده و شکست قیمت احتمالی برای EUR/USD تایید م کند زیرا سه جفت ارز دیگر به صورت مشابه حرکت می کنند. بنابراین تصمیم می گیرید که وقتی قیمت شکسته شد معامله کنید.

اکنون بیا فرض کنیم که حرکت سه جفت ارز دیگر به قوت EUR/USD نیست. GBP/USD ثابت است، USD/JPY افزایش نمی یابد، و USD/CHF موجی حرکت می کند.

این معمولاً نشانه ی خیلی قوی ای می باشد که سقوط EUR/USD به دلار آمریکا وابسته نمی باشد و احتمالاً به دلیل برخی اخبار منفی یورو می باشد.

قیمت ممکن است که پایین تر از سطح حمایت کلیدی که شما زیر نظر دارید حرکت می کند اما چون سه جفت ارز همبسته ی دیگر به اندازه ی EUR/USD حرکت نمی کنند، این حرکت دنبال نخواهد شد و قیمت به بالای سطح حمایت باز خواهد گشت که نهایتاً منجر به شکست قیمت غیر واقعی می شود.

اگر شما هنوز می خواهید که این معامله را انجام دهید، چون هیچ تاییدیه ی همبستگی ای از سایر جفت ارز ها نگرفته اید، می توانید هوشمندانه عمل کرده و یک معامله ی کوچک باز کرده و ریسک خود را کاهش دهید.

مواظب باشید! همبستگی ارزها تغییر می کنند!

بازار ارز (فراچارت: فارکس) مانند یک مریض می باشد که از اختلال دوقطبی (فراچارت: افراد مبتلا به این بیماری دچار تغییرات شدید خلق می شوند) رنج برده و به طور دائم شکلات می خورد، سطح قندش بالا رفته و تمام روز روحیه پرنوسانی را تجربه می کند.

به هیچ وجه مبالغه نمی کنم.

اگرچه همبستگی ارز بین جفت ارزها به مدت روزها، هفته ها، ماه ها، یا حتی سال ها قوی یا ضعیف باشد، اما نهایتاً تغییر خواهد کرد درست در زمانی که انتظار آن را ندارید...

همبستگی ارز قوی که شما در این ماه می بینید ممکن است که در ماه بعد کاملاً متفاوت باشد.

به جدول 1 نگاهی بیندازید.

EUR/GBP	EUR/JPY	NZD/USD	AUD/USD	USD/CAD	GBP/USD	USD/CHF	EUR/USD	USD/JPY
0.20-	0.14	0.07	0.22-	0.07	0.21-	0.22	0.23-	یک هفته
0.77	0.89	0.64	0.46	0.58-	0.35-	0.52-	0.63-	یک ماه
0.35-	0.24	0.09	0.30-	0.40-	0.62-	0.52	0.62-	سه ماه
0.68-	0.58	0.63-	0.70-	0.43	0.14	0.78	0.62-	شش ماه
0.20-	0.09	0.69-	0.69-	0.67	0.51-	0.74	0.69-	یک سال

ضرایب را بین جفت ارزها در بازه های زمانی (Time Frames) مختلف مقایسه کنید.

متوجه چیزی می شوید؟

برای اکثر مواقع، (با تشکر از USD/JPY!)، کلاً متفاوت هستند که از یک تایم فریم به تایم فریم دیگر تغییر می کنند. و در همه ی جهات تغییر می کنند.



درسی که اینجا می شود گرفت این می باشد که همبستگی ارزها تغییر می کنند، و زیاد هم تغییر می

کنند.

به مقدار بسیار زیادی در یک تایم فریم کوچک می توانند تغییر کنند، همانطور که با نگاه کردن به EUR/USD یک ماهه و سه ماهه واضح و مبرهن است. این نوسان و سوینگ بزرگی است.

به خاطر تغییر احساسات پایدار بازار ارزها، مطمئن شوید که از همبستگی ارز حاضر بازار مطلع می باشید.

به عنوان نمونه، در یک زمان یک هفته ای، همبستگی بین USD/JPY و USD/CHF مقدار 0.22 بود. این یک همبستگی بسیار پایین می باشد و نمایانگر این است که این جفت ارز ها همبستگی قابل توجهی ندارند.

هرچند، اگر ما به اطلاعات سه ماهه برای همین بازه ی زمانی نگاه کنیم، این عدد به 0.52 افزایش می یابد و سپس به 0.78 برای شش ماه و نهایتا به 0.74 برای یک سال می رسد.

در این مثال، می توانید ببینید که این دو جفت ارز، یک "جدایی" در ارتباط همبستگی خود داشته اند (منظور جدائی دوستی زن و مرد!) چیزی که به عنوان یک همبستگی کاملا قوی در بازه ی طولانی بود در بازه ی خیلی کوتاه به صورت شدیدی تضعیف شده است.

اگر اینها یک زن و شوهر واقعی بوده و فقط به مدت یک ماه یا کمتر با هم ارتباط داشتند، احتمالا به این نتیجه می رسیدند که به درد هم نمیخورند و با هم جور نیستند. با اطلاعات کمی که دارند، صبر آنها نهایتا نتیجه خواهد داد. (در آینده با هم سازگار خواهند شد)

اگر به EUR/USD و GBP/USD نگاهی بیندازید، مثالی را می بینید که حدی بوده و نمایانگر این است که همبستگی ارز می تواند به صورت مستمر تغییر کند.

بازه ی زمانی یه هفته ای یک همبستگی قوی با ضریب 0.94 را نشان می دهد!

... اما این ارتباط در مدت زمان یک ماهه به شدت از بین می رود و به 0.13 می رسد، قبل ارتقا دوباره برای سه ماهه به عدد 0.83، سپس سقوط دوباره به یک همبستگی ضعیف در شش ماه بعدی.

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

اینجا یک مثال عالی از اینکه چگونه همبستگی ارز می تواند به سرعت تغییر یابد وجود دارد. بیایید نگاهی به USD/JPY و NZD/USD بیندازیم...

EUR/GBP	EUR/JPY	NZD/USD	AUD/USD	USD/CAD	GBP/USD	USD/CHF	EUR/USD	USD/JPY
0.20-	0.14	0.07	0.22-	0.07	0.21-	0.22	0.23-	یک هفته
0.77	0.89	0.64	0.46	0.58-	0.35-	0.52-	0.63	یک ماه
0.35-	0.24	0.09	0.30-	0.40-	0.62-	0.52	0.62-	سه ماه
0.68-	0.58	0.63-	0.70-	0.43	0.14	0.78	0.62-	شش ماه
0.20-	0.09	0.69-	0.69-	0.67	0.51-	0.74	0.69-	یک سال

ضریب همبستگی یک ساله ی آن ها -0.69 بود. این بیانگر یک همبستگی معمولی تا قوی می باشد. اما اگر شما به همبستگی یک ماهه ی آنها نگاه کنید، ضریب همبستگی اساسا زیر و رو می شود. پس مواظب باشید!

همبستگی ارزها به دلایل متفاوت زیادی تغییر می کنند! این می تواند شامل هر چیز از جمله تغییر نرخ بهره ی یک کشور، تا تغییر سیاست های پولی، یا هر نوع انتخابات اقتصادی یا سیاسی که احساسات معامله گران را بر یک ارز تغییر می دهد باشد.

چگونه همبستگی ارز ها را به وسیله ی Excel محاسبه کنیم.



همانطور که خواندید، همبستگی ها در طول زمان تغییر می کنند. بنابراین دانستن قدرت و جهت ضریب کنونی جفت ارز ها بسیار مهم می شود.

خوشبختانه، شما می توانید همبستگی ارز ها را در خانه و با نرم افزار صفحه گسترده مورد علاقه خود محاسبه کنید. من از نرم افزار Excel استفاده می کنم. اما هر نرم افزاری که از فرمول همبستگی استفاده می کند پاسخگو خواهد بود.

- ما فرض می کنیم که شما اطلاعات بازار را با شعبده بازی از آسمان نمی گیرید، بلکه آن را حالا به هر طریقی از اینترنت دریافت می کنید. بنابراین، قدم اول، همین کار را انجام دهید! اطلاعات شش ماه گذشته ی بازار را دریافت کنید. به خاطر داشته باشید که شما اطلاعاتی را می خواهید که قیمت های بسته شدن روزانه را داشته باشد.
- نرم افزار اکسل را باز کنید.
- اطلاعات خود را در یک صفحه گسترده خالی پیست کنید یا دیتا فایل اکسپورت شده را از مرحله ی 1 باز کنید. اطلاعات شش ماه گذشته ی بازار را دریافت کنید.

- اکنون جدول را طوری تنظیم کنید که مانند یا شبیه جدول زیر شود. رنگ ها و فونت ها به خود شما بستگی دارد. از این مرحله لذت ببرید! هرچند رنگ زرد ممکن است که گزینه ی خوبی نباشد!

	A	B	C	D	E
L11		EUR/USD Close	USD/JPY Close	USD/CHF Close	GBP/USD Close
L12	1/1/2010	1.4318	93.08	1.0348	1.6166
L13	1/4/2010	1.4411	92.54	1.0298	1.6099
L14	1/5/2010	1.4366	91.65	1.0334	1.5993
L15	1/6/2010	1.4412	92.32	1.0275	1.6023
L16	1/7/2010	1.4319	93.27	1.0335	1.5936
L17	1/8/2010	1.4411	92.59	1.0238	1.6029
L18	1/11/2010	1.4526	92.06	1.0151	1.6108
L19	1/12/2010	1.4487	90.95	1.0182	1.6162
L20	1/13/2010	1.4506	91.45	1.0181	1.6283
L21	1/14/2010	1.4496	91.11	1.0184	1.6323
L22	1/15/2010	1.4375	90.81	1.0269	1.6258
L23	1/18/2010	1.4386	90.76	1.0245	1.6326
L24	1/19/2010	1.4304	91.07	1.0311	1.6372
L25	1/20/2010	1.4102	91.23	1.0439	1.6287
L26	1/21/2010	1.4098	90.36	1.0416	1.6208
L27	1/22/2010	1.414	89.87	1.0411	1.611
L28	1/25/2010	1.4153	90.21	1.0392	1.6232
L29	1/26/2010	1.4076	89.66	1.0458	1.614
L30	1/27/2010	1.4018	89.96	1.0499	1.6158
L31	1/28/2010	1.3971	89.85	1.0515	1.6128
L32	1/29/2010	1.3867	90.27	1.0604	1.6
L33					
L34					

- اکنون زمان آن است که بر تایم فریم تصمیم بگیرید. آیا همبستگی ارز هفته ی گذشته را می خواهید؟ ماه گذشته؟ سال گذشته؟ مقدار اطلاعات قیمتی که دارید تعیین کننده ی این موضوع خواهد بود. اما شما همیشه می توانید اطلاعات قیمت بیشتری را از اینترنت بگیرید. برای این مثال، من اطلاعات ماه گذشته را استفاده می کنم.

	A	B	C	D	E	F
118		EUR/USD Close	USD/JPY Close	USD/CHF Close	GBP/USD Close	
119	1/1/2010	1.4318	93.08	1.0348	1.6166	
120	1/4/2010	1.4411	92.54	1.0298	1.6099	
121	1/5/2010	1.4366	91.65	1.0334	1.5993	
122	1/6/2010	1.4412	92.32	1.0275	1.6023	
123	1/7/2010	1.4319	93.27	1.0335	1.5936	
124	1/8/2010	1.4411	92.59	1.0238	1.6029	
125	1/11/2010	1.4526	92.06	1.0151	1.6108	
126	1/12/2010	1.4487	90.95	1.0182	1.6162	
127	1/13/2010	1.4506	91.45	1.0181	1.6283	
128	1/14/2010	1.4496	91.11	1.0184	1.6323	
129	1/15/2010	1.4375	90.81	1.0269	1.6258	
130	1/18/2010	1.4386	90.76	1.0245	1.6326	
131	1/19/2010	1.4304	91.07	1.0311	1.6372	
132	1/20/2010	1.4102	91.23	1.0439	1.6287	
133	1/21/2010	1.4098	90.36	1.0416	1.6208	
134	1/22/2010	1.414	89.87	1.0411	1.611	
135	1/25/2010	1.4153	90.21	1.0392	1.6232	
136	1/26/2010	1.4076	89.66	1.0458	1.614	
137	1/27/2010	1.4018	89.96	1.0499	1.6158	
138	1/28/2010	1.3971	89.85	1.0515	1.6128	
139	1/29/2010	1.3867	90.27	1.0604	1.6	
140						
141						

- در خانه ی خالی اول، زیر جفت ارزی که می خواهید مقایسه کنید (من دارم EUR/USD را با سایر ارزها مقایسه می کنم، پس من با EUR/USD و USD/JPY شروع می کنم)، تایپ کنید: =correl()

130	1/27/2010	1.4018	89.96	1.0499	1.6158
131	1/28/2010	1.3971	89.85	1.0515	1.6128
132	1/29/2010	1.3867	90.27	1.0604	1.6
133			=CORREL(		
134			CORREL(array1, array2)		

- بعد، محدوده ای از سلول ها را برای EUR/USD انتخاب کنید، که با کاما همراه می باشد. شما این محدوده را با یک جعبه نشان خواهید داد.

	A	B	C	
111		EUR/USD Close	USD/JPY Close	USD/CI
112	1/1/2010	1.4318	93.08	
113	1/4/2010	1.4411	92.54	
114	1/5/2010	1.4366	91.65	
115	1/6/2010	1.4412	92.32	
116	1/7/2010	1.4319	93.27	
117	1/8/2010	1.4411	92.59	
118	1/11/2010	1.4526	92.06	
119	1/12/2010	1.4487	90.95	
120	1/13/2010	1.4506	91.45	
121	1/14/2010	1.4496	91.11	
122	1/15/2010	1.4375	90.81	
123	1/18/2010	1.4386	90.76	
124	1/19/2010	1.4304	91.07	
125	1/20/2010	1.4102	91.23	
126	1/21/2010	1.4098	90.36	
127	1/22/2010	1.414	89.87	
128	1/25/2010	1.4153	90.21	
129	1/26/2010	1.4076	89.66	
130	1/27/2010	1.4018	89.96	
131	1/28/2010	1.3971	89.85	
132	1/29/2010	1.3867	90.27	
133			=CORREL(B112:B132	
134			CORREL(array1, array2)	
135				

- بعد از کاما، محدوده اطلاعات USD/JPY را درست همانند EUR/USD انتخاب کنید.

	A	B	C	D
111		EUR/USD Close	USD/JPY Close	USD/CHF Close
112	1/1/2010	1.4318	93.08	1.0348
113	1/4/2010	1.4411	92.54	1.0298
114	1/5/2010	1.4366	91.65	1.0334
115	1/6/2010	1.4412	92.32	1.0275
116	1/7/2010	1.4319	93.27	1.0335
117	1/8/2010	1.4411	92.59	1.0238
118	1/11/2010	1.4526	92.06	1.0151
119	1/12/2010	1.4487	90.95	1.0182
120	1/13/2010	1.4506	91.45	1.0181
121	1/14/2010	1.4496	91.11	1.0184
122	1/15/2010	1.4375	90.81	1.0269
123	1/18/2010	1.4386	90.76	1.0245
124	1/19/2010	1.4304	91.07	1.0311
125	1/20/2010	1.4102	91.23	1.0439
126	1/21/2010	1.4098	90.36	1.0416
127	1/22/2010	1.414	89.87	1.0411
128	1/25/2010	1.4153	90.21	1.0392
129	1/26/2010	1.4076	89.66	1.0458
130	1/27/2010	1.4018	89.96	1.0499
131	1/28/2010	1.3971	89.85	1.0515
132	1/29/2010	1.3867	90.27	1.0604
133			=CORREL(B112:B132,C112:C132)	
134			CORREL(array1, array2)	

- کلید اینتر را فشار دهید تا ضریب همبستگی برای EUR/USD و USD/JPY محاسبه شود.

131	1/28/2010	1.3971	89.85	
132	1/29/2010	1.3867	90.27	
133			0.629644119	
134				

- مراحل 5-9 را برای سایر جفت ارز ها یا سایر تایم فریم ها تکرار کنید. وقتی که کارتان تمام شد، شما می توانید اطلاعات جدید را بردارید و یک جدول باحال دقیقاً مانند زیر تهیه کنید.

134				
135		EUR/USD Close	USD/JPY Close	USD/CHF Close
136	1 Week		-0.23	-1.00
137	1 Month		0.63	-0.98
138	3 Months		-0.62	-0.92
139	6 Months		0.29	0.33
140				
141				

بازه های زمانی یک هفته ای، یک ماهه، سه ماهه، شش ماهه، و یک ساله می تواند کاملترین دید از همبستگی بین جفت ارز ها را نشان دهند. اما این کاملاً به شما بستگی دارد که کدام تایم فریم و چند تایم فریم را می خواهید تحلیل کنید....

درحالی که ممکن است به روز کردن اطلاعات شما برای هر روز خسته کننده به نظر بیاید، مگر اینکه شما یک معتاد همبستگی ارز باشید، به روز کردن آنها حداقل هفته ای یک بار کافی خواهد بود.

اگر متوجه شوید که دارید به صورت دستی هر یک ساعت یکبار با Excel جدول همبستگی ارز خود را به روز می کنید، شما نیاز به این دارید که بیرون بروید و یک سرگرمی برای خود پیدا کنید.

خلاصه: همبستگی ارزها



مثل شناگر های هماهنگ، برخی جفت ارز ها به صورت کاملاً تنگاتنگ با هم حرکت می کنند.

و برخی جفت ارزها مثل دو قطب همنام آهنربا که همدیگر را دفع می کنند در خلاف جهت همدیگر حرکت می کنند. وقتی که شما به طور همزمان چند جفت ارز را با هم معامله می کنید، مهمترین چیز این است که همیشه از مقدار ریسک در معرض خطر خود مطلع باشید.

شاید اعتقاد شما این باشد که با معامله در جفت ارز های مختلف ریسک خود را تقسیم می کنید، اما باید بدانید که بسیاری از جفت ارز ها تمایل دارند که در یک جهت همسان حرکت کنند.

با معامله در جفت ارز هایی که به صورت خیلی قوی همبستگی دارند، شما فقط دارید ریسک خود را چند برابر می کنید.

همبستگی بین جفت ارزها می تواند خیلی قوی یا ضعیف باشد و برای هفته ها، یا ماه ها، و یا حتی سال ها دوام داشته باشد. اما همیشه باید بدانید که این همبستگی ها خیلی سریع می توانند عوض شوند.

به روز بودن با همبستگی ارزها اگر که می خواهید معاملات خود را افزایش دهید، از سرمایه خود حفاظت کنید یا معاملات خود را متنوع کنید، به شما کمک می کند که تصمیمت بهتری بگیرید.

نکات دیگری که باید به خاطر بسپارید

- ضرایب بر اساس قیمت های بسته شدن روزانه محاسبه می شوند.
- ضرایب مثبت نشانگر این هستند که دو جفت ارز به صورت مثبتی با هم همبستگی دارند، که به این معنی می باشد که در حالت کلی در جهت همدیگر حرکت می کنند.
- ضرایب منفی نشانگر این هستند که دو جفت ارز به صورت منفی با هم همبستگی دارند، که به این معنی می باشد که در حالت کلی در خلاف جهت همدیگر حرکت می کنند.
- مقادیر ضریب همبستگی +1 یا -1 و یا نزدیک به آنها به این معنی می باشد که دو جفت ارز به مقدار بسیار بالایی همبسته می باشند.
- همبستگی ها می توانند به عنوان حفاظت از سرمایه، متنوع کردن و افزایش معاملات استفاده شده و شما را از معاملاتی که اثر همدیگر را خنثی کنند دور نگه دارد.

مثال هایی از جفت ارز هایی که به صورت هم جهت حرکت می کنند.

- EUR/USD و GBP/USD
- EUR/USD و AUD/USD
- EUR/USD و NZD/USD
- USD/CHF و USD/JPY
- AUD/USD و NZD/USD

جفت ارز هایی که به صورت معمول در خلاف جهت همدیگر حرکت می کنند.

- EUR/USD و USD/CHF
- GBP/USD و USD/JPY
- USD/CAD و AUD/USD
- USD/JPY و AUD/USD
- GBP/USD و USD/CHF

وقتی که شما می خواهید دو جفت ارز را که کاملاً با هم همبسته می باشند را معامله کنید، مشکلی ندارد که هر دو را انجام دهید. فقط مطمئن شوید که قوانین محکمی دارید که معاملات با جفت ارز همبسته را معامله می کنید و همیشه به قوانین مدیریت ریسک خود پایبند باشید.