



CYCLICAL WAVES
Discovering Order Within Chaos

تحليل گزارش COT

هفته منتهی به ۲۶ آوریل ۲۰۱۶

Support@[CyclicalWaves.com](mailto:Support@CyclicalWaves.com)

<https://telegram.me/CyclicalWaves>

فهرست

۱	نکات مهم
۲	جدول تحلیلی
۴	سلب مسئولیت

- در هفته منتهی به ۲۶ آوریل، سفته‌بازان همچنان به دلارفروشی ادامه دادند. تفاوتی که این هفته ایجاد شد، خرید سنگین پوند از یکسو و کاهش پوزیشن‌های باز به طور کلی روی ین ژاپن بود.
- تداوم فروش دلار میزان پوزیشن خالص سفته‌بازان بزرگ را به پایین‌ترین میزان از می ۲۰۱۴ به این سو رسانده است. بیانیه FOMC در هفته گذشته که حاوی هیچ گونه اشاره‌ای به احتمال افزایش نرخ بهره در ماه ژوئن نبود می‌تواند باعث تشویق سفته‌بازان به دلارفروشی بیشتر گردد.
- در حال حاضر سفته‌بازان به صورت خالص تنها روی یورو و پوند فروشنده هستند و روی بقیه ارزها خریدار هستند.
- روی دلار استرالیا همچنان سفته‌بازان به صورت خالص در حال افزایش خرید هستند. در حال حاضر پوزیشن خالص خرید سفته‌بازان روی این ارز به بالاترین حد خود از آوریل ۲۰۱۳ رسیده است. انتشار گزارش بسیار ضعیف تورم اخیر به همراه نشست پیش‌روی RBA در صورتی که با کاهش نرخ بهره یا اشاره آشکار به این امر همراه گردد، می‌تواند باعث ایجاد یک موج سنگین شناسایی سود و بستن پوزیشن‌های خرید بگردد.
- روی دلار کانادا، سفته‌بازان این بار به طور مستقیم دست به خرید زده‌اند و پوزیشن خالص آنها به بالاترین میزان خرید از ماه سپتامبر ۲۰۱۴ رسیده است. تداوم رشد نفت می‌تواند باعث تقویت نظر مثبت سفته‌بازان روی دلار کانادا بشود.
- سفته‌بازان بزرگ ترجیح دادند قبل از نشست بانک مرکزی ژاپن دست به تسویه بخشی از قراردادهای خرید خود بزنند. با بی‌اقدامی BOJ و رشد سنگین ین، به احتمال زیاد مجدداً موج خرید ین از سوی سفته‌بازان بزرگ تشدید خواهد شد.

- در خصوص یورو، پس از خرید سنگین هفته گذشته در هفته منتهی به ۲۶ آوریل شاهد موج تسویه قراردادهای فروش بودیم. در سوی مقابل و در فرانک سوییس، سفته‌بازان به طور همزمان پوزیشن‌های خرید و فروش پرحجمی را به طور همزمان باز کردند. در هفته‌های آینده شاهد نوسانات شدید روی فرانک سوییس خواهیم بود.
- برای نخستین بار در ۶ هفته گذشته سفته‌بازان بزرگ دست به خرید سنگین پوند زدند و میزان پوزیشن‌های خرید خود را به میزان ۲۳٪ افزایش دادند. به نظر می‌رسد کاهش احتمال جدایی از اروپا عامل اصلی تشویق سفته‌بازان به خرید پوند بوده است.
- در آستانه نشست چهارشنبه FOMC، سفته‌بازان بزرگ پوزیشن‌های باز خود را روی طلا کاهش دادند که خصوصاً در بخش فروش برجسته‌تر بود. با صعود طلا به سقف جدید و با توجه به استراتژی تعقیب مومنتوم سفته‌بازان، انتظار داریم در هفته آینده شاهد تشدید موج خرید طلا از سوی سفته‌بازان بزرگ باشیم.
- سفته‌بازان بزرگ در حوزه نفت پوزیشن‌های خود را هم در حوزه خرید و هم فروش افزایش دادند.
- بر حسب درصد و در مقایسه با هفته قبل، بیشترین افزایش پوزیشن‌های خرید مربوط به پوند و فرانک سوییس با ۲۳.۴٪ و ۲۰.۸٪ بود و بیشترین افزایش پوزیشن‌های فروش مربوط به فرانک سوییس با ۴۰.۹٪ و دلار آمریکا با ۲٪ می‌شود.
- بر حسب درصد و در مقایسه با هفته قبل، بیشترین کاهش پوزیشن‌های خرید مربوط به ین ژاپن با کاهش ۷.۸ درصدی و بیشترین کاهش پوزیشن‌های فروش نیز مربوط به طلا با کاهش ۹.۴ درصدی و ین ژاپن با کاهش ۸.۵ درصدی می‌شود.

نام ابزار مالی	پوزیشن خالص	موقعیت تاریخی	تغییر پوزیشن خالص	تغییر موقعیت های باز	حرکت تجاری ها
یورو	-۳۹۶۶۷	پایین محدوده خنثی	+۷۲۵۰	کاهش خرید/کاهش بیشتر فروش	کاهش خرید/افزایش فروش
فرانک	+۹۲۶۵	بالای محدوده خنثی	-۱۴۵	افزایش خرید/افزایش فروش	کاهش خرید/کاهش فروش
پوند	-۴۸۶۶۹	پایین محدوده خنثی	+۶۴۸۳	افزایش خرید/افزایش فروش	کاهش خرید/افزایش فروش
ین	+۶۶۴۹۸	بیش خرید	-۵۳۷۲	کاهش بیشتر خرید/کاهش فروش	کاهش خرید/کاهش بیشتر فروش
دلار استرالیا	+۵۹۵۴۰	خنثی	+۱۵۴۳۴	افزایش خرید/کاهش فروش	افزایش خرید/افزایش بیشتر فروش
دلار نیوزلند	+۷۳۷۴	خنثی	+۲۰۳۳	افزایش خرید/کاهش فروش	افزایش خرید/افزایش بیشتر فروش
دلار کانادا	+۱۱۹۹۹	خنثی	+۴۶۹۱	افزایش خرید/کاهش فروش	افزایش خرید/افزایش بیشتر فروش
شاخص دلار	+۱۱۳۳۰	خنثی	-۲۱۱۹	کاهش خرید/افزایش فروش	افزایش بیشتر خرید/افزایش فروش
طلا	+۲۲۰۸۵۷	بیش خرید	+۴۰۲۰	کاهش خرید/کاهش بیشتر فروش	کاهش خرید/کاهش فروش
نفت	+۳۳۴۲۶۵	بیش فروش	+۹۰	افزایش خرید/افزایش فروش	افزایش خرید/افزایش فروش

سلب مسئولیت

گروه Cyclical Waves در راستای گسترش سبک های نوین تحلیل گری و نگاه حرفه ای به بازارهای مالی به شکل روزانه تحلیل های خود را در حوزه تکنیکال و فاندامنتال ارائه می دهد نظر به اینکه در ارائه تحلیل و نوع نگاه ممکن است خطاهایی وجود داشته باشد مخاطب باید در خصوص ریسک های موردنظر دقت لازم را داشته باشد. گروه Cyclical Waves هیچ مسئولیتی در خصوص سود و زیان مخاطبین و استفاده کنندگان از تحلیل ندارد.