

关联性模型

GO MARKETS 
first choice for forex

1. 关于关联性	2
2. 使用关联性模型	4
2.1 模型	4
2.2 修改计算参数.....	5
2.3 突出关联性强度	5
2.4 交易列表.....	5



1. 关于关联性

关联性模型显示设置的时间周期和柱线数量内(例如最近 100 根 H1 线), 交易产品之间的关联性。

关联性以-100 至 +100 之间的数值来体现:

- +100 表示代码 A 和 B 的行情走势相同 (“正相关”).
- -100 表示代码 A 和 B 的行情走势完全相反: A 上涨时 B 下跌, 反之亦然 (“负相关”).
- 0 表示两者走势独立, 没有关联。

关联性对您的交易风险有重要影响。例如下图显示 EURUSD 和 USDCHF 在同一时段的 1 小时走势:



这两者具有非常强的负相关性 (约 -95)。如果您在此期间做多 EURUSD 并做空 USDCHF, 或者与此相反, 则两个头寸的盈利将极为相似。实际上, 您没有持有两个头寸: 事实上只有一个头寸。(如果同时做多或做空这两个产品, 则一个头寸盈利的同时, 另外一个会出现相同的亏损。)

通常建议将未平仓头寸之间的关联性降至最小。否则要么相当于重复建仓，要么两者之间会相互抵消。

关联性模型帮助您确认产品之间的关联度强弱。

2. 使用关联性模型

2.1 模型

关联性模型显示所选产品之间的相关性。例如：



模型内的每个单元都经过颜色编码：

-8	绿色。无关联 (0 to ± 25)
+31	蓝色。弱关联 (± 25 to ± 50)
+51	橙色。中等关联 (± 50 to ± 75)
-82	红色。强关联 (± 75 to ± 100)

正相关或者是负相关的意义区别不大 (例如 +90 or -90)，只是在于您是在做多还是做空。例如：

- **+90**。如果您在做多或者做空这两个产品，将发现两者会同步盈利或亏损。如果做多一个产品的同时做空另一个产品，则会发现盈利和亏损相抵消。
- **-90**。如果您做多或做空者两个产品，会发现盈利和亏损相抵消。如果做多一个产品的同时做空另一个产品，会发现两则同步盈利或亏损。

行和列中的空白格表示相同的产品(即 EURUSD 与其自身的相关性没有意义)。网纹线两边的网格对称：例如 EURUSD 与 USDCHF 的相关性和 USDCHF 与 EURUSD 的相关性相同。

2.2 更改计算参数

可以在模型顶部的栏目选择时间周期(例如 H1, D1)和历史柱线的数量(例如 25, 100, 500)。

产品之间的关联性随时变化，近期的关联性不一定会在未来延续。作为一般法则，选择的设置应该与计划持仓的时间相关。例如，如果预计一个头寸会持仓 24 小时，则可能希望观察过去 50 至 100 根小时线(约为 2 或 4 天)。

在底部选择加入模型的产品代码。该栏目显示当前显示的代码列表，以及所有可用代码的列表。

2.3 突出关联性强度

柱线栏目之后是强度栏目，可以凸显网格中的不同种类的相关性。例如，如果选择“强”，则将会突出相关性高于 ± 75 的网格，并将更弱的相关性显示为灰色。

2.4 交易列表

交易列表栏目显示选择的代码列表之间的平均相关性——例如，目前交易的头寸，或计划将来开立的头寸。

列表显示平均相关性，还会标记任何与列表中的其它代码具有强相关性的代码。在下例中，总体平均为弱相关性，但 AUDUSD 与 NZDUSD 具有强相关性：

Select a combination of symbols to trade: Close

- EURUSD
- USDJPY
- GBPUSD
- USDCHF
- AUDUSD 
- USDCAD
- NZDUSD 
- EURCHF
- EURJPY
- EURGBP

± 0.45 Average: Weak correlation