

# Correlation Matrix



MetaTrader Master Edition

# Inhaltsverzeichnis

<b>1.</b>	<b>Über Korrelation</b>	<b>3</b>
<b>2.</b>	<b>Verwendung der Correlation Matrix</b>	<b>4</b>
2.1	Die Matrix	4
2.2	Ändern der Parameter für die Berechnung	5
2.3	Markierung der Stärke der Korrelation	5
2.4	Trades-Liste	6

# 1. Über Korrelation

Die Correlation Matrix zeigt die Korrelation zwischen den Symbolen über einen einstellbaren Zeitraum bzw. eine bestimmte Anzahl von Balken, z. B. die letzten 100 H1-Balken.

Die Korrelation wird auf einer Skala von -100 bis +100 gemessen:

- +100 bedeutet, dass die Kursbewegungen bei Symbol A und B identisch waren («positive Korrelation»)
- -100 bedeutet, dass die Kursbewegungen bei Symbol A und B genau entgegengesetzt waren: A stieg, wenn B fiel, und umgekehrt («negative Korrelation»)
- 0 bedeutet, dass sich die Instrumente unabhängig voneinander bewegt haben

Korrelation kann einen erheblichen Einfluss auf Ihr Trading-Risiko haben. Die folgenden Charts zeigen beispielsweise H1 EURUSD und USDCHF über denselben Zeitraum:



Diese Instrumente hatten eine sehr starke negative Korrelation (etwa -95). Wären Sie in diesem Zeitraum long EURUSD und short USDCHF gewesen (oder umgekehrt), dann hätten Sie mit beiden Positionen sehr ähnliche Gewinne erzielt. In Wirklichkeit hatten Sie keine zwei Positionen: Sie hatten nur eine Position. (Wenn Sie in beiden Instrumenten eine Long-Position oder in beiden Instrumenten eine Short-Position gehabt hätten, dann hätten Sie wahrscheinlich einen Gewinn mit der einen Position und gleichzeitig einen ähnlich hohen Verlust mit der anderen erzielt.)

Generell ist es ratsam, die Korrelation zwischen Ihren offenen Positionen zu minimieren. Ansonsten handeln Sie entweder zweimal die gleiche Kursbewegung oder Sie haben zwei Positionen, die sich gegenseitig aufheben.

Die Correlation Matrix hilft Ihnen, Symbole mit starker oder schwacher Korrelation zu identifizieren.

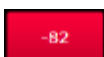
## 2. Verwendung der Correlation Matrix

### 2.1 Die Matrix

Die Correlation Matrix zeigt die Korrelation zwischen ausgewählten Symbolen in einer Tabelle. Zum Beispiel:



Jede Zelle in der Matrix ist farblich gekennzeichnet:

	Grün. Keine Korrelation (0 bis $\pm 25$ )
	Blau. Schwache Korrelation ( $\pm 25$ bis $\pm 50$ )
	Orange. Mittlere Korrelation ( $\pm 50$ bis $\pm 75$ )
	Rot. Starke Korrelation ( $\pm 75$ bis $\pm 100$ )

Es ist nicht so wichtig, ob die Werte positiv oder negativ sind (z. B. +90 oder -90), und die Bedeutung hängt davon ab, ob Sie in dem Instrument long oder short positioniert sind. Zum Beispiel:

- +90. Wenn Sie in beiden Instrumenten long sind, oder in beiden Instrumenten short, dann werden Sie wahrscheinlich sehr ähnliche Gewinne oder Verluste bei beiden Positionen verzeichnen. Wenn Sie in einem Symbol long und in dem anderen short sind, dann werden die Gewinne und Verluste der beiden Positionen dazu tendieren, sich gegenseitig aufzuheben
- -90. Wenn Sie in beiden Symbolen long sind, oder in beiden Symbolen short, dann werden die Gewinne und Verluste der beiden Positionen dazu tendieren, sich gegenseitig aufzuheben. Wenn Sie in einem Symbol long und in dem anderen short sind, dann werden Sie wahrscheinlich sehr ähnliche Gewinne oder Verluste bei beiden Positionen verzeichnen

Bei den karierten Zellen sind in beiden Achsen dieselben Symbole aufgeführt (die Berechnung der Korrelation eines Symbols mit sich selbst wäre sinnlos). Die Tabelle ist auf beiden Seiten der karierten Linie symmetrisch: d. h. die Korrelation von EURUSD mit USDCHF ist gleich der Korrelation von USDCHF mit EURUSD.

## 2.2 Ändern der Parameter für die Berechnung

Über die Felder oben in der Matrix können Sie den Zeitrahmen (z. B. H1, D1) und die Anzahl historischer Balken (z. B. 25, 100, 500) auswählen.

Die Korrelation zwischen Symbolen ändert sich im Laufe der Zeit, und die aktuelle Korrelation bleibt möglicherweise in Zukunft nicht bestehen. In der Regel sollten die Einstellungen, die Sie wählen, davon abhängen, wie lange Sie die offenen Positionen halten wollen. Wenn Sie beispielsweise planen, eine Position für 24 Stunden zu halten, sollten Sie sich die H1-Korrelation über die letzten 50 oder 100 Balken (ca. 2 oder 4 Tage) ansehen.

Über die Schaltfläche ... können Sie auswählen, welche Symbole in der Matrix angezeigt werden sollen. Dann wird eine Liste der Symbole, die derzeit in der Matrix enthalten sind, sowie eine Liste aller verfügbaren Symbole angezeigt.

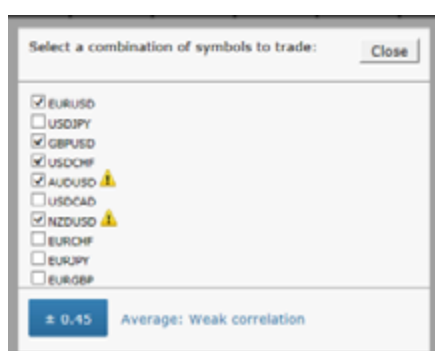
## 2.3 Markierung der Stärke der Korrelation

Das Korrelationstärkefeld neben dem Balkenfeld ermöglicht es Ihnen, unterschiedliche Arten von Korrelationen in der Tabelle hervorzuheben. Wenn Sie zum Beispiel «Stark» wählen, hebt die Tabelle Korrelationen über  $\pm 75$  hervor und graut alle schwächeren Korrelationen aus.

## 2.4 Trades-Liste

Die Schaltfläche Trades-Liste zeigt die durchschnittliche Korrelation zwischen einer Liste ausgewählter Symbole – z. B. Positionen, die Sie gerade traden, oder Positionen, die Sie in Zukunft eröffnen möchten.

Die Liste zeigt die durchschnittliche Korrelation und markiert alle Symbole, die eine starke Korrelation mit einem anderen Symbol auf der Liste haben. Im folgenden Beispiel ist die durchschnittliche Korrelation schwach, aber AUDUSD und NZDUSD sind stark miteinander korreliert:



Der Inhalt dieses Leitfadens dient rein zu Informationszwecken und stellt weder ein Angebot noch eine Empfehlung zum Handel mit einem speziellen Produkt dar. Er ist nicht als Beratung irgendeiner Art, insbesondere in Handels-, Steuer- und Rechtsfragen, aufzufassen. Informationen oder Meinungen zu einem Produkt oder einer Strategie, die in diesem Leitfaden geäußert werden, sind in Bezug auf die Anlageziele, finanziellen Umstände, Erfahrungen oder Kenntnisse jedes einzelnen Anlegers zu verstehen. Die Swissquote Bank AG und ihre Beschäftigten haften unter keinen Umständen für direkte oder indirekte Schäden oder Verluste aus Entscheidungen, die auf der Grundlage von Informationen aus diesem Leitfaden getroffen wurden. Der Inhalt dieses Leitfadens wurde durch die Swissquote Bank AG zum angegebenen Zeitpunkt angefertigt und kann sich jederzeit ohne Vorankündigung ändern. Die Inhalte dieses Leitfadens stammen aus oder basieren auf Quellen, welche die Swissquote Bank AG als zuverlässig betrachtet. Dennoch kann die Swissquote Bank AG keine Gewähr für die Qualität, Korrektheit, Rechtzeitigkeit oder Vollständigkeit der in diesem Leitfaden enthaltenen Informationen leisten. Ohne vorherige schriftliche Einwilligung der Swissquote Bank AG darf dieser Leitfaden weder ganz noch teilweise vervielfältigt werden. Devisentransaktionen sind hoch spekulativ und bergen erhebliche Risiken. Sie eignen sich im Allgemeinen nur für Anleger, die das Risiko eines Verlustes, der ihre Forex-Margin übersteigt, auf sich nehmen können. Aufgrund ihrer Beschaffenheit können Forex-Transaktionen theoretisch zu unbegrenzten Verlusten führen. Ohne Eingreifen könnten die Verluste das gesamte Guthaben des Kunden bei der Swissquote Bank AG um ein Vielfaches übersteigen.

[www.swissquote.com](http://www.swissquote.com)

Geneva - Zurich - Bern - London - Dubai - Malta - Hong Kong