

Correlation Matrix



MetaTrader Master Edition

Índice

1.	Acerca de la correlación	3
2.	Cómo utilizar Correlation Matrix	4
2.1	La matriz	4
2.2	Cambiar los parámetros para el cálculo	5
2.3	Destacar la fortaleza de la correlación	5
2.4	Lista de operaciones	6

1. Acerca de la correlación

Correlation Matrix (matriz de correlaciones) muestra la correlación entre los símbolos a lo largo de un intervalo de tiempo y un número de barras configurables, por ejemplo, las últimas 100 barras H1.

La correlación se mide en una escala de -100 a +100:

- +100 significa que las variaciones de precios de los símbolos A y B han sido idénticas («correlación positiva»)
- -100 significa que las variaciones de precios de los símbolos A y B han sido exactamente opuestas: A ha subido cuando B ha bajado y viceversa («correlación negativa»)
- 0 significa que los símbolos se han movido de forma independiente

La correlación puede tener un efecto importante en el riesgo de negociación. Por ejemplo, los siguientes gráficos muestran EURUSD y USDCHF H1 durante el mismo periodo:



Estos símbolos tienen una correlación negativa muy fuerte (alrededor de -95). Si estuvieras largo en EURUSD y corto en USDCHF durante este periodo o viceversa, habrías logrado unas ganancias muy similares en ambas posiciones. Así, en realidad no tenías dos posiciones, sino solo una. Si estuvieras largo en ambos símbolos o corto en ambos símbolos, probablemente obtendrías ganancias en una posición y pérdidas equivalentes en la otra.

En general, es aconsejable minimizar la correlación entre las posiciones abiertas. De lo contrario, estás operando con el mismo movimiento de precios por duplicado o tienes dos posiciones que se cancelan entre sí.

Correlation Matrix te ayudará a identificar los símbolos con una correlación fuerte o débil.



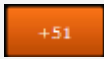

2. Cómo utilizar Correlation Matrix

2.1 La matriz

Correlation Matrix muestra las correlaciones entre símbolos seleccionados dentro de una tabla. Por ejemplo:



Cada celda de la matriz está codificada por colores:

	Verde. Sin correlación (0 a ± 25)
	Azul. Correlación débil. (± 25 a ± 50)
	Naranja. Correlación media. (± 50 a ± 75)
	Rojo. Correlación fuerte. (± 75 a ± 100)

Poco importa si los valores son positivos o negativos (p. ej.: +90 o -90), ya que su significado dependerá de si estás largo o corto en cada símbolo. Por ejemplo:

- +90. Si estás largo en ambos símbolos o corto en ambos símbolos, lo habitual será ver las mismas ganancias o pérdidas en ambas posiciones. Si estás largo en un símbolo y corto en el otro, lo habitual será obtener ganancias y pérdidas equivalentes
- -90. Si estás largo en ambos símbolos o corto en ambos símbolos, lo habitual será obtener ganancias y pérdidas equivalentes. Si estás largo en un símbolo y corto en el otro, lo habitual será ver ganancias o pérdidas idénticas en ambas posiciones

Las celdas con relleno cuadriculado muestran el cruce de filas y columnas iguales (es decir, la correlación de EURUSD frente a sí mismo no tiene sentido). La tabla es simétrica a ambos lados de la diagonal: por ejemplo, la correlación de EURUSD frente a USDCHF es la misma que la correlación de USDCHF frente a EURUSD.

2.2 Cambiar los parámetros para el cálculo

Puedes utilizar los campos de la parte superior de la matriz para seleccionar un intervalo de tiempo (p. ej.: H1, D1) y una serie de barras históricas (p. ej.: 25, 100, 500).

La correlación entre los símbolos cambia con el tiempo y puede que la correlación reciente no continúe en el futuro. Por norma general, los ajustes que elijas deben estar relacionados con el tiempo que tengas previsto mantener las posiciones abiertas. Por ejemplo, si prevés que una posición estará abierta 24 horas, es posible que quieras ver la correlación H1 de las últimas 50 o 100 barras (aproximadamente 2 o 4 días).

Puedes elegir los símbolos que deseas incluir en la matriz con el botón ... Así verás la lista de símbolos que se muestran en ese momento y la lista de todos los símbolos disponibles.

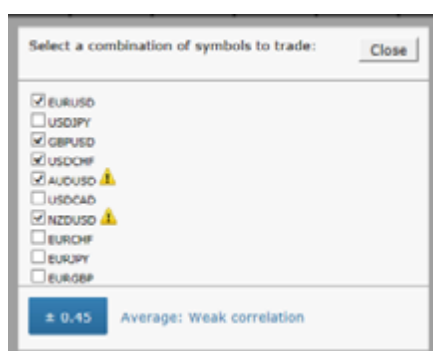
2.3 Destacar la fortaleza de la correlación

El campo de fortaleza, junto al campo de barras, permite resaltar diferentes tipos de correlación en la tabla. Por ejemplo, si seleccionas «Strong» (fuerte), la tabla resalta las correlaciones superiores a ± 75 y marca en gris las correlaciones más débiles.

2.4 Lista de operaciones

El botón «Trade List» (lista de operaciones) muestra la correlación media entre una lista de símbolos seleccionados, por ejemplo, las posiciones que estás operando en ese momento o las posiciones que tengas previsto abrir más adelante.

La lista muestra la correlación media y marca también aquellos símbolos que tengan una correlación fuerte con otro símbolo de la lista. En el siguiente ejemplo, la media general es una correlación débil, pero AUDUSD y NZDUSD están muy correlacionados entre sí:



El contenido de esta guía es meramente informativo y no constituye una oferta o una recomendación para operar con un producto concreto y no se entenderá como asesoramiento de ningún tipo, con exclusión expresa del asesoramiento de negociación, fiscal y jurídico. La información u opiniones relativas a un producto mencionado en esta guía no tienen en cuenta los objetivos de inversión, los activos, la experiencia o los conocimientos de un inversor en concreto. Swissquote Bank Ltd y sus empleados no serán en ningún caso responsables de los perjuicios o pérdidas derivados directa o indirectamente de las decisiones tomadas sobre la base de los contenidos de esta guía. El contenido de esta guía ha sido elaborado por Swissquote Bank Ltd en la fecha indicada y puede estar sujeto a cambios sin previo aviso. Aunque el contenido de esta guía se ha obtenido y se nutre de fuentes que Swissquote Bank Ltd considera fidedignas, Swissquote Bank Ltd no asume ninguna responsabilidad en cuanto a su calidad, exactitud, oportunidad o integridad. Esta guía no puede ser reproducida parcial ni totalmente sin el consentimiento previo por escrito de Swissquote Bank Ltd. Las operaciones de divisas son altamente especulativas, conllevan un grado de riesgo extremo y generalmente solo son adecuadas para personas que puedan asumir y mantener el riesgo de registrar pérdidas superiores a su margen de divisas. Por su naturaleza, las operaciones de divisas pueden generar pérdidas que son, en teoría, ilimitadas. Salvo que previamente se hayan tomado medidas, la pérdida podría ser muy superior a los activos depositados por el cliente en Swissquote Bank Ltd.

www.swissquote.com

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