

Correlation-strategien

Correlation-strategien kan hjælpe dig med at bestemme retningen i dine swingtrades. I den følgende beskrivelse bruger vi correlation-strategien i handel med forexpar, men correlation-strategien kan også bruges til retningsbestemmelse på tværs af indekser, råvarer m.m. Correlation-strategien går ud på at finde to kurser, der følger hinanden over en længere periode, og dernæst udnytte de tidsrum, hvor korrelationen tilsyneladende svigter. Her håber man, at de to kurser genfinder deres rytme.

Gratis forløb: Professionel trader Tom Hougaard afslører sine strategier. Tilmeld dig her

De fleste daytradere handler forex ved at analysere grafen på et enkelt forexkryds, for eksempel EURUSD (Euro over for dollars) eller USDJPY (Dollars over for Japanske yen). Om de skal gå lang eller kort i forexkrydset afgøres alene ved at analysere bevægelserne på det timeframe, de handler på – for eksempel en 30 minutters-graf eller en timegraf.

Som forextrader kan correlation-strategien dog bruges som stærkt supplement til helt overordnet at udvælge, hvilket forex-kryds man ønsker at handle, og i hvilken retning det pågældende forexkryds sandsynligvis vil bevæge sig i den kommende tid.

Correlation-strategien gribes an på følgende måde: Først finder man et forexpar, der korrelerer. Her kan man for eksempel benytte sig af <https://www.myfxbook.com/forex-market/correlation>

Siden giver et overblik over korrelation mellem forskellige forexpar. Hvis man vil undgå støj, bør man vælge en korrelation på mindst daglig basis (se dropdownvinduet på siden).

I oversigten betyder en korrelation på for eksempel 90%, at kursen følger hinanden meget. 0 betyder, at der slet ikke er korrelation, hvorimod -90% viser, at der er høj korrelation, men, at den er negativ – det vil sige, at graferne bevæger sig i et præcist forhold til hinanden, men i fuldstændig modsat retning. Når man leder efter korrelationen, bør man kun interessere sig for alt over 80% eller under -80%.



Korrelation mellem EURUSD og GBPUSD

Billedet til venstre viser, hvordan korrelation mellem EURUSD og GBPUSD så ud i en periode fra 2009 til 2012. Som man kan se fulgte de to grafer ret præcist hinanden.

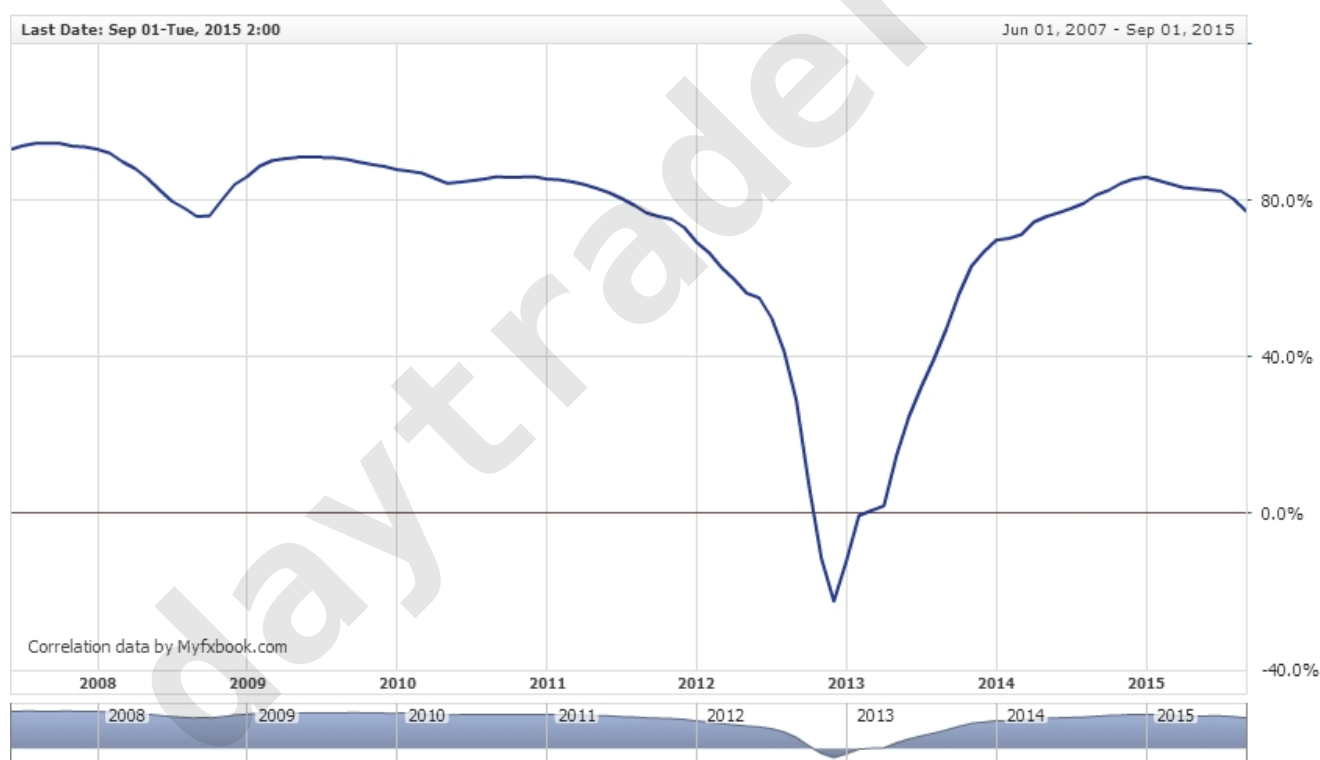
Grunden til, at visse forexpar overhovedet korrelerer med hinanden skal oftest findes i det forhold, at de har en gensidig afhængighed. I tilfældet EURUSD og GBPUSD kan man sige, at de begge står i forhold til USD. Hvis der for eksempel kommer dårlige arbejdsløshedstal ud fra USA, så vil begge kurser sandsynligvis bevæge enten ned eller op på omtrent samme tidspunkt, fordi begge forexpar står i forhold til netop amerikanske dollars.

Brug for hjælp til den rette handelsplatform for dig? Chat med os

Ideen med Correlation-strategien er finde forexpar, der over en lang periode har fulgt hinanden, men af en eller anden grund af kommet ud af sync. Håbet er nu, at de to forexpar på

et tidspunkt genfinder korrelationen til hinanden.

Kig for eksempel på nedenstående graf, der viser korrelationen mellem AUDJPY og GBPJPY på en månedsgraf. Fra 2008 og frem til 2010 korrelerer graferne med omkring 80%, hvorefter korrelationen tager et kraftigt dyk, hvorefter de to forexpar genfinder korrelationen i 2014. Forventningen kan nu være, at korrelationen vil fortsætte en længere periode, præcis som det skete fra 2008 og frem til 2010. Hvis man tror på det, kan man bruge det lille dyk under 80% i slutningen af perioden (september 2015) til at kigge efter en handel. Man handler med andre ord på forventningen om, at korrelationen hurtigt kommer op over 80% igen.



Korrelation mellem AUDJPY og GBPJPY

Men hvordan handler man konkret denne forventning?

For at blive klogere på, hvordan man skal handle, kan man sidestille de to pars grafer over for hinanden. Det kan man for eksempel gøre via denne side: <https://www.myfxbook.com/forex-charts/nc>. Find dropdown-menuen "compare". Ved at indtaste AUDJPY og GBPJPY kan man se, at de

to grafer ganske rigtigt har mistet lidt af korrelationen i forhold til hinanden (se nedenstående graf). For at graferne mødes igen, skal GBPJPY, der repræsenterer den blå streg, bevæge sig nedad, imens den røde streg, der repræsenterer AUDJPY, skal bevæge sig lidt opad.



GBPJPY repræsenterer den blå streg, AUDJPY repræsenterer den røde streg.

Det betyder IKKE, at man nu bare skal shorte GBPJPY og gå lang i AUDJPY, for så har man pludselig udsat sig selv for den dobbelte risiko. I stedet skal man gå direkte til sagens kerne, nemlig valutakrydet GBPAUD. Logikken er, at hvis britiske pund tilsyneladende skal blive svagere i forhold til japanske yen, og australske dollars skal blive stærkere i forhold til den selvsamme valuta, nemlig japanske yen – ja, så kan man udelukke japanske yen i ligningen og handle GBPAUD

direkte i forhold til hinanden.

Da konklusionen af analysen var, at pundet skal blive svagere for at genskabe korrelation og australske dollars skal blive stærkere for at genskabe korrelation, så shorter man simpelthen valutakrydset GBPAUD.

Præcis hvornår man skal shorte afhænger fuldstændig af, hvilken daytrading-strategi man bruger til sine entries. Med correlation-strategien har man alene fået en idé om, hvor valutakrydset skal hen på lidt længere sigt. Selve entry bør man tilgå med en mere kortsigtet plan. Husk altid, at der kan være mange bump på vejen mod målet.

Correlation-strategien fungerer ikke kun på forexpar. Den kan også benyttes i forexpar over for indeks. Eller for indeks over for råvarer. For eksempel guld eller olie. Der findes gensidige relationer i rigtig mange værdipapirer.