

40. Forex'te Korelasyon Nedir ve Nasıl Kullanılır?

Temel Analiz | Orta Makale (~300-500 kelime)

Korelasyon Kavramı

Korelasyon, iki varlığın birbirinden ne ölçüde bağımsız ya da bağımlı hareket ettiğini gösterir. +1'e yakın değer güçlü pozitif korelasyonu (aynı yönde hareket), -1'e yakın değer güçlü negatif korelasyonu (ters yönde hareket), 0 ise ilişkisizliği ifade eder.

Önemli Korelasyon Çiftleri

- EUR/USD ve USD/CHF: Yaklaşık -0,9 korelasyon — genellikle ters yönde hareket eder.
- EUR/USD ve GBP/USD: Yüksek pozitif korelasyon — benzer yönde hareket eder.
- AUD/USD ve XAU/USD: Altın ile Avustralya doları arasında genellikle pozitif ilişki (Avustralya altın ihracatçısı).
- USD/JPY ve S&P 500: Risk iştahı arttığında her ikisi de yükselir.

Korelasyonu İşlemde Kullanmak

Aynı anda EUR/USD ve GBP/USD'de long pozisyon açmak, tek bir pozisyon açmaktan çok daha az çeşitlendirme sağlar; her ikisi dolar güçlenmesinden olumsuz etkilenir. Negatif korelasyonlu çiftlerle portföy dengelemek riski dağıtır. Risk yönetimi açısından açık pozisyonların toplam dolar riskini hesaplamak önemlidir.