

ความสัมพันธ์ของค่าเงินคืออะไร ?

คุณเคยสังเกตหรือเปล่าว่าเมื่อค่าเงินค่าหนึ่งขึ้น อีกค่าหนึ่งลง แล้วเมื่อค่าเงินอีกค่าหนึ่งลง ดูเหมือนอีกค่าหนึ่งก็เคลื่อนไหวไปในทิศทางเดียวกันด้วย?

ถ้าคำตอบของคุณคือ ใช่ คุณกำลังเห็นความสัมพันธ์ของค่าเงิน !

ถ้าคำตอบคือ ไม่ คุณต้องหยุดทำเรื่องไร้สาระบ้าง เช่น เล่น FarmVille หรือ Angry Bird แทนที่จะใช้เวลาดูกราฟเพิ่ม

แต่ว่าไม่ต้องห่วงเพราะเราจะมาเริ่มพื้นฐานของมันเลย...

ความสัมพันธ์ ของค่าเงิน

ตัวแรก ค่าเงิน คุณคงรู้แล้วว่าคืออะไร ไม่จำเป็นต้องอธิบายมาก

ตัวที่สอง ความสัมพันธ์ นั่นก็คือความสัมพันธ์กันของสองสิ่ง

ทางโลกการเงิน ความสัมพันธ์นั้นวัดทางสถิติว่า หลักทรัพย์นั้นมีความสัมพันธ์กันยังไ้กันระหว่างความเคลื่อนไหวของหลักทรัพย์ตัวอื่น

ความสัมพันธ์ของค่าเงิน ก็คือ การที่ค่าเงินสองค่าเงินเคลื่อนไหวไปในทิศทางเดียวกันหรือทิศทางตรงกันข้าม

เมื่อคุณเทรดค่าเงิน คุณต้องจำไว้ว่า ค่าเงินเทรดเป็นคู่ไม่ได้เทรดเป็นค่าเงินเดี่ยว

แม้ว่าแผนการเทรดของคุณ จะวางไว้สำหรับค่าเงินเดี่ยว แต่คุณต้องเข้าใจเสมอว่าค่าเงินนั้นเคลื่อนไหวแตกต่างกันกับตัวอื่น ๆ อย่างไร ถ้าคุณไม่คุ้นเคยกับความสัมพันธ์ของค่าเงินมันจะกระทบกับความเสี่ยงของการล้างพอร์ตของคุณ

ถ้าคุณไม่รู้ว่าคุณกำลังทำอะไร เวลาคุณเทรดหลาย ๆ ค่าเงิน บางทีคุณอาจจะถูกขาดตรกรรมเลยในการเทรด

ในบทเรียนนี้ คุณจะได้เรียนรู้เกี่ยวกับความสัมพันธ์กับค่าเงินและช่วยให้คุณเป็นนักเทรดที่ดีได้
อย่างไร



ค่าความสัมพันธ์นั้นจะถูกคำนวณ เป็นค่าสัมประสิทธิ์ ซึ่งจะมีค่าเป็นบวกและ ลบ

Perfect positive correlation (ค่าสัมประสิทธิ์ สัมพันธ์ เป็นบวก $+1$) สามารถบอกเราได้ว่า ค่าเงินสองค่าเงินนั้นเคลื่อนไหวไปในทิศทางเดียวกัน และจะเคลื่อนไหวไปในทางเดียวกัน ร้อยเปอร์เซ็นต์ ในช่วงเวลานั้น

Perfect negative correlation (ค่าสัมประสิทธิ์ สัมพันธ์ เป็นลบ -1) หมายความว่า ค่าเงินสองค่าเงินจะเคลื่อนไหวในทางตรงข้ามกัน 100% ในช่วงเวลาหนึ่ง

If the correlation is 0 การเคลื่อนไหวระหว่างสองค่าเงินนั้นมีความเป็นศูนย์ ไม่มี ความสัมพันธ์กัน ซึ่งไม่เกี่ยวข้องกันเลย เราไม่รู้ว่าคุณค่าเงินคู่หนึ่งจะไม่มีความสัมพันธ์กับค่าเงินอื่นเลยยังงี้

จะอ่านค่าความสัมพันธ์ทางคู่เงินอย่างไร

คุณชอบเรียนรู้ด้วยการดูด้วยภาพหรือเปล่า? คุณชอบดูผู้หญิงรูปร่าง Sexy หรือ ผู้ชาย ล่ำ ๆ หรือเปล่า ถ้าคุณเป็นอย่างนั้น พอดีเลย !

มาดูตารางกัน ซึ่งแต่ละตารางจะแสดงให้เห็นถึงความสัมพันธ์ระหว่างค่าเงินหลัก (ดอลลาร์) และค่าเงินอื่น(ลีซา) ตามช่วงเวลาต่าง ๆ

จำไว้ว่า ค่าความสัมพันธ์ของค่าเงินนั้นแสดงให้เป็นจุดทศนิยม โดยเป็นค่า สัมประสิทธิ์สัมพันธ์ ซึ่งจะเป็นตัวเลขระหว่าง **-1.00 and +1.00** ค่าสัมประสิทธิ์ที่เข้าใกล้ $+1$ หมายความว่า ค่าเงินสองค่าเงินนั้นมีความสัมพันธ์เป็นบวกและมีทิศทางการเคลื่อนไหวในทิศทางเดียวกัน

และในทางตรงกันข้าม ค่าสัมประสิทธิ์ ที่ใกล้เคียงกับ -1 บ่งบอกถึงค่าเงินสองค่าเงินที่มีความสัมพันธ์และตรงข้ามกัน ซึ่งทำให้ค่าเงินนั้นเคลื่อนไหวในทิศทางตรงกันข้าม

ค่าสัมประสิทธิ์ที่เข้าใกล้ศูนย์นั้นบอกว่า ค่าความสัมพันธ์ระหว่างค่าเงินน้อย หรือ มีความสัมพันธ์แบบสุ่ม

EUR/USD

EUR/USD	USD/JPY	USD/CHF	GBP/USD	USD/CAD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	-0.23	-1.00	0.94	-0.98	0.98	0.93	0.93	0.86
1 month	0.63	-0.98	0.13	-0.90	0.90	0.96	0.91	0.86
3 month	-0.62	-0.92	0.83	0.14	0.63	0.42	0.61	0.75
6 month	-0.62	-0.85	0.31	-0.35	0.61	0.65	0.28	0.71
1 year	-0.69	-0.98	0.88	-0.93	0.95	0.96	0.66	0.02

USD/JPY

USD/JPY	EUR/USD	USD/CHF	GBP/USD	USD/CAD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	-0.23	0.22	-0.21	0.07	-0.22	0.07	0.14	-0.20
1 month	0.63	-0.52	-0.35	-0.58	0.46	0.64	0.89	0.77
3 month	-0.62	0.52	-0.62	-0.40	-0.30	0.09	0.24	-0.35
6 month	-0.62	0.78	0.14	0.43	-0.70	-0.63	0.58	-0.68
1 year	-0.69	0.74	-0.51	0.67	-0.69	-0.69	0.09	-0.20

USD/CHF

USD/CHF	EUR/USD	USD/JPY	GBP/USD	USD/CAD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	-1.00	0.22	-0.95	0.98	-0.99	-0.95	-0.93	-0.83
1 month	-0.98	-0.52	-0.24	0.89	-0.93	-0.94	-0.87	-0.79
3 month	-0.92	0.52	-0.79	0.14	-0.78	-0.57	-0.62	-0.67
6 month	-0.85	0.78	-0.07	0.66	-0.88	-0.86	0.06	-0.74
1 year	-0.98	0.74	-0.87	0.96	-0.98	-0.98	-0.58	-0.01

GBP/USD

GBP/USD	EUR/USD	USD/JPY	USD/CHF	USD/CAD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	0.94	-0.21	-0.95	-0.90	0.94	0.87	0.88	0.64
1 month	0.13	-0.13	-0.24	-0.26	0.31	0.20	-0.10	-0.39
3 month	0.83	-0.62	-0.79	0.21	0.70	0.49	0.41	0.26
6 month	0.31	0.14	-0.07	0.17	-0.02	-0.16	0.49	-0.45
1 year	0.88	-0.51	-0.87	-0.89	0.87	0.86	0.69	-0.45

USD/CAD

USD/CAD	EUR/USD	USD/JPY	USD/CHF	GBP/USD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	-0.98	0.07	0.98	-0.90	-0.98	-0.98	-0.97	-0.88
1 month	-0.89	-0.58	0.89	-0.26	-0.96	-0.96	-0.83	-0.70
3 month	0.14	-0.40	0.14	0.21	-0.41	-0.56	-0.23	-0.02
6 month	-0.35	0.43	0.66	0.17	-0.83	-0.77	0.16	-0.45
1 year	-0.93	0.67	0.96	-0.89	-0.97	-0.96	-0.59	0.13

AUD/USD

AUD/USD	EUR/USD	USD/JPY	USD/CHF	GBP/USD	USD/CAD	NZD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	0.98	-0.22	-0.99	0.94	-0.98	0.95	0.92	0.83
1 month	0.90	0.46	-0.93	0.31	-0.96	0.94	0.76	0.67
3 month	0.63	-0.30	-0.78	0.70	-0.41	0.87	0.48	0.28
6 month	0.61	-0.70	-0.88	-0.02	-0.83	0.91	-0.23	0.58
1 year	0.95	-0.69	-0.98	0.87	-0.97	0.99	0.59	-0.0

NZD/USD

NZD/USD	EUR/USD	USD/JPY	USD/CHF	GBP/USD	USD/CAD	AUD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	0.93	0.07	-0.95	0.87	-0.98	0.95	0.98	0.83
1 month	0.96	0.64	-0.94	0.20	-0.96	0.94	0.90	0.79
3 month	0.42	0.09	-0.57	0.49	-0.56	0.87	0.61	0.17
6 month	0.65	-0.63	-0.86	-0.16	-0.77	0.91	-0.09	0.72
1 year	0.96	-0.63	-0.98	0.86	-0.96	0.99	0.61	0.00

EUR/JPY

EUR/JPY	EUR/USD	USD/JPY	USD/CHF	GBP/USD	USD/CAD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/GBP
1 week	0.93	0.14	-0.93	0.88	-0.97	0.92	0.98	0.81
1 month	0.91	0.89	-0.84	-0.10	-0.83	0.76	0.90	0.90
3 month	0.61	0.24	-0.62	0.41	-0.23	0.48	0.61	0.58
6 month	0.28	0.58	0.06	0.49	0.16	-0.23	-0.09	-0.09
1 year	0.66	0.09	-0.58	0.69	-0.59	0.59	0.61	-0.20

EUR/GBP

EUR/GBP	EUR/USD	USD/JPY	USD/CHF	GBP/USD	USD/CAD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/JPY
1 week	0.86	-0.20	-0.83	0.64	-0.88	0.83	0.83	0.81
1 month	0.86	0.77	-0.79	-0.39	-0.70	0.67	0.79	0.90
3 month	0.75	-0.35	-0.67	0.26	-0.02	0.28	0.17	0.58
6 month	0.71	-0.68	-0.74	-0.45	-0.45	0.58	0.72	-0.09
1 year	0.02	-0.20	-0.01	-0.45	0.13	-0.03	0.00	-0.20

ต้องรู้จักความเสี่ยงของคุณอยู่เสมอ



เมื่อคุณเทรดด้วยคู่เงินหลายคู่ ในบัญชีเทรดของคุณ ต้องรู้เสมอว่า คุณมีความเสี่ยงขนาดไหน และเสี่ยงตรงไหน?

คุณอาจจะคิดว่า คุณกำลังกระจายความเสี่ยงโดยการเทรดหลาย ๆ คู่ แต่ว่าถ้าเกิดมันเคลื่อนไหวในทิศทางเดียวกัน

มาดูตัวอย่างของค่าเงินที่เกี่ยวข้องกันในกราฟ รายสัปดาห์ : EUR/USD และ GBP/USD.

EUR/USD	USD/JPY	USD/CHF	GBP/USD	USD/CAD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	-0.23	-1.00	0.94	-0.98	0.98	0.93	0.93	0.86
1 month	0.63	-0.98	0.13	-0.90	0.90	0.96	0.91	0.86
3 months	-0.62	-0.92	0.83	0.14	0.63	0.42	0.61	0.75

6 months	-0.62	-0.85	0.31	-0.35	0.61	0.65	0.28	0.71
1 year	-0.69	-0.98	0.88	-0.93	0.95	0.96	0.66	0.02

ตามตาราง ด้วยค่าสัมประสิทธิ์ที่ 0.94 ซึ่งบอกเราว่ามีความสัมพันธ์เป็นบวก ซึ่งต้องมีทิศทางการเคลื่อนไหวในทิศทางเดียวกันอย่างแน่นอน !

โอเค มาดูภาพกัน ประเด็นก็คือว่า ค่าเงินที่เราถือ ตามภาพกันก่อนแล้วไปดูอีกค่าเงิน นี่เป็นกราฟ 4 ชั่วโมง บอกว่าค่าเงินทั้งสองจะเคลื่อนไหวในทิศทางเดียวกัน



มาดูเรื่องความเสี่ยงกัน เราจะเห็นว่า การเปิดออร์เดอร์ในค่าเงิน EUR/USD และ GBP/USD คือ การเคลื่อนไหวในทิศทางเดียวกัน

ตัวอย่าง ถ้าคุณ Buy EUR/USD 1 Lot และ Buy GBP/USD 1 Lot คุณซื้อรวม 2 Lot ซึ่งเหมือนกับ Buy EUR/USD 2 Lot เพราะว่า ค่าเงินทั้งสองคู่เคลื่อนไหวในทิศทางเดียวกัน.

อีกแห่งหนึ่ง คุณเพิ่มความเสี่ยงของคุณ โดยการ ซื้อ EUR/USD และ GBP/USD คุณก็จะมีโอกาส ผิดเป็นสองเท่า คือ ถ้า EUR/USD ร่วงและโดน Stop Loss ค่าเงิน GBP/USD ก็จะไปทิศทาง เดียวกัน และคุณก็ต้อง Stop Loss

คุณคงไม่อยาก Buy EUR/USD และ Sell GBP/USD พร้อมกัน ถ้า EUR/USD นั้นวิ่ง GBP/USD ก็จะเป็นเช่นเดียวกัน คุณคงคิดว่า เราจะกำไรตรงไหน?

ถ้าคุณคิดว่า กำไรขาดทุนจะเป็นศูนย์ตลอด คุณผิดแล้ว เพราะว่า ค่าเงิน EUR/USD กับ GBP/USD นั้นมันเคลื่อนไหวไม่เท่ากัน เพราะว่า มันเคลื่อนไหวทิศทางเดียวกัน ไม่ได้ หมายความว่า มันจะต้องเคลื่อนไหวเท่ากันซักหน่อย

ค่าความผันผวนของค่าเงินนั้น ไม่แน่นอน เช่น EUR/USD สามารถเคลื่อนไหว 200 จุด และ GBP/USD 190 จุด ถ้ามันเกิดขึ้นจากการเทรต เราอาจจะขาดทุนจาก GBP/USD แต่เราก็ได้ กำไรจาก EUR/USD

ทีนี้เราลองคิดว่า EUR/USD เป็นค่าเงินที่ เคลื่อนไหวที่ 190 จุด และ GBP/USD นั้น เคลื่อนไหว 200 จุด คุณก็ขาดทุนแน่นอน !

การ Buy ค่าเงินหนึ่ง และ Short อีกค่าเงินหนึ่ง ที่มีความสัมพันธ์กันสูงนั้นค่อนข้างได้ประโยชน์ น้อย

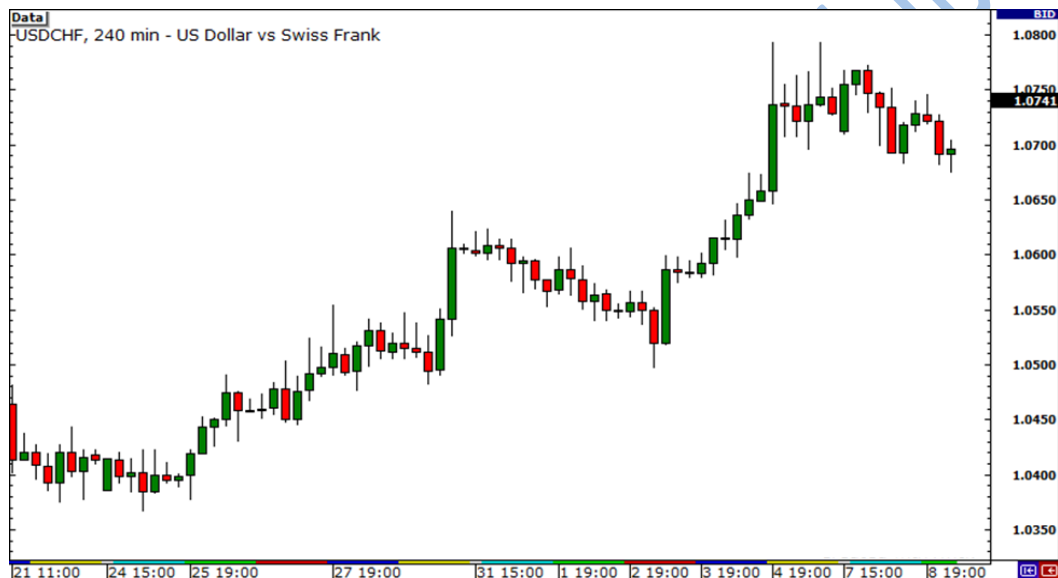
ยิ่งกว่านั้น คุณต้องจ่าย Spread 2 เท่า คุณได้กำไรน้อยไปด้วย เพราะว่า อีกค่าเงินหนึ่งก็จะกิน กำไรอีกค่าเงินหนึ่งไปด้วย ยิ่งเลวร้ายกว่าเดิมเมื่อคุณอาจจะเสียได้ถ้าคุณไม่รู้ว่า ค่าความผัน ผวนของค่าเงินเปลี่ยนไป

มาดูตัวอย่างอื่นกัน ซึ่งมาดูค่าเงิน EUR/USD และ USD/CHF ขณะที่เราเห็นความสัมพันธ์ที่เป็นบวก GBP/USD นั้นมีความสัมพันธ์เป็นบวกกับ USD/CHF

ถ้าเรามองดูกราฟรายสัปดาห์ มันมีค่าความสัมพันธ์เป็น ลบ มันไม่ได้เคลื่อนไหวตรงข้ามกันมาก

EUR/USD และ USD/CHF เหมือนไฟกับน้ำ ที่วิ่งตรงข้ามกันอย่างรุนแรง

ซึ่งสองคู่นี้เคลื่อนไหวในทางตรงข้ามกัน มาดูตามกราฟกัน :



การเข้าเทรดตรงกันข้ามกับค่าเงินที่เคลื่อนไหวตรงกันข้ามกันก็เหมือนกับการเทรดทิศทางเดียวกันในค่าเงินที่เคลื่อนไหวทิศทางเดียวกัน .

การ Buy EUR/USD และ sell USD/CHF ก็มีผลไม่ต่างกันกับการเพิ่มออร์เดอร์ในการเทรด ตัวอย่าง ถ้าคุณ Buy 1 Lot ค่าเงิน EUR/USD และ Sell 1 Lot ค่าเงิน USD/CHF หมายความว่า Buy Lot 2 ค่าเงิน EUR/USD เพราะว่าถ้า EUR/USD ขึ้น แล้ว USD/CHF ลง และคุณก็จะได้กำไรทั้งสองคู่

คุณยังจำได้ไหม คือ คุณกำลังเพิ่มความเสี่ยงในบัญชีเทรดของคุณถ้าคุณทำแบบนั้น มาดูตัวอย่าง เมื่อถ้า EUR/USD นั้นเคลื่อนไหวตรงข้ามกับออร์เดอร์ที่คุณถืออยู่ รวมทั้ง USD/CHF ด้วย หมายความว่า คุณต้องเสียทั้งสองคู่เช่นเดียวกัน

อีกแง่หนึ่ง การ Buy หรือ sell ทั้งสองคู่ พร้อมกัน นั้นอาจจะได้กำไรน้อย ไม่คุ้มกับการเทรด

เพราะว่า ค่าเงินสองคู่เคลื่อนไหวทิศทางต่างกัน เมื่อตัวหนึ่งได้กำไรอีกตัวหนึ่งก็จะขาดทุน ดังนั้นคุณจะต้องจับด้วยกำไรนิดหน่อย

หรือ คุณอาจจะจับด้วยขาดทุนนิดหน่อยซึ่งมาจากความแตกต่างของการเคลื่อนไหวค่าเงินและค่าความผันผวนของค่าเงิน

เราจะใช้ค่าความผันผวนในการเทรดอย่างไร

การใช้ตาราง ในการเทรด สำหรับค่าเงินตามค่าสัมประสิทธิ์ของความสัมพันธ์ของค่าเงิน

- 1.0 ค่าความสัมพันธ์ตรงข้ามสมบูรณ์
- 0.8 ค่าความสัมพันธ์ตรงข้ามสูงสุด
- 0.6 ค่าความสัมพันธ์ตรงข้ามสูง
- 0.4 ค่าความสัมพันธ์ตรงข้ามปานกลาง
- 0.2 ค่าความสัมพันธ์ตรงข้ามต่ำ
- 0 ไม่มีความสัมพันธ์ หรือ ไร้ทิศทาง
- 0.2 ค่าความสัมพันธ์ทิศทางเดียวกันต่ำ
- 0.4 ค่าความสัมพันธ์ทิศทางเดียวกันปานกลาง
- 0.6 ค่าความสัมพันธ์ทิศทางเดียวกันสูง
- 0.8 ค่าความสัมพันธ์ทิศทางเดียวกันสูงสุด
- 1.0 ค่าความสัมพันธ์ทิศทางเดียวกันสมบูรณ์

ดังนั้น ตอนนี้คุณคงรู้ว่า ค่าความสัมพันธ์ของค่าเงินนั้นใช้อย่างไร แต่ว่า เราว่าคุณกำลังสงสัยว่า แล้วมันใช้อย่างไรในการเทรดให้ประสบความสำเร็จ? ทำไมเราต้องเรียนรู้ทักษะนี้ด้วย ?

เหตุผลมีดังต่อไปนี้ :

1. การจัดการกำไรไม่คุ้มเสี่ยง

ประโยชน์ของความสัมพันธ์ของค่าเงินช่วยให้คุณอยู่ห่างจากการเทรดที่ทำให้กำไรในออร์เดอร์ที่คุณเปิดอยู่ลดลง ซึ่งตามตารางดังกล่าวก่อนหน้านี้ที่เราอธิบาย ค่าเงิน EUR/USD และ USD/CHF เคลื่อนไหวในทิศทางตรงกันข้าม 100 %

การเปิดออร์เดอร์ Buy EUR/USD และ Buy USD/CHF นั้นไม่มีประโยชน์ และเป็นต้นทุนที่เราต้องจ่ายแพง ยิ่งไปกว่านั้นต้องจ่าย Spread เพิ่มขึ้นด้วย และทุกๆ การเคลื่อนไหว ค่าเงินหนึ่งขึ้นอีกตัวจะลง

เราต้องการผลตอบแทนที่ดีกว่านี้ !

2. กำไรจาก Leverage

...หรือ ขาดทุน คุณมีโอกาที่จะทำกำไรได้สองเท่า และมาดูค่าความสัมพันธ์กับของ EUR/USD 1 สลิปดาร์ และ GBP/USD จากตัวอย่าง

ค่าเงินสองคู่นี้มีค่าความสัมพันธ์เป็นบวก เคลื่อนไหวตามกันตลอด

การเปิด Buy ทั้งสองคู่ เหมือนกับการเปิด EUR/USD 2 Lot ถ้ากำไรก็กำไร 2 คู่ ถ้าขาดทุนก็ขาดทุน 2 คู่!

3. กระจายความเสี่ยง

เข้าใจว่า ค่าความสัมพันธ์นั้นใช้กับต่างค่าเงิน และแทนที่จะเทรดค่าเดียว คุณสามารถกระจายความเสี่ยงไปค่าเงินอื่นที่เคลื่อนไหวในทิศทางเดียวกัน

เลือกค่าเงินที่เคลื่อนไหวไปในทิศทางเดียวกันตั้งแต่ค่า 0.7 ขึ้นไป ตามตัวอย่างค่าเงิน EUR/USD และ GBP/USD เคลื่อนไหวในทิศทางเดียวกัน ความไม่สมบูรณ์แบบของค่าความสัมพันธ์นี้จะช่วยให้คุณกระจายความเสี่ยงโดยการลดความเสี่ยงได้ สมมติว่า ค่าเงิน USD กำลังอยู่ในภาวะกระทิง

แทนที่จะเปิด sell EUR/USD คุณสามารถเปิด EUR/USD 1 Lot และ GBP/USD 1 Lot ซึ่งจะ เป็นเกราะป้องกันจากความเสี่ยงที่คุณกระจายไปอีกออร์เดอร์หนึ่ง

ในเหตุการณ์ที่ ค่าเงินดอลลาร์ถูกขายออก ค่าเงินยูโรอาจจะส่งผลกระทบน้อยกว่าค่าเงินปอนด์



4. ความเสี่ยงของการ Hedge

แม้ว่าการ Hedging จะได้กำไรน้อย แต่มันก็ช่วยให้เราขาดทุนน้อยเช่นกัน ถ้าคุณ เปิด Buy ค่าเงิน EUR/USD และมันเริ่มไม่เป็นอย่างที่คาดไว้ คุณสามารถเปิด Buy อีกค่าเงินหนึ่งที เคลื่อนไหวตรงข้ามกับ EUR/USD ได้เช่น ค่าเงิน USD/CHF

การขาดทุนเยอะก็จะลดลงไป !

คุณสามารถใช้ความได้เปรียบจากกำไรต่อการเคลื่อนไหว หรือ ต่อจุดที่ต่างกันในการเทรดแบบนี้

ตัวอย่าง ขณะที่ EUR/USD และ USD/CHF ซึ่งมีค่าความสัมพันธ์ -1.0 ที่มีทิศทางตรงข้ามกัน ความแตกต่างของกำไรต่อจุดของค่าเงินทั้งสอง สมมติว่า คุณเทรด 10000 mini Lot ค่าเงิน EUR/USD 1 จุดจะเท่ากับ 1 เหรียญ และ 1 จุดของค่าเงิน USD/CHF เท่ากับ 0.93 เหรียญ

ถ้าคุณ Buy EUR/USD 1 Mini Lot คุณก็สามารถทำการ Hedge ออร์เดอร์ โดยการ Buy 1 Lot ค่าเงิน USD/CHF ถ้า EUR/USD 10 จุด คุณก็จะขาดทุน 10 เหรียญ แต่ว่าคุณก็จะได้กำไร 9.30 เหรียญ

แทนที่คุณจะขาดทุน 10 เหรียญ คุณจะขาดทุนที่ 0.70 เหรียญ!

แม้ว่าการทำ Hedge เหมือนจะดี แต่มันก็มีข้อด้อย คือ ถ้า EUR/USD เป็นขาขึ้นคุณก็ได้กำไรน้อยจากออร์เดอร์ USD/CHF ที่ต้องขาดทุน

และความสัมพันธ์ของค่าเงินนั้นก็เปลี่ยนเมื่อไหร่ก็ได้ ลองจินตนาการดูว่า ถ้าค่าเงิน EUR/USD ร่วง 10 และ USD/CHF ขึ้น 5 จุดเท่านั้น แนนอนบัญชีเทรดของคุณต้องเสียหายแน่

ดังนั้น ระวังเมื่อคุณ Hedging !

5. ยืนยันสัญญาณ Breakout และหลีกเลี่ยงสัญญาณหลอก

คุณสามารถใช้ความสัมพันธ์ของค่าเงินในการยืนยันสัญญาณการเข้าเทรด

ตัวอย่าง ถ้า EUR/USD กำลังทดสอบแนวรับ คุณสามารถสังเกตพฤติกรรมราคา และอาจจะ Sell

เมื่อคุณรู้ว่า EUR/USD นั้นมีความสัมพันธ์เป็นบวกกับ GBP/USD และมีความสัมพันธ์ในทางลบกับ USD/CHF และ USD/JPY และคุณลองเช็คคู่อื่นว่ามีความสัมพันธ์แบบไหนกับ EUR/USD

คุณเห็นว่า GBP/USD นั้นก็อยู่ใกล้เส้นแนวรับ และ USD/CHF และ USD/JPY นั้นเทรตใกล้แนวต้านอย่างมีนัยสำคัญ

สิ่งนี้บอกคุณว่า การเคลื่อนไหวในค่าเงิน ดอลลาร์สหรัฐฯ และยืนยันจุด Break out สำหรับ EUR/USD เมื่ออีกสามคู่นั้นเคลื่อนไหวเช่นเดียวกัน ดังนั้นคุณเลยตัดสินใจว่าคุณจะเทรตเมื่อ Break out เมื่อมันเกิดขึ้น

ที่นี่ เราลองสมมติว่า อีกสามคู่ ไม่ได้เคลื่อนไหวพร้อมกับ EUR/USD GBP/USD นั้นยังไม่มี การเคลื่อนไหว และ USD/JPY ไม่ได้ขึ้น และ USD/CHF กำลังเคลื่อนไหว Side way

นี่เป็นสัญญาณที่บอกได้ว่า EUR/USD เป็นขาลงไม่ใช่เพราะ US dollar และการเคลื่อนไหวนั้น มาจากข่าวของ ค่าเงินยูโร

ราคาอาจจะเทรตอยู่ข้างล่างแนวรับที่คุณกำลังมองอยู่เพราะว่า อีก3 คู่เงินนั้นไม่ได้มีการเคลื่อนไหวพร้อมกับ EUR/USD ซึ่งจะมีการเคลื่อนไหวของราคาไม่ได้เป็นไปในทิศทางเดียวกัน และราคาก็จะกลับไปยืนเหนือแนวรับได้ จุดนี้อาจจะบอกเราได้ว่าเป็นสัญญาณหลอก

ถ้าคุณยังอยากเทรต ทั้ง ๆ ที่มันไม่มีความสัมพันธ์กัน ยืนยันการซื้อขาย จากคู่อื่น คุณสามารถเทรตได้โดยลดความเสี่ยงด้วยการใช้ขนาดของออร์เดอร์เล็ก ๆ ได้

รู้ว่า ค่าความสัมพันธ์เปลี่ยนแปลง

ตลาดฟอร์เร็กซ์ เหมือนกับคนไข้โรคจิตซึ่ง มีความผันผวนปรวนแปรของอารมณ์แกว่งตัวตลอดเวลา

เราไม่ได้โม้

แม้ว่าความสัมพันธ์ระหว่างค่าเงิน นั้นจะขึ้น ๆ ลง ๆ ตามระยะเวลา วัน สัปดาห์ เดือน หรือ รายปี พวกเขาก็เปลี่ยนได้ถ้าคุณไม่ตรวจสอบให้ดี

ค่าความสัมพันธ์ที่คุณเห็นเดือนนี้จะแตกต่างกับเดือนหน้า

มาดูตารางที่ 1 กัน

USD/JPY	EUR/USD	USD/CHF	GBP/USD	USD/CAD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	-0.23	0.22	-0.21	0.07	-0.22	0.07	0.14	-0.20
1 month	0.63	-0.52	-0.35	-0.58	0.46	0.64	0.89	0.77
3 month	-0.62	0.52	-0.62	-0.40	-0.30	0.09	0.24	-0.35
6 month	-0.62	0.78	0.14	0.43	-0.70	-0.63	0.58	-0.68
1 year	-0.69	0.74	-0.51	0.67	-0.69	-0.69	0.09	-0.20

เปรียบเทียบค่าสัมประสิทธิ์ที่แต่ละคู่ในแต่ละ Time Frame ดู

คุณเห็นอะไรบ้างไหม?

ทั้งหมด(ต้องขอบคุณ USD/JPY) ซึ่งไม่มีค่าเงินไหนเหมือนกัน ตาม Time Frame และทิศทาง

ที่นี้เราจะมาดูว่า การเปลี่ยนแปลงของค่าเงิน และพวกเขาเปลี่ยนแปลงในช่วงเวลาสั้น ๆ ได้คุณ
สามารถสังเกตได้จากตัวอย่างจากเดือน เดือน 1 และเดือนสาม

มันเคลื่อนไหวเยอะมาก !

เพราะว่า อารมณ์ตลาดนั้นเปลี่ยนแปลงค่าเงินในตลาดอยู่เสมอ คุณต้องระวังค่าความสัมพันธ์
ของค่าเงินด้วย

ตัวอย่าง ช่วงสัปดาห์หนึ่ง ค่าความสัมพันธ์ระหว่าง USD/JPY และ USD/CHF คือ 0.22 ซึ่งม
ความสัมพันธ์กันที่ต่ำมาก และบอกว่า ค่าเงินไม่ได้มีความสัมพันธ์กันน้อยมาก

อย่างไรก็ตาม ถ้าเรามองข้อมูล 3 เดือนในช่วงเวลาเดียวกัน จำนวนตัวเลขค่าสัมประสิทธิ์เพิ่ม
เป็น 0.52 และเพิ่มไป 0.78 ในเดือนที่หก และสุดท้ายในช่องปี เท่ากับ 0.74

ตามตัวอย่างนี้คุณจะเห็นว่า ค่าเงินสองคู่นี้ หยุดความสัมพันธ์ที่มียาวนาน ซึ่งที่เคยมี
ความสัมพันธ์เป็นบวกมาจะกลายเป็นไปในไม่ช้า

ถ้ามันเป็นคู่แท้กันเพียง เดือนเดียว หรือน้อยกว่านั้น ซึ่งด้วยความไม่เข้ากัน จะทำให้มันเร้าร้อน
ในวันข้างหน้า!

ถ้าคุณดูที่ค่าเงิน EUR/USD และ GBP/USD ต่อไปนี้เป็นตัวอย่างของค่าความสัมพันธ์ของค่าเงิน
เปลี่ยนไปมา

สัปดาห์แรกแสดงให้เห็นถึงค่าความสัมพันธ์ที่แข็งแกร่ง ด้วยค่า สัมประสิทธิ์ 0.94 !

...แต่ด้วยความสัมพันธ์นี้เสื่อมถอยลงในช่วงเวลา 1 เดือนมันร่วงไป 0.13 ก่อนที่จะขึ้นมาอีก
ในช่วงสามเดือน ที่ 0.83 และก็ลดอีกในช่วง หกเดือน

EUR/USD	USD/JPY	USD/CHF	GBP/USD	USD/CAD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	-0.23	-1.00	0.94	-0.98	0.98	0.93	0.93	0.86
1 month	0.63	-0.98	0.13	-0.90	0.90	0.96	0.91	0.86
3 month	-0.62	-0.92	0.83	0.14	0.63	0.42	0.61	0.75
6 month	-0.62	-0.85	0.31	-0.35	0.61	0.65	0.28	0.71
1 year	-0.69	-0.98	0.88	-0.93	0.95	0.96	0.66	0.02

นี่คือตัวอย่างที่ดี ว่าความสัมพันธ์ของค่าเงินนั้นเปลี่ยนแปลงได้อย่างไร มาดูค่าเงิน USD/JPY
และ NZD/USD...

USD/JPY	EUR/USD	USD/CHF	GBP/USD	USD/CAD	AUD/USD	NZD/USD	EUR/JPY	EUR/GBP
1 week	-0.23	0.22	-0.21	0.07	-0.22	0.07	0.14	-0.20
1 month	0.63	-0.52	-0.35	-0.58	0.46	0.64	0.89	0.77
3 month	-0.62	0.52	-0.62	-0.40	-0.30	0.09	0.24	-0.35
6 month	-0.62	0.78	0.14	0.43	-0.70	-0.63	0.58	-0.68
1 year	-0.69	0.74	-0.51	0.67	-0.69	-0.69	0.09	-0.20

ค่าความสัมพันธ์ 1 ปีเท่ากับ -0.69 บ่งบอกว่า มีความสัมพันธ์ทางลบที่แข็งแกร่ง แต่ว่าถ้า
คุณดูที่เวลา 1 เดือน ค่าสัมประสิทธิ์ นั้นเปลี่ยนไปเปลี่ยนมา ฉะนั้น ระวัง

ค่าความสัมพันธ์เปลี่ยนด้วยเหตุผลต่าง ๆ ซึ่งรวมไปถึงการเปลี่ยนแปลงอัตราดอกเบี้ย นโยบายการเงิน เศรษฐกิจ การเมือง

การคำนวณค่าความสัมพันธ์โดยใช้ Excel



อย่างที่คุณอ่านไป การคำนวณค่าความสัมพันธ์นั้นจะเปลี่ยนไปเรื่อย ๆ ในการที่จะดูค่าความสัมพันธ์ให้มีความแข็งแกร่งนั้นมีความสำคัญมาก

โชคดีที่เราสามารถคำนวณค่าความสัมพันธ์ในบ้านของคุณได้ โดยโปรแกรมง่าย ๆ อย่าง Excel

เราจะใช้ MS Excel ในการอธิบายว่าการใช้คำนวณค่าความสัมพันธ์ยังง

1. เรากำหนดราคาแต่ละวันขึ้นมาเอง แต่คุณสามารถใช้ข้อมูลจริงได้ ดังนั้นขั้นตอนที่ 1 หาข้อมูลที่ใช้คำนวณ 6 เดือน และข้อมูลเหล่านั้นต้องมีราคาปิด
2. เปิด Excel.
3. Copy และ paste ข้อมูลของคุณในตาราง หรือ เปิดไฟล์ exported data file from Step 1. ใช้ข้อมูล 6 เดือน !

	A	B	C	D	E	F	G
1	Date	EUR/USD Close	USD/JPY Close	USD/CHF Close	GBP/USD Close		
2	8/3/2009	1.4408	95.31	1.0601	1.6922		
3	8/4/2009	1.4388	95.27	1.0615	1.6919		
4	8/5/2009	1.4425	94.95	1.0605	1.7016		
5	8/6/2009	1.4341	95.44	1.066	1.6775		
6	8/7/2009	1.4169	97.59	1.0828	1.6668		
7	8/10/2009	1.4132	97.04	1.0855	1.6461		
8	8/11/2009	1.4148	96.02	1.0818	1.6481		
9	8/12/2009	1.4212	96.13	1.0759	1.6513		
10	8/13/2009	1.4274	95.27	1.0703	1.6563		
11	8/14/2009	1.4174	94.87	1.0746	1.6508		
12	8/17/2009	1.4083	94.48	1.0781	1.634		
13	8/18/2009	1.4142	94.64	1.075	1.6577		
14	8/19/2009	1.4237	93.92	1.0648	1.6539		
15	8/20/2009	1.4266	94.14	1.0621	1.6519		
16	8/21/2009	1.4346	94.31	1.0568	1.6495		
17	8/24/2009	1.4289	94.51	1.0623	1.6399		
18	8/25/2009	1.4311	94.18	1.0607	1.6352		
19	8/26/2009	1.4241	94.14	1.0682	1.6242		
20	8/27/2009	1.4372	93.45	1.0572	1.6287		
21	8/28/2009	1.4296	93.59	1.06	1.6282		
22	8/31/2009	1.4322	92.99	1.059	1.6266		
23	9/1/2009	1.4213	92.94	1.0662	1.6162		
24	9/2/2009	1.4268	92.15	1.0603	1.6269		
25	9/3/2009	1.425	92.55	1.0623	1.6323		
26	9/4/2009	1.4311	92.99	1.0593	1.6395		
27	9/7/2009	1.4329	92.88	1.06	1.6328		
28	9/8/2009	1.4507	92.2	1.0453	1.6503		
29	9/9/2009	1.4542	92.12	1.0424	1.653		
30	9/10/2009	1.4574	91.78	1.0392	1.6654		
31	9/11/2009	1.4594	90.58	1.037	1.6679		
32	9/14/2009	1.4615	90.82	1.0354	1.6575		
33	9/15/2009	1.4675	91.04	1.0334	1.6501		
34	9/16/2009	1.4731	90.83	1.0304	1.6505		
35	9/17/2009	1.4744	91.16	1.0284	1.6443		
36	9/18/2009	1.4722	91.38	1.0288	1.6268		
37	9/21/2009	1.4676	92.06	1.0326	1.6208		
38	9/22/2009	1.4799	91.18	1.0233	1.6365		
39	9/23/2009	1.4744	91.32	1.026	1.636		
40	9/24/2009	1.4652	91.26	1.0303	1.6063		
41	9/25/2009	1.4669	89.83	1.0295	1.5934		
42	9/28/2009	1.4599	89.65	1.0337	1.5872		
43	9/29/2009	1.4571	90.22	1.0376	1.5948		
44	9/30/2009	1.4632	89.77	1.0364	1.5983		
45	10/1/2009	1.4522	89.75	1.0418	1.5936		
46	10/2/2009	1.4571	89.74	1.0352	1.5914		
47	10/5/2009	1.4652	89.55	1.0319	1.5941		

1. ที่นี้จัดเรียงข้อมูลให้เหมือนในนี้ สามารถแต่งสี ขนาดได้แล้วแต่คุณ สีเหลืองอาจจะไม่เหมาะเท่าไร!

	A	B	C	D	E
L11		EUR/USD Close	USD/JPY Close	USD/CHF Close	GBP/USD Close
L12	1/1/2010	1.4318	93.08	1.0348	1.6166
L13	1/4/2010	1.4411	92.54	1.0298	1.6099
L14	1/5/2010	1.4366	91.65	1.0334	1.5993
L15	1/6/2010	1.4412	92.32	1.0275	1.6023
L16	1/7/2010	1.4319	93.27	1.0335	1.5936
L17	1/8/2010	1.4411	92.59	1.0238	1.6029
L18	1/11/2010	1.4526	92.06	1.0151	1.6108
L19	1/12/2010	1.4487	90.95	1.0182	1.6162
L20	1/13/2010	1.4506	91.45	1.0181	1.6283
L21	1/14/2010	1.4496	91.11	1.0184	1.6323
L22	1/15/2010	1.4375	90.81	1.0269	1.6258
L23	1/18/2010	1.4386	90.76	1.0245	1.6326
L24	1/19/2010	1.4304	91.07	1.0311	1.6372
L25	1/20/2010	1.4102	91.23	1.0439	1.6287
L26	1/21/2010	1.4098	90.36	1.0416	1.6208
L27	1/22/2010	1.414	89.87	1.0411	1.611
L28	1/25/2010	1.4153	90.21	1.0392	1.6232
L29	1/26/2010	1.4076	89.66	1.0458	1.614
L30	1/27/2010	1.4018	89.96	1.0499	1.6158
L31	1/28/2010	1.3971	89.85	1.0515	1.6128
L32	1/29/2010	1.3867	90.27	1.0604	1.6
L33					
L34					

2. ที่นี้คุณต้องเลือก Time Frame คุณต้องการค่าความสัมพันธ์ของ สัปดาห์ที่แล้ว เดือนที่แล้ว หรือ ปีที่แล้วล่ะ? จำนวนของข้อมูลจะเป็นตัวกำหนด แต่คุณก็สามารถเอามาใช้ได้เสมอ ตัวอย่างเช่น เราจะใช้ข้อมูลเดือนที่แล้ว

	A	B	C	D	E	F
118		EUR/USD Close	USD/JPY Close	USD/CHF Close	GBP/USD Close	
119	1/1/2010	1.4318	93.08	1.0348	1.6166	
120	1/4/2010	1.4411	92.54	1.0298	1.6099	
121	1/5/2010	1.4366	91.65	1.0334	1.5993	
122	1/6/2010	1.4412	92.32	1.0275	1.6023	
123	1/7/2010	1.4319	93.27	1.0335	1.5936	
124	1/8/2010	1.4411	92.59	1.0238	1.6029	
125	1/11/2010	1.4526	92.06	1.0151	1.6108	
126	1/12/2010	1.4487	90.95	1.0182	1.6162	
127	1/13/2010	1.4506	91.45	1.0181	1.6283	
128	1/14/2010	1.4496	91.11	1.0184	1.6323	
129	1/15/2010	1.4375	90.81	1.0269	1.6258	
130	1/18/2010	1.4386	90.76	1.0245	1.6326	
131	1/19/2010	1.4304	91.07	1.0311	1.6372	
132	1/20/2010	1.4102	91.23	1.0439	1.6287	
133	1/21/2010	1.4098	90.36	1.0416	1.6208	
134	1/22/2010	1.414	89.87	1.0411	1.611	
135	1/25/2010	1.4153	90.21	1.0392	1.6232	
136	1/26/2010	1.4076	89.66	1.0458	1.614	
137	1/27/2010	1.4018	89.96	1.0499	1.6158	
138	1/28/2010	1.3971	89.85	1.0515	1.6128	
139	1/29/2010	1.3867	90.27	1.0604	1.6	
140						
141						

3. ในช่องว่างข้างล่างนั้นให้เปรียบเทียบกับค่าเงิน (เราใช้ค่าความสัมพันธ์ของ EUR/USD และ ค่าเงินอื่น เราเริ่มจาก EUR/USD กับ USD/JPY) แล้วพิมพ์: **=correl(**

130	1/27/2010	1.4018	89.96	1.0499	1.6158	
131	1/28/2010	1.3971	89.85	1.0515	1.6128	
132	1/29/2010	1.3867	90.27	1.0604	1.6	
133			=CORREL(			
134			CORREL(array1, array2)			

4. ต่อไป เลือกกระยะของเซลล์ตารางสำหรับข้อมูลของ EUR/USD ตามด้วยคอมม่า คุณเห็น กรอบรอบ ๆ ข้อมูลที่คุณเลือก

	A	B	C	
111		EUR/USD Close	USD/JPY Close	USD/CHF
112	1/1/2010	1.4318	93.08	
113	1/4/2010	1.4411	92.54	
114	1/5/2010	1.4366	91.65	
115	1/6/2010	1.4412	92.32	
116	1/7/2010	1.4319	93.27	
117	1/8/2010	1.4411	92.59	
118	1/11/2010	1.4526	92.06	
119	1/12/2010	1.4487	90.95	
120	1/13/2010	1.4506	91.45	
121	1/14/2010	1.4496	91.11	
122	1/15/2010	1.4375	90.81	
123	1/18/2010	1.4386	90.76	
124	1/19/2010	1.4304	91.07	
125	1/20/2010	1.4102	91.23	
126	1/21/2010	1.4098	90.36	
127	1/22/2010	1.414	89.87	
128	1/25/2010	1.4153	90.21	
129	1/26/2010	1.4076	89.66	
130	1/27/2010	1.4018	89.96	
131	1/28/2010	1.3971	89.85	
132	1/29/2010	1.3867	90.27	
133			=CORREL(B112:B132	
134			CORREL(array1, array2)	

5. หลังจากคอมมา เลือกราคาของ USD/JPY ตามระยะที่คุณทำกับ EUR/USD

	A	B	C	D
111		EUR/USD Close	USD/JPY Close	USD/CHF Close
112	1/1/2010	1.4318	93.08	1.0348
113	1/4/2010	1.4411	92.54	1.0298
114	1/5/2010	1.4366	91.65	1.0334
115	1/6/2010	1.4412	92.32	1.0275
116	1/7/2010	1.4319	93.27	1.0335
117	1/8/2010	1.4411	92.59	1.0238
118	1/11/2010	1.4526	92.06	1.0151
119	1/12/2010	1.4487	90.95	1.0182
120	1/13/2010	1.4506	91.45	1.0181
121	1/14/2010	1.4496	91.11	1.0184
122	1/15/2010	1.4375	90.81	1.0269
123	1/18/2010	1.4386	90.76	1.0245
124	1/19/2010	1.4304	91.07	1.0311
125	1/20/2010	1.4102	91.23	1.0439
126	1/21/2010	1.4098	90.36	1.0416
127	1/22/2010	1.414	89.87	1.0411
128	1/25/2010	1.4153	90.21	1.0392
129	1/26/2010	1.4076	89.66	1.0458
130	1/27/2010	1.4018	89.96	1.0499
131	1/28/2010	1.3971	89.85	1.0515
132	1/29/2010	1.3867	90.27	1.0604
133		=CORREL(B112:B132,C112:C132)		
134		CORREL(array1, array2)		

6. กด Enter ในคีย์บอร์ด ในการคำนวณ ค่าสัมประสิทธิ์ความสัมพันธ์ของ EUR/USD และ USD/JPY.

131	1/28/2010	1.3971	89.85
132	1/29/2010	1.3867	90.27
133			0.629644119
134			

7. ทำซ้ำขั้นตอน 5-9 กับค่าเงินอื่น ๆ และ Time Frame อื่น เมื่อเสร็จแล้วคุณก็ใช้ข้อมูลนี้ไปทำตารางแบบข้างนี้ !

134				
135		EUR/USD Close	USD/JPY Close	USD/CHF Close
136	1 Week		-0.23	-1.00
137	1 Month		0.63	-0.98
138	3 Months		-0.62	-0.92
139	6 Months		0.29	0.33
140				
141				

ซึ่งคือ one-week, one-month, three-month, six-month, และ one-year ตามลำดับ แต่ว่าแล้วแต่คุณว่าจะเลือกใช้ข้อมูลช่วง Time Frame ไหนในการวิเคราะห์

มันอาจจะน่าเบื่อ ถ้าคุณต้องปรับเปลี่ยนข้อมูลทุกวัน แม้ว่า你会ชอบการใช้ความสัมพันธ์ของค่าเงิน คุณสามารถอัปเดตมันทุก ๆ อาทิตย์ก็พอ

ถ้าคุณพบว่าคุณอัปเดตตารางค่าความสัมพันธ์บ่อยเกินไป เราแนะนำว่าไปหาอะไรอย่างอื่นทำด้วย

สรุป: ความสัมพันธ์ของค่าเงิน



เหมือนพวกนักว่ายน้ำโรคจิต ค่าเงินบางคู่ นั้นเคลื่อนไหวเข้ากันกับคู่เงินอื่นเป็นอย่างดี

และเหมือนขั้วแม่เหล็ก ค่าเงินเคลื่อนไหวในทิศทางตรงกันข้ามอย่างสิ้นเชิง

เมื่อคุณเทรดหลายคู่ในบัญชีเทรดของคุณ สิ่งสำคัญที่สุดคือ คุณต้องระวังความเสี่ยงของคุณ

ถ้าคุณคิดว่า คุณกำลังกระจายความเสี่ยง แต่ว่า คุณควรจะค่าเงินไหนเคลื่อนไหวไปทิศทางใด

การเทรดค่าเงินที่มีความสัมพันธ์กันสูง นั้นหมายความว่า คุณกำลังเพิ่มความเสี่ยง !

ค่าความสัมพันธ์ระหว่างคู่เงินนั้นสามารถแข็งหรืออ่อนได้ภายในสัปดาห์ รายเดือน หรือ รายปี ซึ่งมันเปลี่ยนแปลงอย่างรวดเร็ว

การปรับปรุงค่าความสัมพันธ์สามารถช่วยให้คุณตัดสินใจดีขึ้น ถ้าคุณต้องการใช้ Leverage หรือ Hedge หรือเทรดแบบกระจายความเสี่ยง

จุดเล็ก ๆ ที่ต้องจำ

- ค่าสัมประสิทธิ์จะคำนวณโดยใช้ราคาปิดแต่ละวัน
- ค่าสัมประสิทธิ์ที่เป็นบวก บอกว่า ค่าเงินนั้นเคลื่อนไหวในทิศทางเดียวกัน
- ค่าสัมประสิทธิ์ที่เป็น ลบ บอกว่า ค่าเงินนั้นเคลื่อนไหวในทิศทางตรงกันข้ามกัน
- ค่าสัมประสิทธิ์ของความสัมพันธ์ที่อยู่ใกล้ +1 หรือ -1 นั้น สองค่าเงินมีความสัมพันธ์กันสูง
- ค่าความสัมพันธ์สามารถใช้ในการ Hedge เทรดค่าเงินในทิศทางต่างกัน และ การใช้ Leverage กับออร์เดอร์

ตัวอย่างของค่าเงินที่เคลื่อนไหวในทิศทางเดียวกัน

- EUR/USD และ GBP/USD
- EUR/USD และ AUD/USD
- EUR/USD และ NZD/USD
- USD/CHF และ USD/JPY
- AUD/USD และ NZD/USD

ค่าเงินที่เคลื่อนไหวตรงข้ามกัน

- EUR/USD และ USD/CHF
- GBP/USD และ USD/JPY
- USD/CAD และ AUD/USD
- USD/JPY และ AUD/USD
- GBP/USD และ USD/CHF

เมื่อคุณพบว่า คุณเทรดค่าเงินสองคู่ที่มีความสัมพันธ์กันสูง คุณต้องมั่นใจว่ามันไม่หลุดจากกรอบความเสี่ยงที่คุณกำหนดไว้ !