



همبستگی یا به طور دقیق تر، ضریب همبستگی، یک مفهوم آماری است که میزان حرکت دو متغیر را نسبت به یکدیگر اندازه گیری می کند. به عبارت ساده تر، این نشان دهنده چگونگی حرکت پیچها نسبت به هم است، فواید در یک سو باشند یا در زمانی که مخالف هم حرکت می کنند. وقتی در مورد همبستگی از نظر معاملات فارکس صحبت می کنیم، اساساً در مورد ارتباط حرکت بین دو جفت ارز صحبت می کنیم.

#### تعریف همبستگی و ضریب همبستگی

در ابتدای ترین شکل خود، همبستگی معیاری است که نشان می دهد حرکت دو متغیر چه ارتباطی بهم دارد. ضریب همبستگی یک نمایش عددی از این رابطه است که درجه همبستگی را کمی می کند. این مقدار عددی بین 1- و 1 قرار دارد. ضریب همبستگی 1 دلالت بر همبستگی مثبت کامل دارد. این بدان معناست که وقتی یک متغیر به سمت بالا حرکت می کند، دیگری نیز به همان نسبت حرکت می کند. از سوی دیگر، ضریب همبستگی 1- نشان دهنده همبستگی

منفی کامل است، یعنی وقتی یک متغیر افزایش می‌یابد، متغیر دیگر به همان نسبت کاهش می‌یابد. ضریب همبستگی صفر به این معنی است که هیچ رابطه فطی قابل مشاهده ای بین متغیرها وجود ندارد.

انواع مختلف همبستگی: همبستگی مثبت، منفی و بدون همبستگی

همانطور که در بالا اشاره شد، همبستگی را می‌توان به طور کلی به سه نوع طبقه بندی کرد: همبستگی مثبت، منفی و بدون همبستگی. در همبستگی مثبت، جفت ارزها یا متغیرها در یک جهت حرکت می‌کنند. در همبستگی منفی، آنها در جهت مخالف حرکت می‌کنند. در این میان، اگر همبستگی وجود نداشته باشد، حرکت یک متغیر تأثیر روشنی بر حرکت متغیر دیگر ندارد.

توضیح چگونگی همبستگی با عددی بین 1- و 1

در معاملات فارکس، همبستگی بین جفت ارزها می‌تواند بینش مهمی در مورد پویایی بازار و استراتژی‌های مدیریت ریسک ارائه دهد. بخش بعدی به استفاده عملی از همبستگی ارز در معاملات می‌پردازد و نمونه فواندن جدول همبستگی ارز و نمونه مناسبه همبستگی ارزها را توضیح می‌دهد - مهارت‌هایی که برای هر معامله‌گری، حیاتی است و به طور گسترده در اکثر آموزش‌های فارکس پوشش داده شده است.

**اهمیت همبستگی در معاملات فارکس**



## مزایای درک همبستگی در فارکس

مزایای درک همبستگی در معاملات فارکس بسیار زیاد است. در مرحله اول، به پیش بینی حرکت یک جفت ارز بر اساس حرکت یک جفت ارز دیگر کمک می کند. ثانیاً، این یک مؤلفه اساسی مدیریت ریسک است - با دانستن همبستگی، معامله گران می توانند از ورود به معاملاتی که احتمالاً در جهت مخالف حرکت می کنند اجتناب کنند و در نتیجه زیان های احتمالی را کاهش دهند. در نهایت، درک همبستگی می تواند به معامله گران کمک کند تا سبدهای متنوعی ایجاد کنند و استراتژی های معاملاتی خود را با قرار نگرفتن بیش از حد خود در معرض یک ارز واحد یا جفت ارزهای مرتبط بهبود بخشند.

## توضیح تنوع ریسک در فارکس از طریق درک همبستگی

تنوع ریسک یک مفهوم کلیدی در معاملات فارکس است و درک همبستگی جزء جدایی ناپذیر آن است. با معامله جفت ارزهایی که دارای همبستگی مثبت هستند، خطر دو برابر شدن قرار گرفتن در معرض تغییرات بازار را دارید. با این حال، با درک همبستگی ها و فرید و فروش عمدی جفت هایی که همبستگی یا همبستگی منفی ندارند، می توانید ریسک را در جفت های ارزهای مختلف پخش کنید، که منجر به ایجاد یک سبد متنوع تر و متعادل تر می شود.



در موزه معاملات فارکس، درک همبستگی بین جفت ارزهای مختلف یک عامل کلیدی در اتخاذ تصمیمات تجاری استراتژیک و موثر است.

توضیح اینکه چگونه درک همبستگی ارز می تواند استراتژی های معاملاتی را بهبود بخشد

درک همبستگی ارز می تواند به طور قابل توجهی استراتژی های معاملاتی فارکس شما را افزایش دهد. به عنوان مثال، اگر دو جفت ارز دارای همبستگی مثبت باشند، یک معامله گر می تواند از حرکت یک جفت برای پیش بینی حرکت جفت دیگر استفاده کند. اگر یک جفت همبستگی مثبت از الگوی معمول پیروی نکند، می تواند سیگنالی باشد که روند فعلی بازار در شرف تغییر است.

علاوه بر این، اگر یک معامله گر ببیند که دو جفت همبستگی منفی دارند، ممکن است تصمیم بگیرد که در یکی از آنها معامله فرید و از سوی روی دیگر معامله فروش باز کند و به طور بالقوه از هر دو معامله سود ببرد.

در نتیجه، استفاده از همبستگی ارز در معاملات ابزار قدرتمندی برای پیش بینی حرکت بازار، مدیریت ریسک و متنوع سازی معاملات است. توانایی درک و استفاده موثر از این ابزار با تمرین مداوم و آموزش کامل فارکس تقویت

می شود. این شامل دانستن نحوه خواندن جدول همبستگی ارز و نحوه مناسبه همبستگی ارزها است که هر دو مهارت های میانی در معاملات فارکس هستند.

### نمونه مناسبه همبستگی ارزها

	EUR/USD	GBP/USD	XAG/USD	WTICO	CAD/JPY	NATGAS	XAU/USD	USD/JPY	USD/CAD
EUR/USD		77	54	50	47	24	19	-46	-79
GBP/USD	77		17	42	46	58	-22	-56	-85
XAG/USD	54	17		11	24	-6	81	-24	-40
WTICO	50	42	11		54	-15	-28	7	-46
CAD/JPY	47	46	24	54		18	2	31	-71
NATGAS	24	58	-6	-15	18		-18	-48	-52
XAU/USD	19	-22	81	-28	2	-18		-6	-6
USD/JPY	-46	-56	-24	7	31	-48	-6		45
USD/CAD	-79	-85	-40	-46	-71	-52	-6	45	

### مماسبه همبستگی جفت ارزها

داده های خود را جمع آوری کنید: برای دو جفت ارز به داده های تاریخی قیمت نیاز دارید. برای سادگی، فرض کنید قیمت های بسته شدن جفت EUR/USD و GBP/USD را برای 10 روز گذشته داریم.

مماسبه تغییرات قیمت: شما باید درصد تغییر قیمت را از یک روز به روز دیگر برای هر جفت مناسبه کنید. فرمول بازگشت: (قیمت در زمان B - قیمت در زمان A) / قیمت در زمان A.

مماسبه میانگین (متوسط) تغییر قیمت برای هر جفت: تمام تغییر قیمتها را برای هر جفت جمع کنید و بر تعداد دوره ها (در مثال ما 10 روز) تقسیم کنید.

انحراف معیار هر تخییر قیمت را نسبت به میانگین مناسبه کنید: بازده میانگین را از هر تخییر قیمت جداگانه کم کنید. این کار را برای هر دو جفت انجام دهید.

به توان 2 رساندن انحراف معیاده: هر انحراف مناسبه شده در مرحله 4 را در نظر بگیرید و آن را به توان 2 برسانید. سپس، این انحرافات مجذور را برای هر جفت ارز جداگانه جمع کنید و بر تعداد دوره ها منهای یک تقسیم کنید (این واریانس است).

مناسبه کوواریانس: انحرافات از میانگین هر جفت را برای هر دوره زمانی با هم ضرب کنید، آنها را جمع کنید و بر تعداد دوره های منهای یک تقسیم کنید. این به شما کوواریانس می دهد.

مناسبه انحراف معیار: جذر واریانس برای هر جفت انحراف معیار آنها را به شما می دهد.

همبستگی را مناسبه کنید: کوواریانس را بر حاصلضرب انحراف معیار هر جفت تقسیم کنید. این به شما ضریب همبستگی را می دهد، عددی بین 1- و 1.

مثال هایی از همبستگی دارایی ها در بازار فارکس

ارتباط بین جفت ارزها در بازار فارکس

EUR/USD و GBP/USD: این دو جفت همبستگی مثبت بالایی دارند، معمولاً بالای 0.75+. این به این معنی است که وقتی یورو/دلار آمریکا افزایش یا کاهش می یابد، پوند/دلار آمریکا احتمالاً در اکثر مواقع در همین جهت است. این عمدتاً به این دلیل است که هر دو جفت به شدت تحت تأثیر عوامل و رویدادهای اقتصادی مشابه هستند.

USD/CAD و AUD/USD: این دو جفت همبستگی منفی قوی، اغلب در حدود 0.80- دارند. این بدان معناست که وقتی جفت USD/CAD بالا می رود، جفت AUD/USD معمولاً پایین می آید و بالعکس. این عمدتاً به دلیل ارتباط آنها با دلار آمریکا و پیچیدگی تأثیر قیمت کالاها (مانند نفت برای کانادا و طلا برای استرالیا) بر این اقتصادها است.



EUR/USD و USD/CHF: این جفت ها همچنین دارای همبستگی منفی قوی هستند که اغلب در محدوده -0.90 است. وقتی جفت EUR/USD افزایش می یابد، جفت USD/CHF تمایل به کاهش دارد. این اتفاق می افتد زیرا فرانک سوئیس به عنوان یک ارز امن شناخته شده است و اغلب در جهت مخالف یورو حرکت می کند.

AUD/USD و طلا: اگرچه AUD/USD یک جفت ارز نیست، اما AUD/USD اغلب همبستگی مثبتی با قیمت طلا دارد. دلیل این امر این است که استرالیا یکی از بزرگترین تولیدکنندگان طلا در جهان است، بنابراین ارزش پول آن می تواند تحت تأثیر قیمت طلا قرار گیرد.

ارتباط بین جفت ارز ها و کالاها در بازار فارکس

AUD/USD و طلا: به عنوان یکی از بزرگترین تولیدکنندگان طلا در جهان، اقتصاد و ارز استرالیا می تواند به شدت تحت تأثیر قیمت طلا قرار گیرد. اگر قیمت طلا افزایش یابد، اغلب منجر به تقویت دلار استرالیا می شود، زیرا می تواند درآمدهای صادراتی کشور را افزایش دهد. بنابراین، اغلب یک همبستگی مثبت بین جفت AUD/USD و قیمت طلا وجود دارد.

USD/CAD و نفت خام: کانادا یکی از بزرگترین صادرکنندگان نفت در جهان است و اقتصاد کانادا و وامد پول آن می تواند به طور قابل توجهی تحت تأثیر نوسانات قیمت نفت قرار گیرد. زمانی که قیمت نفت افزایش می یابد، به دلیل افزایش درآمدهای صادراتی، اغلب منجر به قوی تر شدن دلار کانادا می شود که منجر به کاهش جفت USD/CAD می شود. بنابراین، جفت USD/CAD و قیمت نفت خام معمولاً همبستگی معکوس دارند.

NZD/USD و قیمت لبنیات: نیوزلند صادرکننده عمده محصولات لبنی است. هنگامی که قیمت لبنیات افزایش می یابد، به دلیل افزایش درآمدهای صادراتی، می تواند دلار نیوزیلند را تقویت کند و باعث افزایش جفت NZD/USD شود. بنابراین، می تواند همبستگی مثبتی بین جفت NZD/USD و قیمت لبنیات وجود داشته باشد.

AUD/USD و سنگ آهن: استرالیا نیز صادرکننده عمده سنگ آهن است. اگر قیمت سنگ آهن افزایش یابد، اغلب می تواند منجر به تقویت دلار استرالیا شود و باعث افزایش جفت AUD/USD شود. بنابراین، جفت AUD/USD و قیمت سنگ آهن معمولاً همبستگی مثبت دارند.

ارتباط بین جفت ارزها و شاخص های سهامی در بازار فارکس

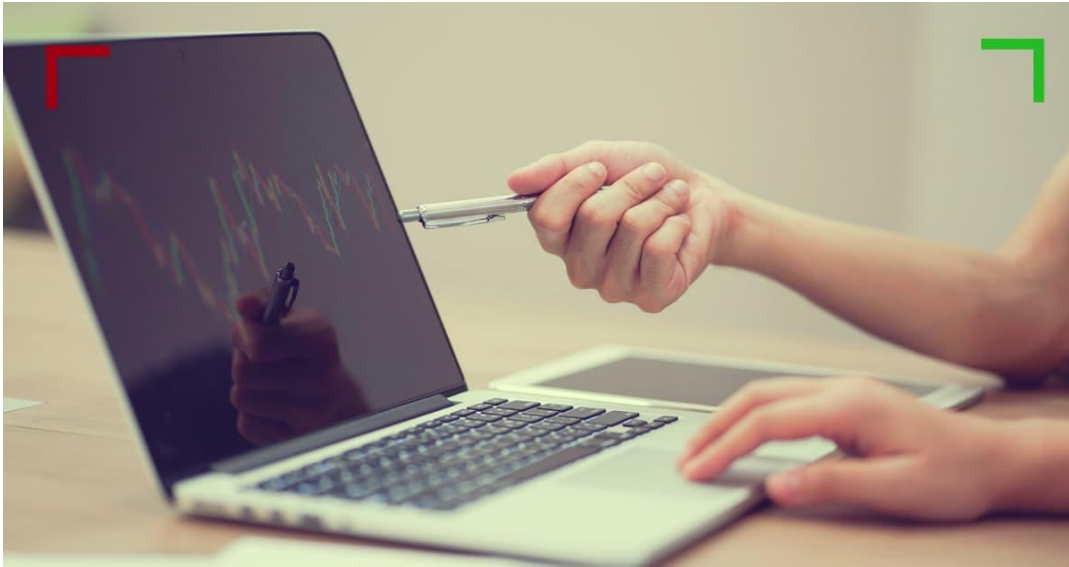
USD/JPY و Nikkei 225: جفت ارز USD/JPY اغلب با شاخص سهام Nikkei 225 ژاپن همبستگی مثبت دارد. هنگامی که اقتصاد ژاپن قوی است، نیکی تمایل به افزایش دارد، که همچنین می تواند منجر به تقویت ین شود و باعث سقوط جفت USD/JPY شود. برعکس، زمانی که نیکی سقوط می کند، اغلب منجر به ضعیف تر شدن ین و افزایش جفت USD/JPY می شود.

EUR/USD و DAX: شاخص سهام DAX آلمان اغلب با جفت EUR/USD همبستگی مثبت دارد. زمانی که اقتصاد آلمان فوب عمل می کند، DAX تمایل به افزایش دارد که می تواند یورو را نیز تقویت کند و باعث افزایش جفت یورو/دلار شود. برعکس، زمانی که DAX سقوط می کند، اغلب نشان دهنده ضعف در اقتصاد آلمان است و می تواند منجر به ضعیف تر شدن یورو و کاهش جفت EUR/USD شود.

AUD/USD و S&P/ASX 200: شاخص S&P/ASX 200 استرالیا اغلب همبستگی مثبتی با جفت AUD/USD دارد. هنگامی که اقتصاد استرالیا قوی است، S&P/ASX 200 تمایل به افزایش دارد که می تواند دلار استرالیا را نیز تقویت کند و باعث افزایش جفت AUD/USD شود. برعکس، زمانی که S&P/ASX 200 سقوط می کند، اغلب نشانه ضعف در اقتصاد استرالیا است که می تواند دلار استرالیا را تضعیف کند و باعث سقوط جفت AUD/USD شود.

USD و S&P 500: رابطه پیچیده ای بین دلار آمریکا و شاخص S&P 500 وجود دارد. دلار قوی تر می تواند نشانه قدرت اقتصادی باشد، اما همچنین می تواند صادرات ایالات متحده را گران تر و در نتیجه رقابتی تر کند، که می تواند به سود شرکت های S&P 500 لطمه بزند. بنابراین، همبستگی بین دلار و S&P 500 می تواند متفاوت باشد. بر اساس زمینه اقتصادی گسترده تر.





مانند هر مهارت دیگری، تسلط بر استفاده از همبستگی در معاملات فارکس نیازمند تمرین، پشتکار و آموزش است. در اینجا نمونه تقویت درک خود از همبستگی آورده شده است:

اهمیت آموزش مداوم فارکس برای تسلط بر همبستگی

دنیای معامله گری فارکس پویا و دائماً در حال تحول است، و همینطور همبستگی بین جفت ارزها. آموزش فارکس نقش مهمی در درک این پویایی دارد. این آموزش مداوم در ایجاد درک قوی از همبستگی بسیار مفید است و به شما این امکان را می دهد که تصمیمات تجاری آگاهانه بگیرید.

نکاتی برای تمرین و بهبود درک همبستگی در معاملات فارکس

در اینجا چند نکته برای تمرین و افزایش درک شما از همبستگی وجود دارد:

به طور منظم جداول همبستگی ارز را مرور کنید: این به شما کمک می کند تا از آخرین روندهای همبستگی به روز باشید و ببینید که چگونه آنها در بازه های زمانی مختلف تغییر پیدا می کنند.

از مساب‌های آزمایشی استفاده کنید: بسیاری از پلتفرم‌های فارکس مساب‌های دمو را ارائه می‌دهند که در آن می‌توانید معامله‌گری با پول مجازی را تمرین کنید. این می‌تواند یک راه عالی برای آزمایش درک شما از همبستگی ارز بدون خطر واقعی باشد.

مساب‌ات خود را انجام دهید: سعی کنید همبستگی ارزها را به صورت دستی مناسبه کنید. این تمرین می‌تواند درک شما را از مفهوم همبستگی تقویت کند.

ترکیب با تحلیل‌های دیگر: صرفاً به همبستگی تکیه نکنید. از آن در ارتباط با سایر تحلیل‌های تکنیکال و بنیادی استفاده کنید.

آموزش فارکس که بر روی همبستگی و استفاده از همبستگی ارز در معاملات تمرکز دارد، می‌تواند استراتژی‌های معاملاتی فارکس شما را تا مد زیادی بهبود بخشد. با دانستن نحوه خواندن جدول همبستگی ارز و مناسبه همبستگی ارزها، می‌توانید تصمیمات معاملاتی آگاهانه و بالقوه سودآورتری بگیرید.

## نتیجه

درک همبستگی و ضریب همبستگی یک جنبه میانی در معامله‌گری در بازار فارکس است. اهمیت آن در پیش‌بینی بازار، مدیریت ریسک و تنوع استراتژی تجاری قابل اغراق نیست.

تسلط بر استفاده از همبستگی ارز در معاملات می‌تواند تا مد زیادی استراتژی‌های معاملاتی شما را ارتقا دهد. این بینشی در مورد نحوه حرکت جفت ارزهای مختلف در رابطه با یکدیگر ارائه می‌دهد و سرنخ‌های ارزشمندی در مورد حرکت بازار و فطرات بالقوه ارائه می‌دهد. از دانستن زمان ورود یا خروج از معاملات تا اجتناب از قرار گرفتن بیش از مد در معرض یک ارز وامد، همبستگی به عنوان یک ابزار قدرتمند در زرادخانه یک معامله‌گر فارکس عمل می‌کند.

توانایی خواندن دقیق جدول همبستگی ارز یک مهارت به همان اندازه مهم است. این یک درک واضح و در یک نگاه از نحوه ارتباط جفت ارزها با یکدیگر در یک دوره فاص ارائه می‌دهد. این می‌تواند به عنوان یک راهنمای جهت‌دار برای معاملات شما باشد و به شما در تصمیم‌گیری آگاهانه کمک کند.

علاوه بر این، دانستن نحوه مناسبه همبستگی ارزها به درک عمیق‌تری از پویایی بازار کمک می‌کند. در حالی که ابزارهای موجود برای این کار وجود دارد، انجام دستی آن حداقل چند بار به تقویت مفهوم کمک می‌کند.

آموزش فارکس همچنان بخش مهمی از این سفر است. یادگیری مداوم، تمرین و سفت کوشی کلیدهای تسلط بر این مهارت ها هستند. این سفر ممکن است در ابتدا دلهره آور به نظر برسد، اما با گذشت زمان و تمرین، می توانید با اطمینان بیشتر و سودآوری بالقوه در بازار فارکس حرکت کنید.

در پایان، همبستگی چیزی بیش از یک اندازه گیری آماری است - این قطب نمایی است که معامله گران فارکس را از طریق مسیرهای پیچیده بازار راهنمایی می کند. سفر به درک همبستگی ممکن است چالش برانگیز باشد، اما مطمئناً ارزشمند است و ارزش انجام آن را دارد.

همبستگی در معاملات فارکس چیست؟

همبستگی در معاملات فارکس به رابطه آماری بین دو جفت ارز اشاره دارد. اگر دو جفت ارز در یک جهت حرکت کنند، گفته می شود که همبستگی مثبت دارند. اگر در جهت مخالف حرکت کنند، همبستگی منفی دارند.

ضریب همبستگی 1- نشان دهنده چیست؟

پاسخ: ضریب همبستگی 1- نشان دهنده همبستگی منفی کامل است. این بدان معناست که وقتی یک متغیر افزایش می یابد، متغیر دیگر به همان نسبت کاهش می یابد.

چرا درک همبستگی در معاملات فارکس مهم است؟

پاسخ: درک همبستگی در معاملات فارکس بسیار مهم است زیرا به معامله گران اجازه می دهد تا حرکات بازار را پیش بینی کنند، تصمیمات معاملاتی آگاهانه بگیرند و ریسک ها را به طور موثر مدیریت کنند. همچنین به تنوع سبد سهام کمک می کند.

چگونه می توانم از همبستگی ارز در معاملات استفاده کنم؟

پاسخ: همبستگی ارز را می توان به روش های مختلفی در معاملات استفاده کرد. برای مثال، می تواند به محافظت در برابر زیان های احتمالی، جلوگیری از قرار گرفتن بیش از حد در معرض یک ارز و امده، و پیش بینی حرکت یک جفت ارز بر اساس حرکت یک ارز دیگر کمک کند.



چگونه می توانم همبستگی ارزها را مناسبه کنم؟

پاسخ: مناسبه همبستگی ارزها را می توان به صورت دستی با استفاده از روش های آماری یا با استفاده از ابزارها و پلتفرم هایی که فرآیند را خودکار می کنند انجام داد. این شامل جمع آوری قیمت های بسته شدن برای هر جفت در یک دوره معین، مناسبه بازده، یافتن میانگین بازده و سپس مناسبه ضریب همبستگی است.