

(Currency Correlation) آشنایی و استفاده از همبستگی ارزها

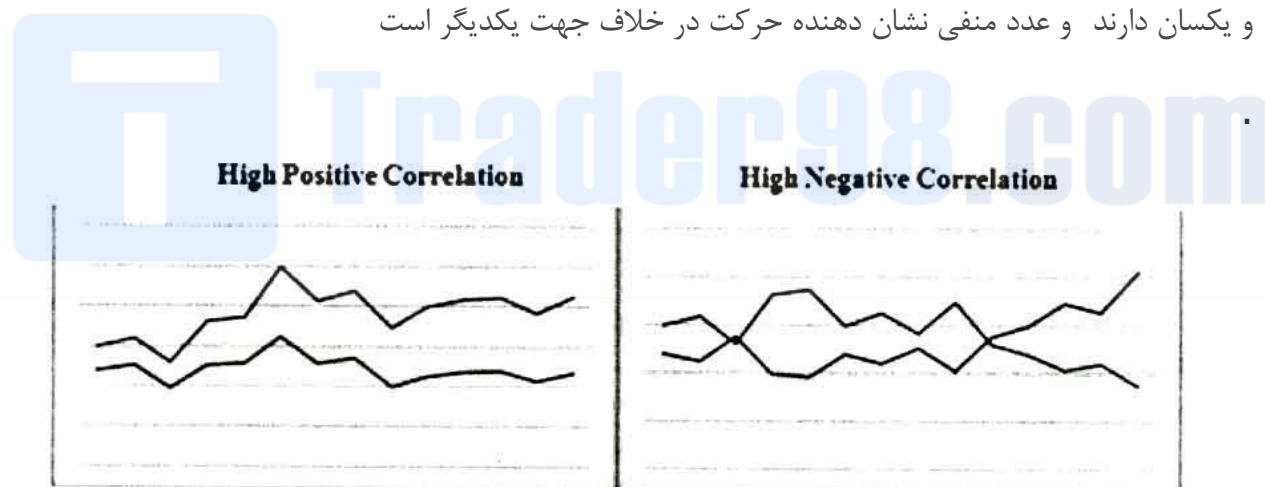
یک معامله گر حرفه ای برای ورود به بازار فقط و فقط بر روی یک جفت ارز معامله نمی کند و برای تعدیل ریسک و اطمینان بیشتر از جفت ارزهای مختلف به طور همزمان استفاده می کند. به عنوان مثال اگر شما تصمیم به خرید یورو در مقابل دلار آمریکا را دارید می توانید همزمان با این خرید ، پوند در مقابل دلار آمریکا را نیز بخرید. در واقع به جای خرید یک لات از یورو و دلار، می توانید نیم لات یورو / دلار و نیم لات پوند/دلار را خریداری کنید، حال این سبک معامله چه مزیتی دارد و اصلا چرا شما پوند دلار را انتخاب کردید ؟

فرض کنید شما به جدول همبستگی ارزها مراجعه کردید و با مطالعه جدول که در ادامه توضیح داده می شود به همبستگی مثبت 90 درصدی یورو و لادر و پوند دلار پی بردید، این همبستگی به شما می گوید که اگر یورو دلار افزایش یابد، پوند دلار نیز افزایش می یابد، به عبارت دیگر اگر یورو دلار یک پوینت بالا رود، 90 درصد احتمال بالا رفتن پوند دلار نیز وجود دارد. چون حرکت این دو جفت ارز بسیار شبیه به یکدیگر است بنابراین این دو جفت ارز را می توان یکی فرض کرد و میزان لاتی را که برای خرید خود در نظر گرفته بودیم را بین این دو جفت ارز تقسیم کنیم. حرکت یکسان این دو جفت ارز باعث تولید شدن دو نمودار شبیه به هم می شود، زمانی که شما می خواستید در یورو دلار به تنهایی معامله کنید تنها یک نمودار برای مطالعه داشتید اما با کنک جدول همبستگی ها شما نمودار دیگری مثل پوند دلار را پیدا کردید که تحلیل آن برای پیش بینی یورو دلار نیز مفید است. به همین ترتیب شما می توانید تعداد زیادی نمودار که مشابه با نمودار یورو دلار است را مطالعه کنید و با دقت بیشتری حرکت یورو دلار را تحلیل کنید، فرض کنید در معامله فوق شما به درستی حدس زده باشید که یورو دلار افزایش می یابد پس شما در این خرید به میزان نیم لات سود دهی داتید و از طرف دیگر چون حرکت پوند دلار بسیار مشابه با یورو دلار بوده نمودار آن هم بالا رفته و به شما با نیم لات دیگر سود رسانده، اما چون شباهت این دو صد در صد نبوده پوند دلار با کمی تاخیر نسبت به یورو دلار وارد سود می شود و این تاخیر زمانی همان کاهش ریسک در این معامله می باشد چون اگر تحلیل شما اشتباه می بود و یورو دلار وارد ضرر می شد شما با نیم لات ضرر می کردید و قبل از اینکه پوند دلار وارد ضرر شود خرید خود را بر روی آن متوقف می کردید. در واقع با این روش سود شما همان یک لاتی است که می خواستید و ضرر شما کمتر از یک لات بوده اما به خاطر داشته باشید که همیشه جفت ارزهایی مانند مثال فوق با هم همبستگی ندارند و شما می بایست هر روز به جدول همبستگی ها نگاه کنید که اگر جفت ارزهای مورد نظر شما همبستگیشان را از دست داده باشند شما به دنبال جفت ارزهای دیگر باشید. در زیر نمونه ای از این جداول را مشاهده می نمایید:

Correlation 1 H									
	EURUSD	GBPUSD	USDCHF	USDJPY	EURGBP	EURCHF	EURJPY	GBPCHF	GBPJPY
EURUSD	100.0	-42.7	12.3	92.6	34.8	-21.2	-24.4	-33.9	-18.6
GBPUSD	-42.7	100.0	-85.4	-44.2	-58.7	32.7	89.7	59.5	93.5
USDCHF	12.3	-85.4	100.0	13.0	30.7	-8.2	-86.0	-30.2	-88.0
USDJPY	92.6	-44.2	13.0	100.0	41.4	-21.6	-22.5	-38.9	-18.2
EURGBP	34.8	-58.7	30.7	41.4	100.0	-45.5	-31.1	-96.2	-41.1
EURCHF	-21.2	32.7	-8.2	-21.6	-45.5	100.0	35.5	52.9	31.8
EURJPY	-24.4	89.7	-86.0	-22.5	-31.1	35.5	100.0	36.9	96.1
GBPCHF	-33.9	59.5	-30.2	-38.9	-96.2	52.9	36.9	100.0	46.3
GBPJPY	-18.6	93.5	-88.0	-18.2	-41.1	31.8	96.1	46.3	100.0

(c) www.Mataf.net - Forex Trading

در این جدول اعداد مثبت و منفی می بینید که عدد مثبت نشان دهنده این است که جفت ارزها حرکت مشابه و یکسان دارند و عدد منفی نشان دهنده حرکت در خلاف جهت یکدیگر است



اعداد کمتر از 60 دارای همبستگی ضعیف و بی ارزش هستند و اعداد بالای 80 همبستگی بالا و با ارزشی دارند. همبستگی های منفی و بالای 80 نیز مانند همبستگی مثبت بالای 80 با ارزش می باشند. به عنوان مثال اگر یورو دلار همبستگی بالای 80- با دلار سوییس فرانک داشته باشد می توانید همزمان با خرید یورو دلار به مقداری دلخواه از لات دلار سوییس فرانک را بفروشید و بالعکس. فقط بایستی توجه داشته باشید که اعداد ارائه شده برای همبستگی در تایم های مختلف فرق می کند. برای نمونه ممکن است دو جفت ارز X و Y

در تایم 4 ساعته دارای همبستگی +85 باشند در حالی که در تایم 1 ساعته دارای همبستگی +55 باشند که هر یک از آنها تحلیل مخصوص به خود را دارا می باشد.

شما می توانید میزان همبستگی ها را محاسبه کنید اما با استفاده از جداول آماده می توانید زمان بیشتری را به تحلیل خود اختصاص دهید.

متأسفانه بسیاری از معامله گران بدون اطلاع از تاثیر پذیری جفت ارزها از یکدیگر بر روی جفت ارزهای متقاطع اقدام به معامله می کنند و اغلب ضررهایی بیش از حد، متحمل می شوند. در بازار تبادلات ارزی با داشتن قیمت دو جفت ارز نسبت به ارزی ثابت میتوان قیمت آن دو جفت ارز را نسبت به هم محاسبه نمود که یکی از سه حالت زیر برایشان وجود دارد.

$$A \text{ — } C \quad C \text{ — } B$$

$$AC * CB = A/B$$

$$(GBP/USD) * (USD/JPY) = GBP/JPY$$

$$A \text{ — } C \quad B \text{ — } C$$

$$AC/BC = A/B$$

$$(EUR/USD) / (GBP/USD) = EUR/GBP$$

$$C \text{ — } A \quad C \text{ — } B$$

$$CB/CA = AB$$

$$(USD/CHF)/(USD/JPY) = CHF/JPY$$

حالا USD/JPY 118.85 در حال حاضر 1.9717 و قیمت جفت ارز GBP/USD مثال: قیمت جفت ارز

چقدر می باشد؟ GBP/JPY می باشد قیمت جاری جفت ارز

$$1.9717 * 118.85 = 234.33$$

حالا EUR/USD 1.2792 در حال حاضر 1.8864 و قیمت جفت ارز GBP/USD مثال: قیمت جفت ارز

چقدر می باشد؟ EUR/GBP می باشد قیمت جاری جفت ارز

$$1.2792 / 1.8864 = 0.6781$$

حالا USD/JPY 118.59 در حال حاضر 1.2211 و قیمت جفت ارز USD/CHF مثال: قیمت جفت ارز

چقدر می باشد؟ CHF/JPY می باشد قیمت جاری جفت ارز

$$118.59 / 1.2211 = 97.11$$

بدیهی است قیمت های بروکر ها به خاطر اسپرد و تاخیر زمانی ممکن است چند پیپ با قیمت های محاسباتی

ما متفاوت باشند اما در کل، قیمت کراس ها به این صورت قابل محاسبه خواهند بود

بدین ترتیب با وابستگی ارزش ذاتی ارز هر کشوری در مقابل سایر ارزها قابل استنباط است که همه ارزهای جهانی دارای ارزش ثابتی برای خود باشند و با کم شدن ارزش پول هر کشوری تمامی ارزهای جهانی در مقابل آن ارز با افزایش ارزش روبرو شده اند. این مساله در مورد قوی شدن پول کشورها نیز صادق است. از همبستگی ارزها زمانی استفاده می شود که معامله گر رفتار متفاوتی را برای ارزهایی خاص در مقابل ارزی خاص انتظار دارند و می توانند به جای دو معامله بر روی دو جفت ارز، یک معامله بر روی جفت ارز متقاطع انجام دهند. به عنوان نمونه تحلیلی داریم از صعود قیمت در نمودار پوند به دلار و در عین حال تحلیل نمودار دلار به ین نیز از صعود حکایت دارد. بدین ترتیب می توان برای کاهش ریسک احتمالات در بازار و بالا بردن احتمال سود دهی، معامله ای بر روی پوند به ین انجام داد. در این صورت حتی اگر یکی از دو تحلیل پوند به دلار یا دلار به ین درست نباشد باز نمودار پوند به ین صعودی خواهد بود و ضرری متوجه حساب نمی شود. در عین حال حتی در صورتی که معامله ای بر روی جفت ارز متقاطع انجام نمی شود همیشه پیشنهاد می شود تحلیل بنیادی یا تکنیکی همبستگی هر ارز خاص را در مقابل ارزهای دیگر نیز انجام شود تا ریسک کمتری متوجه معاملات شود.



Trader98.com