



相关性矩阵

1. 关于相关性.....	2
2. 使用相关性矩阵.....	3
2.1 矩阵.....	3
2.2 修改计算参数.....	4
2.3 突出显示相关性强度.....	4
2.4 交易清单.....	4

1. 关于相关性

相关性矩阵显示按可配置的时间周期代码之间相关性和柱形图的数量，例如最后 100 个 1 小时柱形图。

相关性指标的大小范围从-100 到+100:

- + 100 表示代码 A 和 B 的价格动态是相同的（“正相关”）。
- -100 表示代码 A 和 B 的价格变动完全相反：当 B 下跌时 A 上涨，反之亦然（“负相关”）。
- 0 表示代码的变动是独立的。

相关性可能对您的交易风险有重大影响。例如，下面的图表显示了相同时间段的 1 小时欧元美元和美元瑞郎：



这些代码具有很强的负相关（约-95）。如果您在这段时期做多欧元美元并做空美元瑞郎，或反之亦然，那么您可能会看到两个头寸的利润非常相似。实际上，您拥有的不是两个头寸，而只是一个。（如果您两个代码都做多，或者两个代码都做空，那么您可能在一个代码上获利，而在另一个代码遭遇相应的亏损。）

通常建议尽量减小您的未平仓头寸之间的相关性。否则，您要么就相同的价格走势做了两次交易，要么有两个相互抵消的头寸。

相关矩阵可以帮助您识别具有强烈或微弱相关性的代码。

2. 使用相关性矩阵

2.1 矩阵

相关性矩阵显示一个网格的所选代码之间的相关性。例如：



矩阵中的每个单元格都采用颜色标记：

-8	绿色。无相关性（0到±25）
+31	蓝色。弱相关。（±25到±50）
+51	橙色。中等相关（±50到±75）
-82	红色。强烈相关（±75到±100）

无论值是正数还是负数（例如+90或-90），几乎没有什么差别，其含义取决于您对每个代码是做多还是做空。例如：

- +90。如果您两个代码都做多，或两个代码都做空，那么您在两个头寸上获得的盈利或亏损往往会相同。如果您一个代码做多而另一个做空，那么您获得的盈利和亏损往往相抵。
- -90。如果您两个代码都做多，或两个代码都做空，那么您在两个头寸上获得的盈利和亏损往往相抵。如果您一个代码做多而另一个做空，那么您在两个头寸上获得的盈利或亏损往往会相同。

方格单元格显示行和列是相同的（即欧元美元对其本身的关联性没有意义）。网格与方格线的两侧都对称：例如，欧元美元对美元瑞郎的相关性与美元瑞郎对欧元美元的相关性相同。

2.2 修改计算参数

您可以使用矩阵顶部的字段栏来选择时间周期（如 1 小时、1 天）和若干历史柱形图的数量（例如 25,100,500）

代码之间的相关性随时间推移而变化，并且近期的相关性可能在将来不会延续。一般情况下，您选择的设置应与您打算保留未平仓头寸的时间相关。例如，如果您希望持有头寸 24 小时，您可能想要查看过去 50 或 100 个柱形图（大约 2 或 4 天）的 1 小时相关性。

您可以使用...按钮，选择在矩阵中包含哪些代码。这会显示当前正在展示的代码列表，以及所有可用代码的列表。

2.3 突出显示相关性强度

柱形图字段栏旁的强度栏，可以在网格中突出显示不同类型的相关性。例如，如果您选择“强”，那么网格突出显示高于±75 的相关性，并会以灰色显示所有较弱的相关性。

2.4 交易清单

“交易清单”按钮显示一系列所选择代码之间的平均相关性——例如，您当前正在交易的头寸或您打算将来开仓的头寸。

该列表显示平均的相关性，并且标记与列表上的另一代码具有强相关性的所有代码。在下面的示例中，总体平均值是弱相关，但是澳元美元和纽元美元相互之间是强相关。

