

# 相关性交易工具



MetaTrader Master Edition

# 目录

<b>1.</b>	<b>关于相关性</b>	<b>3</b>
<b>2.</b>	<b>使用相关性交易工具</b>	<b>4</b>
2.1	价格图表	4
2.2	相关性	4
2.2.1	相关性值	5
2.2.2	相关性颜色	5
2.3	更改代码选择	5
2.4	开仓和平仓	6

# 1. 关于相关性

相关性交易工具可显示代码之间在可配置的时间框架内的相关性，例如最近的 H1 柱状线。

可以按照从 -100 至 +100 的标度衡量相关性相互关系：

- +100 表示代码 A 和 B 的价格变动完全相同（“正相关”）
- -100 表示代码 A 和 B 的价格变动完全相反：A 上升时 B 下降，反之亦然（“负相关”）
- 0 表示代码价格独立变动

相关性会对交易风险产生重大影响。例如，下面的图表显示相同时间期间的 H1 EURUSD 和 USDCHF：



这些代码具有非常强的负相关性（-95 左右）。如果在此期间持有多头 EURUSD 和空头 USDCHF，则您会看到这两个头寸具有非常类似的盈利。实际上，您拥有的不是两个头寸：事实上只存在一个头寸。（如果您持有的是两个代码的多头头寸或两个代码的空头头寸，则可能一个代码产生盈利，另一个代码产生相匹配的亏损。）

通常建议尽可能缩小未平仓头寸之间的相关性。否则，您交易的是两次相同的价格走势，或者您持有的是具有相互抵消作用的两个头寸。

相关性交易工具可帮助您确定具有强相关性或弱相关性的代码，并针对相关性方面出现的差异进行交易。

## 2. 使用相关性交易工具

### 2.1 价格图表

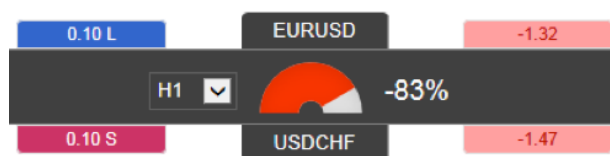
相关性交易工具可并排显示两个代码的近期价格图表（而且可以被用来显示两个关联的价格图表）：



### 2.2 相关性

中间的柱状线允许您更改图表的时间框架。它还可以显示以下内容：

- 两个代码之间在选定时间框架内的近期相关性
- 每个代码的任何未平仓头寸及其概率



### 2.2.1 相关性值

该工具可按照 0 至  $\pm 100$  的衡量尺度显示相关性。正数或负数值之间并无差异（例如 +90 或 -90），具体含义取决于您持有的每个代码是多头头寸还是空头头寸。例如：

- +90。如果您持有的是两个代码的多头头寸或两个代码的空头头寸，则这两个仓位会容易产生相同的盈利或亏损。如果您持有的是一个代码的多头头寸和另一个代码的空头头寸，则会容易产生相匹配的盈利和亏损。
- -90。如果您持有的是两个代码的多头头寸或两个代码的空头头寸，则会容易产生相匹配的盈利和亏损。如果您持有的是两个代码的多头头寸或者两个代码的空头头寸，则这两个仓位会容易产生相同的盈利或亏损。

### 2.2.2 相关性颜色

该工具的颜色将取决于相关性的强度：

	绿色。无相关 (0 至 $\pm 25$ )
	蓝色。弱相关。 ( $\pm 25$ 至 $\pm 50$ )
	橙色。中度相关。 ( $\pm 50$ 至 $\pm 75$ )
	红色。强相关。 ( $\pm 75$ 至 $\pm 100$ )

## 2.3 更改代码选择

您可以通过单击名称来更改某一代码。标签可以被可编辑的方框所替换，您可以在其中键入新的代码名称，该输入框具有自动填写功能。

## 2.4 开仓和平仓

【请注意：订单选项卡在可交易的平台上不可用】

您可以使用“新订单”执行简单的交易操作，例如对未平仓头寸进行平仓或者开立新头寸。

Volume:	0.101	Floating P/L:	-20.20	Close
<b>EURUSD</b>				
Volume:	0.10	lots		
SL:	-	pips		
TP:	-	pips		
<input checked="" type="checkbox"/> Non-hedging mode (sells close buys, and vice versa)				
<b>Sell</b>	1.36764	<b>Buy</b>	1.36778	

交易表格的顶部可显示选定代码的任何未平仓头寸，并且附有一个用于平仓的按钮。下面的简单表格可用于下达新的买入或卖出市场订单。

本文件并非金融促销信息。**77% 的散户投资者在通过此提供商交易 CFD 时会产生帐户亏损。**您应考虑自己是否可以承担资金亏损的高风险。

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

日内瓦 - 苏黎世 - 伯尔尼 - 伦敦 - 迪拜 - 马耳他 - 中国香港