

بسم الله الرحمن الرحيم

◀ لماذا، استراتيجيية، الإيتجاه.....؟؟ ▶

سأقوم بوضع بعض المعلومات المهمة قبل التطرق الي شرح الاستراتيجية لأن شرحها سيطول أتمني التوفيق من الله

...

بين عامي ٢٠٠١، ٢٠٠٤ زاد حجم التداول في سوق العملات العالمية إلي أكثر من ٥٠ % موضعا الزيادة العامة في شعبية تداول العملات . ومع ظهور التقدم التكنولوجي الذي سمح لتجار الأسهم وتجار العقود الآجلة إلي التطلع لأبعد من تجارتهم التقليدية.

معظم تجار المدى القصير والمضاربين في سوق العملات يعتمدون علي التحليل الفني لذلك كلا من تجار الأسهم والعقود الآجلة الذين يستخدمون التحليل الفني قامو بالتحويل إلي سوق العملات بكل سهولة ويسر بالرغم من أن هناك نوع واحد من التحليل لم يسمح للتجار بالتحويل الي تجارة العملات وهو التداول علي أساس الحجم.

وحيث أن سوق العملات سوق لا مركزي وليس هناك تبادل واحد يتابع جميع الانشطة التجارية التي تتم فيه وجد أنه من الصعب تقدير حجم التداول لكل مستوي سعري.

وبدلا من التداول علي أساس الحجم ذهب العديد من التجار إلي هيئة تداول السلع الآجلة (cftc) التي بها تقارير عن إلتزامات التجار أو ما يسمى بالكوت (cot) اختصار لـ Commitments of Traders وهذه التقارير تخبرنا عن الوضع في سوق العقود الآجلة ولمزيد من المعلومات وحجم التداول في سوق العقود الآجلة

وهنا سوف نلاحظ كيف للترندات التاريخية لتقارير الكوت مساعدة تجار العملات الأجنبية في معرفة الحالة النفسية لسوق العملات..

المشاركة القادمة ستكون عن التعريف بما هو تقرير الكوت.؟؟

ما هو تقرير الكوت (cot)..؟؟

تقارير الكوت أو الإلتزامات التجارية نشرت لأول مرة بواسطة هيئة تداول السلع الآجلة في عام ١٩٦٢ وكانت لـ ١٣ سلعة زراعية لإطلاع الرأي العام حول الأوضاع الراهنة في عمليات السوق الآجلة... أصبحت التقارير الصادرة أوسع نطاقا شاملة معلومات عن العملات الأجنبية الآجلة

سوف أوضح كيف يمكن الحصول علي هذه التقارير في المشاركة القادمة

- كانت التقارير تصدر مرة واحدة في الشهر ولكن بحلول عام ٢٠٠٠ أصبحت تصدر أسبوعيا

كل يوم جمعة الساعة ١٠:٣٠ مساء بتوقيت السعودية قبل اغلاق سوق العملات الاجنبية ولحسن حظ تجار العملات الأجنبية أصبحت التقارير الصادرة أوسع نطاقا شاملة معلومات عن العملات الأجنبية الأجلة . يمكن أن تكون التقارير الصادرة مفيدة جدا في قياس حركة السعر إذا ما استخدمت بحكمة . والتحذير هنا هو أن دراسة التقارير يمكن أن تكون خادعة بسبب تأخر نشر التقارير حيث ان التقارير التي تنشر كل يوم جمعة هي تقارير حتي يوم الثلاثاء الماضي ولذلك فإن التقارير تخرج بعد ثلاثة أيام عمل بعد أن تتم المعاملات الفعلية في سوق العقود الأجلة

كيف يمكن الحصول علي تقارير الكوت ..؟؟

شكل التقرير المقصود يكون هكذا
تقرير خاص بعملة اليورو EUR

EURO FX - CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE								Ccd=U99741	
FUTURES ONLY POSITIONS AS OF 09/14/10								NONREPORTABLE POSITIONS	
NON-COMMERCIAL			COMMERCIAL			TOTAL		NONREPORTABLE POSITIONS	
LONG	SHORT	SPREADS	LONG	SHORT	LONG	SHORT	LONG	SHORT	
CONTRACTS OF EUR 125,000:								OPEN INTEREST: 170,651	
COMMITMENTS									
54,543	64,187	1,022	67,986	53,316	123,551	123,525	47,100	47,126	
CHANGES FROM 09/07/10 (CHANGE IN OPEN INTEREST: -87,137)									
1,337	-12,668	-1,531	-80,329	-61,412	-80,473	-74,611	-6,664	-12,526	
PERCENT OF OPEN INTEREST FOR EACH CATEGORY OF TRADERS									
32.0	37.6	0.6	39.8	34.2	72.4	72.4			
NUMBER OF TRADERS IN EACH CATEGORY (TOTAL TRADERS: 153)									
55	42	12	29	39	86	91			



ندخل أولا علي موقع هيئة تداول السلع

U.S. Commodity Futures Trading Commission - Lenovo XP 7 Style

http://www.cftc.gov/

File Edit View Favorites Tools Help

Favorites U.S. Commodity Futures Trading Commission

RSS Feeds

U.S. COMMODITY FUTURES TRADING COMMISSION
ENSURING THE INTEGRITY OF THE FUTURES & OPTIONS MARKETS

ABOUT THE CFTC | PRESS ROOM | MARKET REPORTS | CONSUMER PROTECTION | INDUSTRY OVERSIGHT

ثم تابع الصور

RSS Feeds

U.S. COMMODITY FUTURES TRADING COMMISSION
ENSURING THE INTEGRITY OF THE FUTURES & OPTIONS MARKETS

ABOUT THE CFTC | PRESS ROOM | MARKET REPORTS | CONSUMER PROTECTION | INDUSTRY OVERSIGHT

FEATURED STORIES

Bank Participa

Commitments of Traders
Index Investment Data
This Month in Futures Markets
Cotton On-Call
Bank Participation Reports
Financial Data for FCMs
Economic Analysis

FXArabia

تابع

Mostafa Amasha

CURRENT LEGACY REPORTS:

تقارير جميع العملات ما عدا الدولار

	Futures Only		Futures-and-Options-Combined	
Chicago Board of Trade	Long Format	Short Format	Long Format	Short Format
Chicago Mercantile Exchange	Long Format	Short Format	Long Format	Short Format
Chicago Board Options Exchange	Long Format	Short Format	Long Format	Short Format
Chicago Climate Futures Exchange	Long Format	Short Format	Long Format	Short Format
Kansas City Board of Trade	Long Format	Short Format	Long Format	Short Format
London Mercantile Exchange	Long Format	Short Format	Long Format	Short Format
London Metal Exchange	Long Format	Short Format	Long Format	Short Format
ICE Futures U.S.	Long Format	Short Format	Long Format	Short Format
ICE Futures Europe	Long Format	Short Format	Long Format	Short Format
ICE - OTC	Long Format	Short Format	Long Format	Short Format
New York Mercantile Exchange	Long Format	Short Format	Long Format	Short Format
Supplemental Commodity Index			CIT Report	

هذا للدولار الأمريكي



بعد الضغط علي Short format ستجد تقارير كثيرة للعملات وبعض السلع وبعض المؤشرات العالمية نركز فقط علي تقارير العملات

ملاحظة هامة جدا

هذا التقرير التالي ليس له أي أهميه بمفرده هكذا

EURO FX - CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE Code-U99741
FUTURES ONLY POSITIONS AS OF 09/14/10

NON-COMMERCIAL							COMMERCIAL		TOTAL		NONREPORTABLE POSITIONS	
LONG	SHORT	SPREADS	LONG	SHORT	LONG	SHORT	LONG	SHORT	LONG	SHORT		
CONTRACTS OF EUR 125,000:							OPEN INTEREST:		170,651			
54,543	64,187	1,022	67,986	53,315	123,551	123,525	47,100	47,126				
CHANGES FROM 09/07/10							CHANGE IN OPEN INTEREST:		-87,137			
1,337	-12,668	-1,531	-80,329	-61,412	-80,473	-74,611	-6,664	-12,526				
PERCENT OF OPEN INTEREST FOR EACH CATEGORY OF TRADERS												
32.0	37.6	0.6	39.8	34.2	72.4	72.4						
NUMBER OF TRADERS IN EACH CATEGORY (TOTAL TRADERS: 153)												
55	42	12	29	39	86	91						



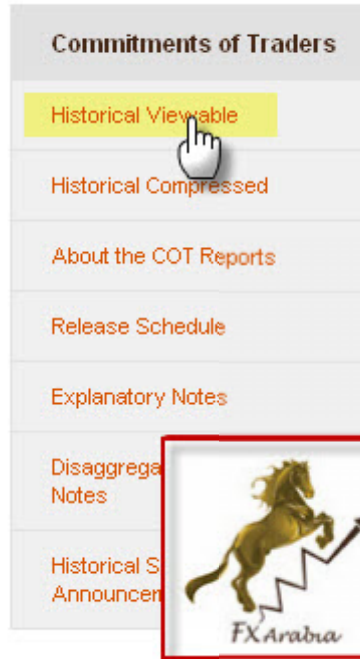
وكما نعلم أن التقارير تنشر كل يوم جمعة فسنتحاج لتقرير الأسبوع السابق الذي
بتاريخ ٢٠١٠/٠٧/٠٩

اذن كيف نحصل علي التقارير الأسبوعية السابقة....

تابع الصور

The screenshot shows the website header for the U.S. Commodity Futures Trading Commission (CFTC). The main navigation bar includes 'ABOUT THE CFTC', 'PRESS ROOM', 'MARKET REPORTS', 'CONSUMER PROTECTION', and 'INDUSTRY OVERSIGHT'. The 'MARKET REPORTS' menu is open, displaying a list of reports: 'Commitments of Traders', 'Index Investment Data', 'This Month in Futures Markets', 'Cotton On-Call', 'Bank Participation Reports', 'Financial Data for FCMs', and 'Economic Analysis'. The 'Commitments of Traders' option is highlighted. The background of the page features a grid of numbers and a 'Bank Participa' headline. The FXArabia logo is visible in the bottom right corner of the screenshot.

بعد ذلك علي يسار الصفحة نجد




نضغط علي *Historical Viewable*

2005-2010 Full Reports

The weekly Commitments of Traders Reports for Futures Only Commitments of Traders and for Futures-and-Options Combined Commitments of Traders in viewable (html) report format are available here.

Dates indicate the report date and not the release date.

2010	Dates				
September					
August		<u>10</u>	<u>17</u>	<u>24</u>	<u>31</u>
July	<u>6</u>	<u>13</u>	<u>20</u>	<u>27</u>	
June	<u>1</u>	<u>8</u>	<u>15</u>	<u>22</u>	<u>29</u>
May	<u>4</u>	<u>11</u>	<u>18</u>	<u>25</u>	
April	<u>6</u>	<u>13</u>	<u>20</u>	<u>27</u>	
March	<u>2</u>	<u>9</u>	<u>16</u>	<u>23</u>	<u>30</u>
February	<u>2</u>	<u>9</u>	<u>16</u>	<u>23</u>	
January	<u>5</u>	<u>12</u>	<u>19</u>	<u>26</u>	

2009	Dates				
December	<u>1</u>	<u>8</u>	<u>15</u>	<u>22</u>	<u>29</u>
November	<u>3</u>	<u>9</u>	<u>17</u>	<u>24</u>	
October	<u>6</u>	<u>13</u>	<u>20</u>	<u>27</u>	
September	<u>1</u>	<u>8</u>	<u>15</u>	<u>22</u>	<u>29</u>



سجد التقارير الأسبوعية متاحة منذ ٢٠٠٥ حتى الآن ٢٠١٠

ثم نحصل علي التقرير للأسبوع السابق ليوم
٢٠١٠/٠٧/٠٩

EURO FX - CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
 FUTURES ONLY POSITIONS AS OF 09/07/10

Code-099741

NON-COMMERCIAL							COMMERCIAL		TOTAL		NONREPORTABLE POSITIONS	
LONG	SHORT	SPREADS	LONG	SHORT	LONG	SHORT	LONG	SHORT	LONG	SHORT		
(CONTRACTS OF EUR 125,000)							OPEN INTEREST:		257,788			
53,156	76,855	2,553	148,315	118,728	204,024	198,136	53,764	59,652				
CHANGES FROM 08/31/10 (CHANGE IN OPEN INTEREST:							16,655)					
2,057	187	372	4,458	6,281	6,867	6,840	9,788	9,815				
PERCENT OF OPEN INTEREST FOR EACH CATEGORY OF TRADERS												
20.6	29.8	1.0	57.5	46.1	79.1	76.9						
NUMBER OF TRADERS IN EACH CATEGORY (TOTAL TRADERS:										158)		
42	53	25	58	44	92	110						



mostafa amasha

قراءة تقرير الكوت

EURO FX - CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE							CcdE-U99741		
FUTURES ONLY POSITIONS AS OF 09/14/10									
NON-COMMERCIAL			COMMERCIAL		TOTAL		NONREPORTABLE POSITIONS		
LONG	SHORT	SPREADS	LONG	SHORT	LONG	SHORT	LONG	SHORT	
CONTRACTS OF EUR 125,000:						OPEN INTEREST:		170,651	
54,543	64,187	1,022	67,986	53,316	123,551	123,525	47,100	47,126	
CHANGES FROM 09/07/10 (CHANGE IN OPEN INTEREST: -87,137)									
1,337	-12,668	-1,531	-80,329	-61,412	-80,473	-74,611	-6,664	-12,526	
PERCENT OF OPEN INTEREST FOR EACH CATEGORY OF TRADERS									
32.0	37.6	0.6	39.8	34.2	72.4	72.4			
NUMBER OF TRADERS IN EACH CATEGORY (TOTAL TRADERS: 153)									
55	42	12	29	39	86	91			



هذا التقرير لعملة اليورو

قمت بتظليل المهم فقط في الصورة والذي سنحتاجه في العمل

LONG معناها عدد عقود الشراء

SHORT معناها عدد عقود البيع
ينقسم التقرير إلي قسمين :-

- صفقات مبلغ عنها وتشمل ال
COMMERCIAL
NON-COMMERCIAL و

- صفقات غير مبلغ عنها وتشمل ال

NONREPORTABLE POSITIONS

بالنسبة لصفقات
COMMERCIAL

تشمل وصف كيان المشاركة في الإنتاج والتصنيع أو الترويج لسلعة وذلك باستخدام العقود الأجلة للتحوط

بالنسبة لصفقات
NON-COMMERCIAL
وهي الأهم

تشمل التجار مثل التجار الفرديين وصناديق التحوط والمؤسسات الضخمة الذين يستخدمون سوق العقود الآجلة من أجل المضاربة فقط ويلبون متطلبات هيئة تداول السلع الآجلة في الإبلاغ عن صفقاتهم استخدام تقارير الكوت

- عند استخدام تقارير الكوت وجد أن الصفقات التجارية COMMERCIAL أقل أهمية من الصفقات الغير تجارية NON-COMMERCIAL لأن غالبية تداول صفقاتهم في سوق العملات نفسه أو ما يسمى بال سبوت لذلك فإن الصفقات التجارية COMMERCIAL ليس من المرجح أن تعطي تمثيلا دقيقا لوضع السوق الحقيقي
- في المقابل فإن صفقات NON-COMMERCIAL أكثر ثقة لأنها تجسد مواقف التجار في سوق محددة (سوق العقود الآجلة) كما ذكرنا سابقا

لذلك عند استخدام أي تقرير لأي عملة سنعمل علي صفقات
NON-COMMERCIAL
فقط

EURO FX - CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE							CcdB-U99741		
FUTURES ONLY POSITIONS AS OF 09/14/10							NONREPORTABLE POSITIONS		
NON-COMMERCIAL			COMMERCIAL		TOTAL		NONREPORTABLE POSITIONS		
LONG	SHORT	SPREADS	LONG	SHORT	LONG	SHORT	LONG	SHORT	
(CONTRACTS OF EUR 125,000)						OPEN INTEREST:		170,651	
54,543	64,187	1,022	67,986	58,315	123,551	123,525	47,100	47,126	
COMMITMENTS									
CHANGES FROM 09/07/10 (CHANGE IN OPEN INTEREST:						-87,137;			
1,387	-12,668	-1,531	-80,329	-60,412	-80,473	-74,611	-6,664	-12,526	
PERCENT OF OPEN INTEREST FOR EACH CATEGORY OF TRADERS									
32.0	37.6	0.6	39.8	34.2	72.4	72.4			
NUMBER OF TRADERS IN EACH CATEGORY (TOTAL TRADERS:						153)			
55	42	12	29	39	86	91			



كما هو مظلل في الصورة

LONG حجم صفقات الشراء

SHORT حجم صفقات البيع
أحدث تقرير لليورو حتي الآن

EURO FX - CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE							Code-099741		
FUTURES ONLY POSITIONS AS OF U9/21/10									
NON-COMMERCIAL			COMMERCIAL		TOTAL		NONREPORTABLE POSITIONS		
LONG	SHORT	SPREADS	LONG	SHORT	LONG	SHORT	LONG	SHORT	
(CONTRACTS OF EUR 125,000)							OPEN INTEREST:		167,463
COMMITMENTS									
52,300	47,203	2,605	63,931	70,956	113,836	120,764	48,627	46,659	
CHANGES FROM 09/14/10 (CHANGE IN OPEN INTEREST: -3,188)									
-2,243	-16,984	1,583	-4,055	12,640	-4,715	-2,761	1,527	-427	
PERCENT OF OPEN INTEREST FOR EACH CATEGORY OF TRADERS									
31.2	28.2	1.6	38.2	42.4	71.0	72.1	29.0	27.9	
NUMBER OF TRADERS IN EACH CATEGORY (TOTAL TRADERS: 146)									
50	40	11	29	39	84	85			

تابع استخدام تقارير الكوت

هناك ثلاثة طرق مختلفة يمكن استخدامها من متابعة وضع سوق العقود الآجلة للتنبؤ باتجاهات الأسعار في السوق الفورية للعملة الأجنبية التي نعمل عليها (spot) :

عن طريق متابعة التغير في حجم الصفقات الغير تجارية NON-COMMERCIAL أسبوعيا

NON-COMMERCIAL		
LONG	SHORT	SPREADS
(CONTRACTS OF EUR 125,000)		
COMMITMENTS		
52,300	47,203	2,605



عن طريق متابعة الارتفاع أو الانخفاض المفاجئ في حجم الصفقات سنسميها مستويات سعرية خاصة وهي مشتقة من الاولي

عن طريق متابعة ال OPEN INTEREST لأنها قد تعطي اشارة بقرب انتهاء التردد الحالي وسنتركها ونحدث عنها لاحقا لأنني لم انتهي من دراستها

EURO FX - CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE							Ccd=U99741		
FUTURES ONLY POSITIONS AS OF 09/14/10									
NON-COMMERCIAL			COMMERCIAL		TOTAL		NONREPORTABLE POSITIONS		
LONG	SHORT	SPREADS	LONG	SHORT	LONG	SHORT	LONG	SHORT	
CONTRACTS OF EUR 125,000:						OPEN INTEREST:		170,651	
54,543	64,187	1,022	67,986	53,315	123,551	123,525	47,100	47,126	
CHANGES FROM 09/07/10						CHANGE IN OPEN INTEREST:		-87,137	
1,337	-12,668	-1,531	-80,329	-61,412	-80,473	-74,611	-6,664	-12,526	
PERCENT OF OPEN INTEREST FOR EACH CATEGORY OF TRADERS									
32.0	37.6	0.6	39.8	34.2	72.4	72.4			
NUMBER OF TRADERS IN EACH CATEGORY (TOTAL TRADERS:						153)			
55	42	12	29	39	86	91			



مع العلم أن استخدام هذه الطرق تكون مناسبة لعملات وغير مناسبة لأخري وسيوضح كل شيء عمليا 😊

تلخيص لما سبق

أحد عيوب سوق العملات الفورية هو عدم وجود بيانات واضحة عن حجم التداول وللتعويض عن ذلك ذهب العديد من التجار إلي متابعة التقارير الأسبوعية في سوق العقود الأجلة لمعرفة وجهتهم لعملة ما صعودا أم هبوطا وذلك بناء علي تحليل تجريبي سابق

إلي هنا انتهى الجزء النظري للإستراتيجية

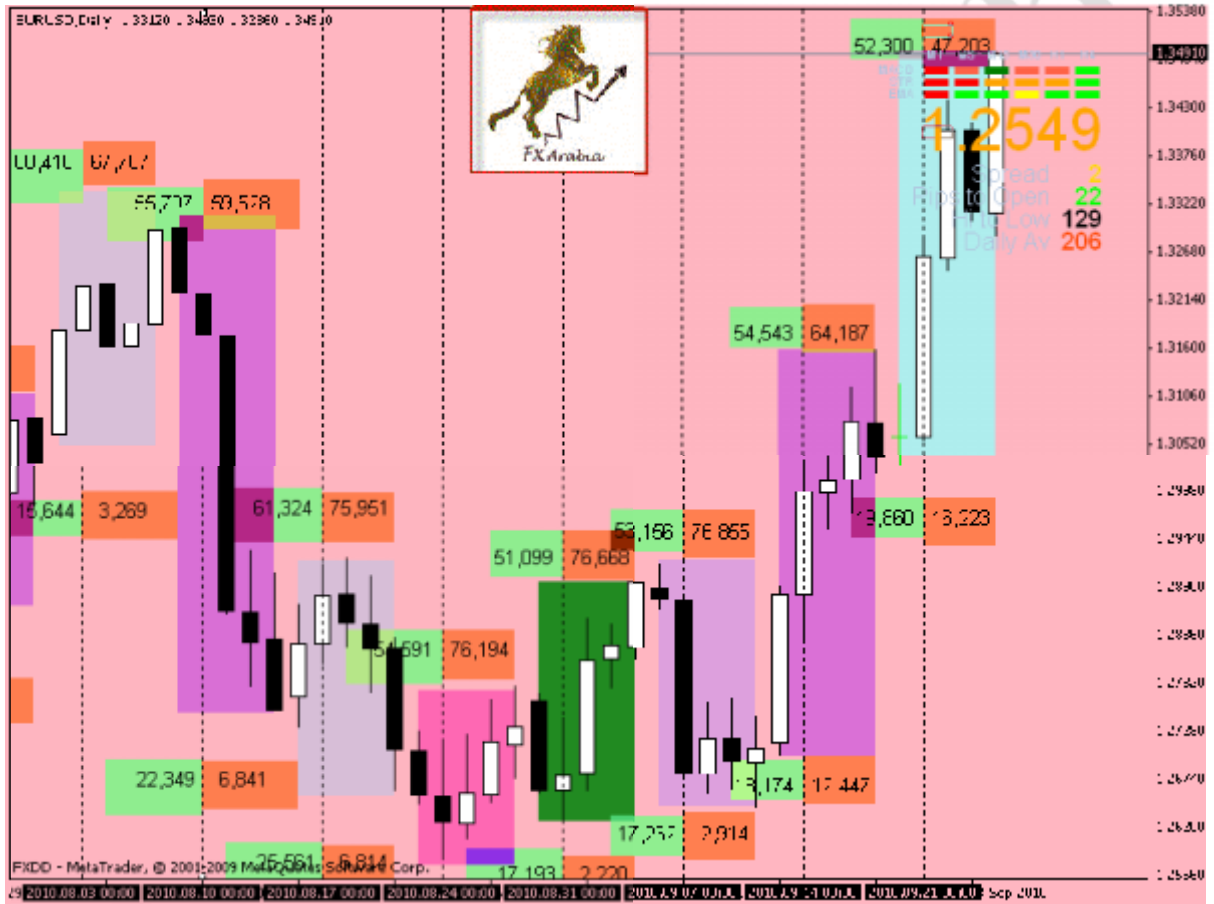
وسنبدأ في العملي علي الشارت 😊

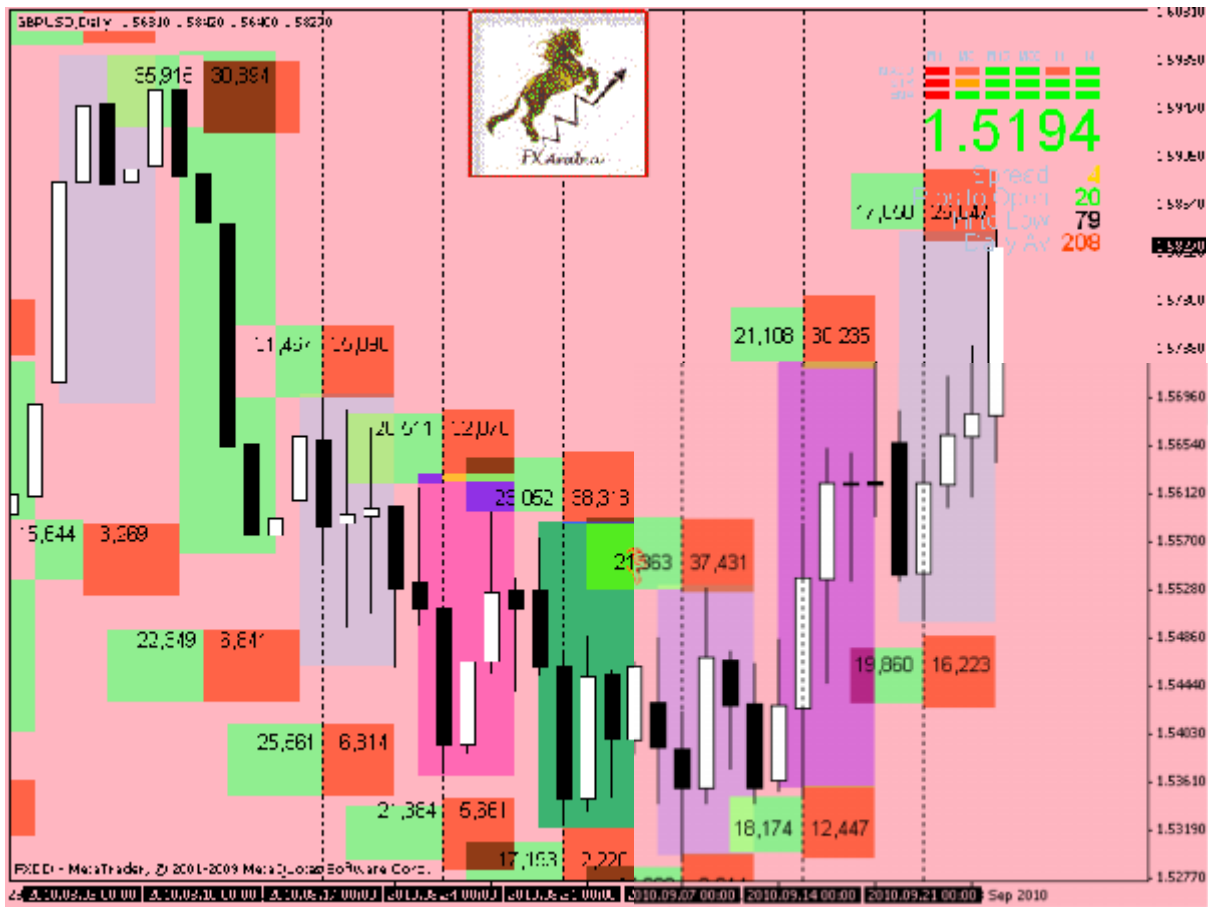
قبل العمل علي الشارت أريد أن أوضح شيء هام

هذه التقارير التي نعمل عليها هي مثل شخص قوي في السوق يملك بيانات ومؤشرات اقتصادية لا نستطيع الحصول عليها بسهولة تؤثر في حركة العملات و نحن نتبع هذا الشخص القوي بعد عمل باك تيست لنتأجه (الجملة السابقة تشبيه لما سنفعل)

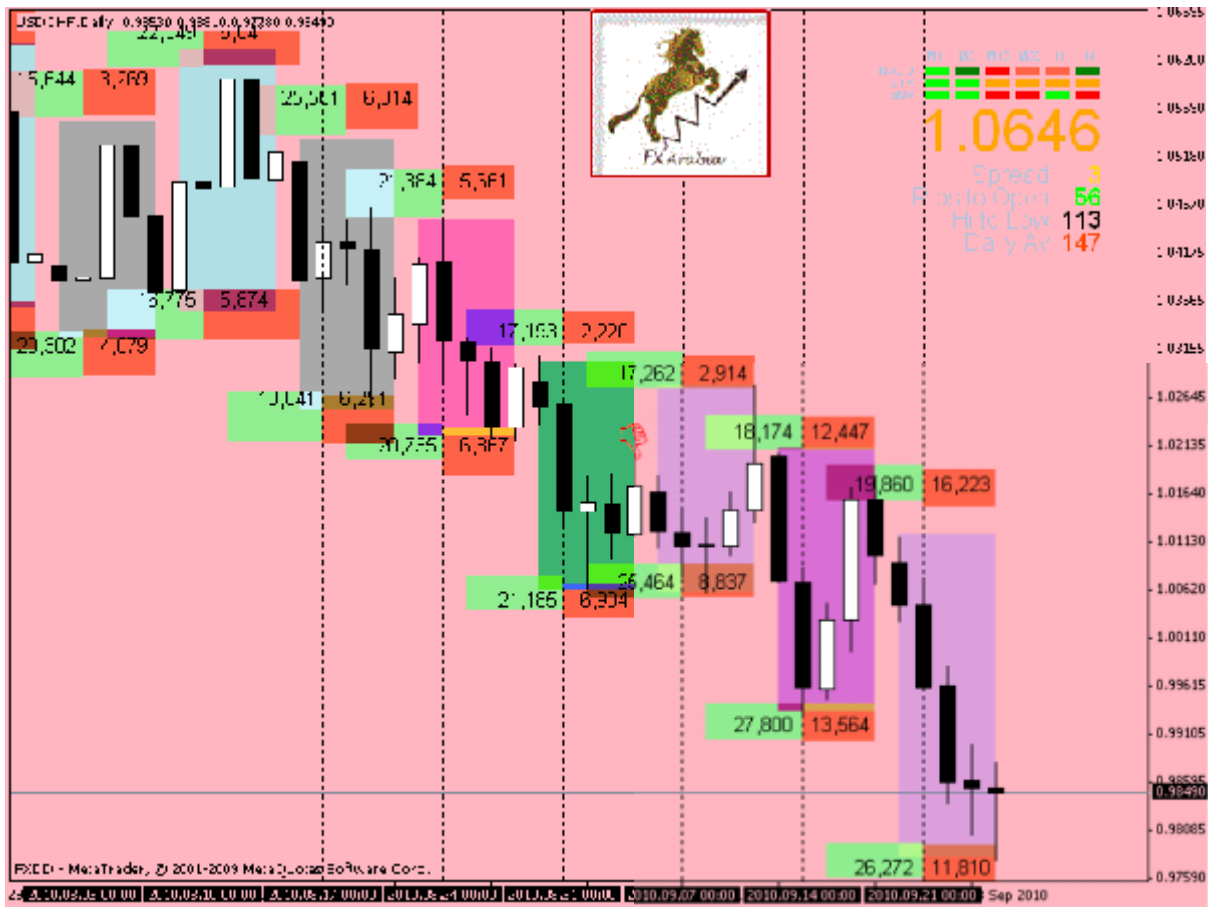
=====

😊 شكل الشارت الذي نعمل عليه

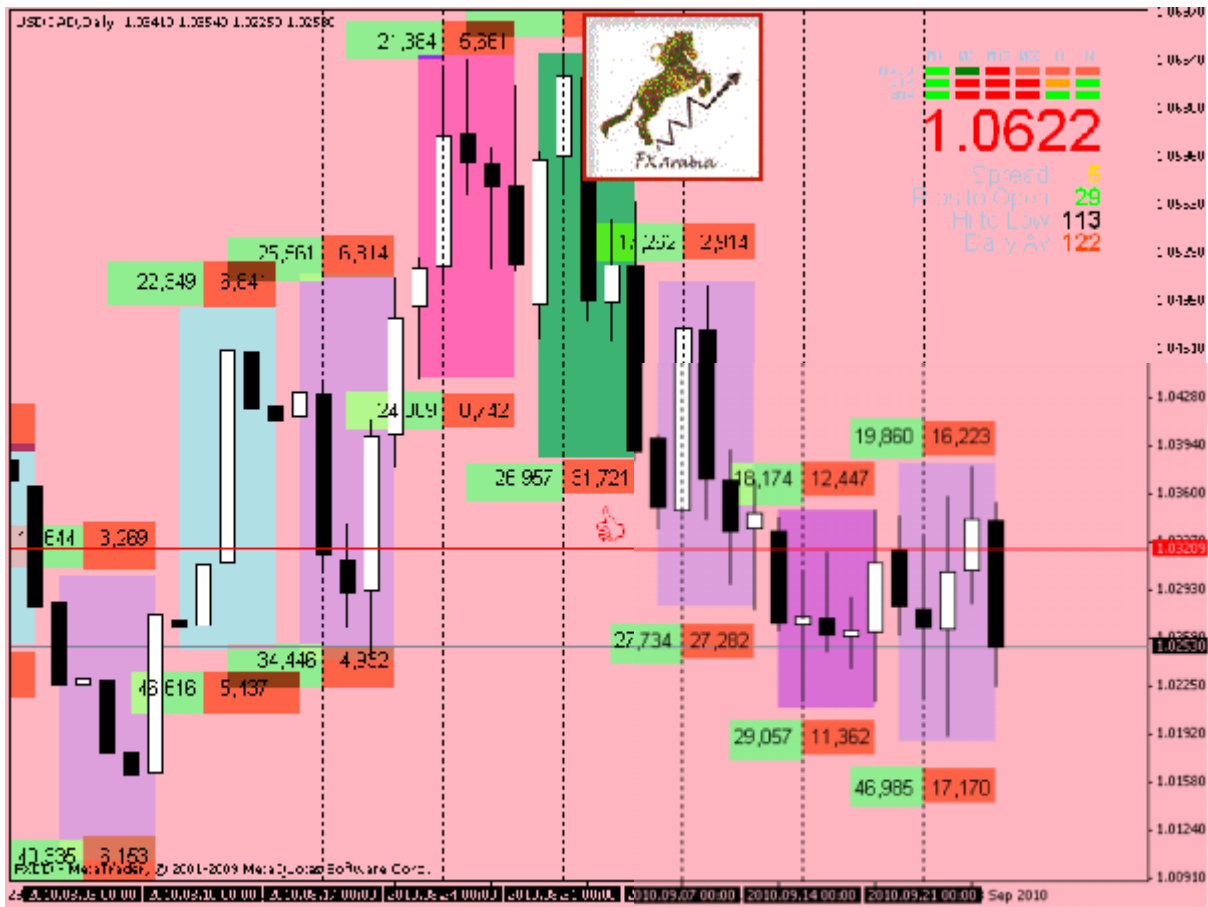




Mostafa

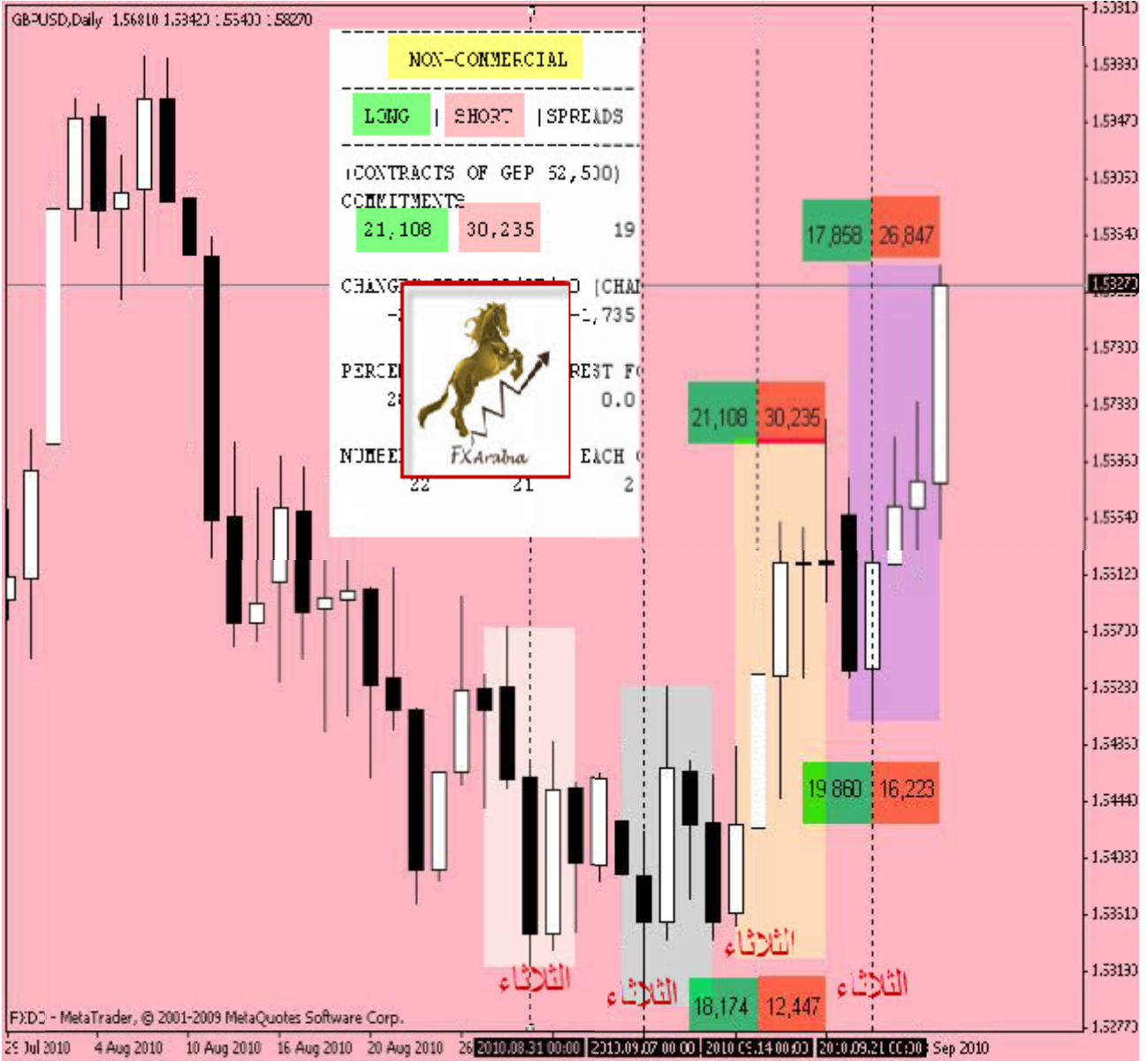


Mostafa



كما ذكرنا سابقا ان التقارير تنشر كل يوم جمعة وتكون حتي يوم الثلاثاء السابق . قمت بوضع خط رأسي علي كل يوم ثلاثاء وقمت بتظليل الأسبوع من الهاي حتي اللو

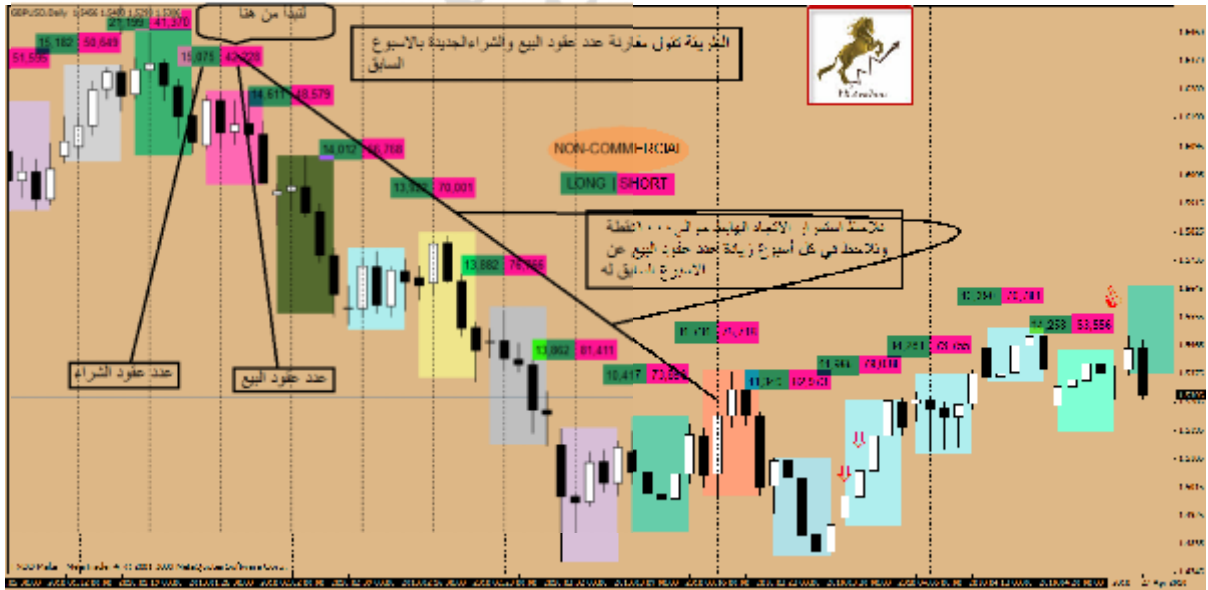
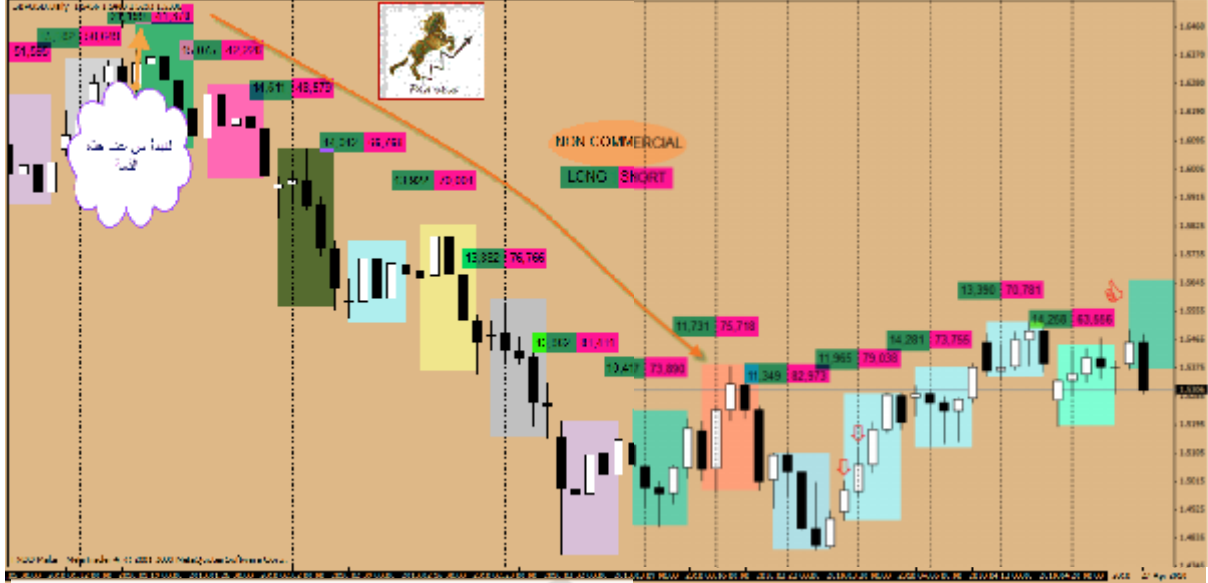
هكذا



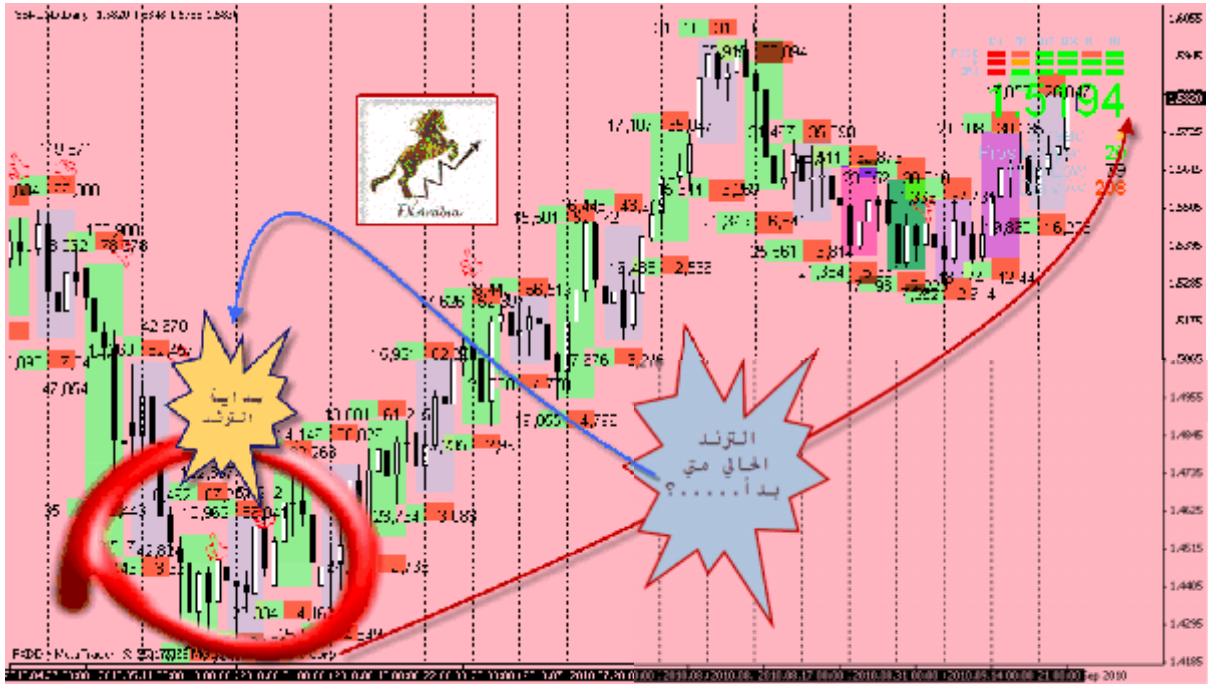
هذا شارت الاسترليني دولار قمت بوضع بيانات الاسترليني فوق الشموع وبيانات الدولار تحت الشموع مع اغلاق كل أسبوع بعد نزول التقارير كما ذكرنا سابقا تنشر كل يوم جمعة الساعة ١٠:٣٠ مساء بتوقيت السعودية

لاحظ مدي توافق البيانات مع اتجاه الترنند

بيانات تقرير الاسترليني نلاحظ زيادة عدد عقود البيع وانخفاض عقود الشراء من عند القمة المحددة

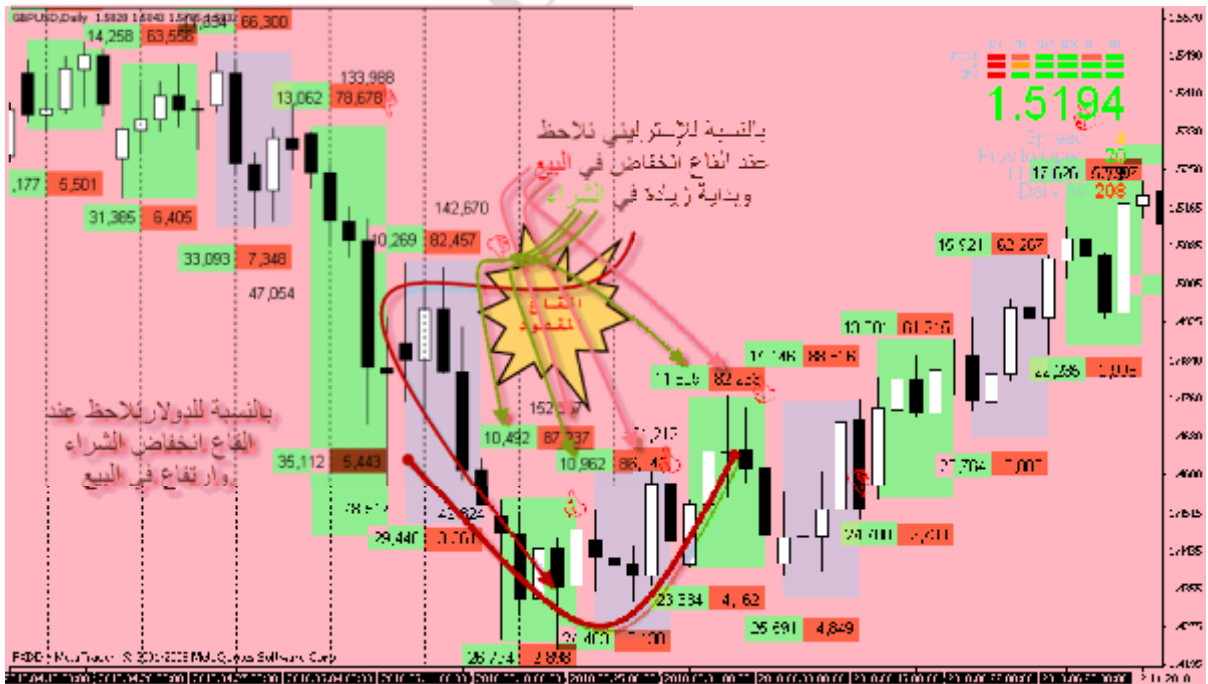


مع العلم أن الترنند استمر حتى ٢٠٠٠ نقطة
المشكلة في بداية ونهاية الترنند



اذن كيف تكون قاع الترنند الحالي

بعد تكبير جزء القاع وتوضيح قراءة البيانات



يجب أن نعلم شيء هائل... هناك عدم مثالية في البيانات وهو شيء طبيعي بمعنى لن تجد انخفاض الشراء

مثلا هكذا

١٠
٩
٨
٧
٦
٥
٤

ولا ارتفاع البيع هكذا

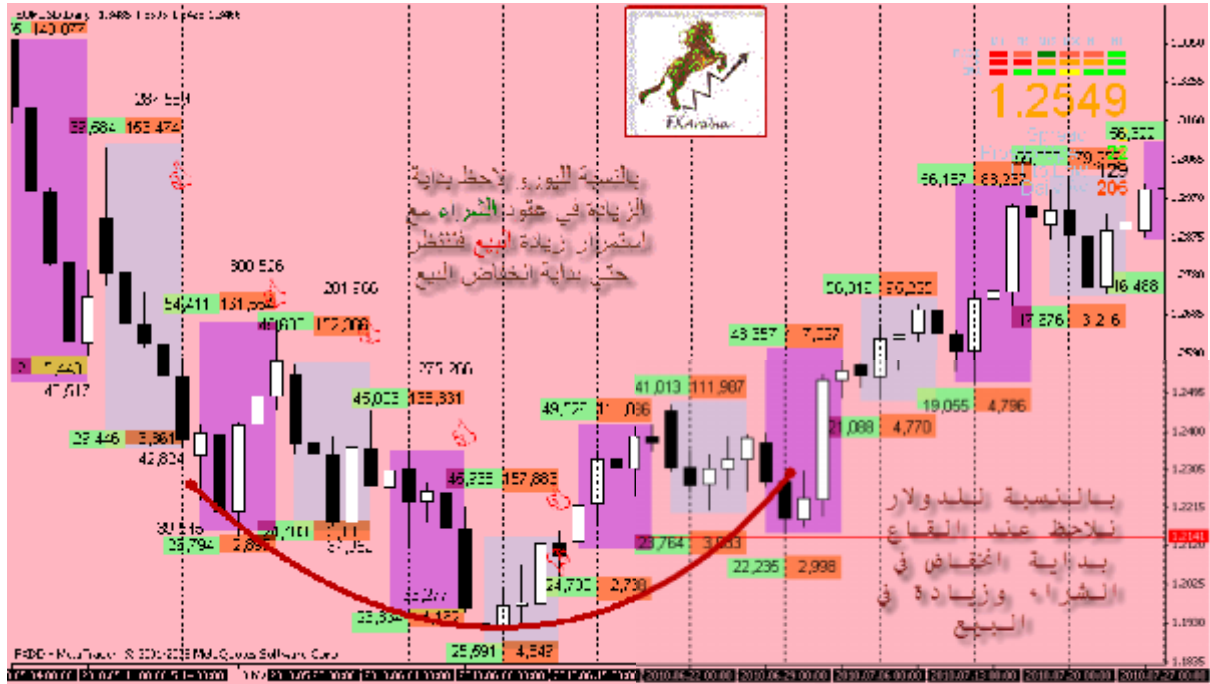
٤
٥
٦
٧
٨
٩
١٠

أرجو أن تكون اتضحت الصورة الآن وسأرفق مزيد من الأمثلة

ترند آخر علي زوج اليورو دولار حتي الآن ١٥٠٠ نقطة وحتى الآن نتوقع استمرار الترنند لحين تكون الفمة كما يجب أن تتكون



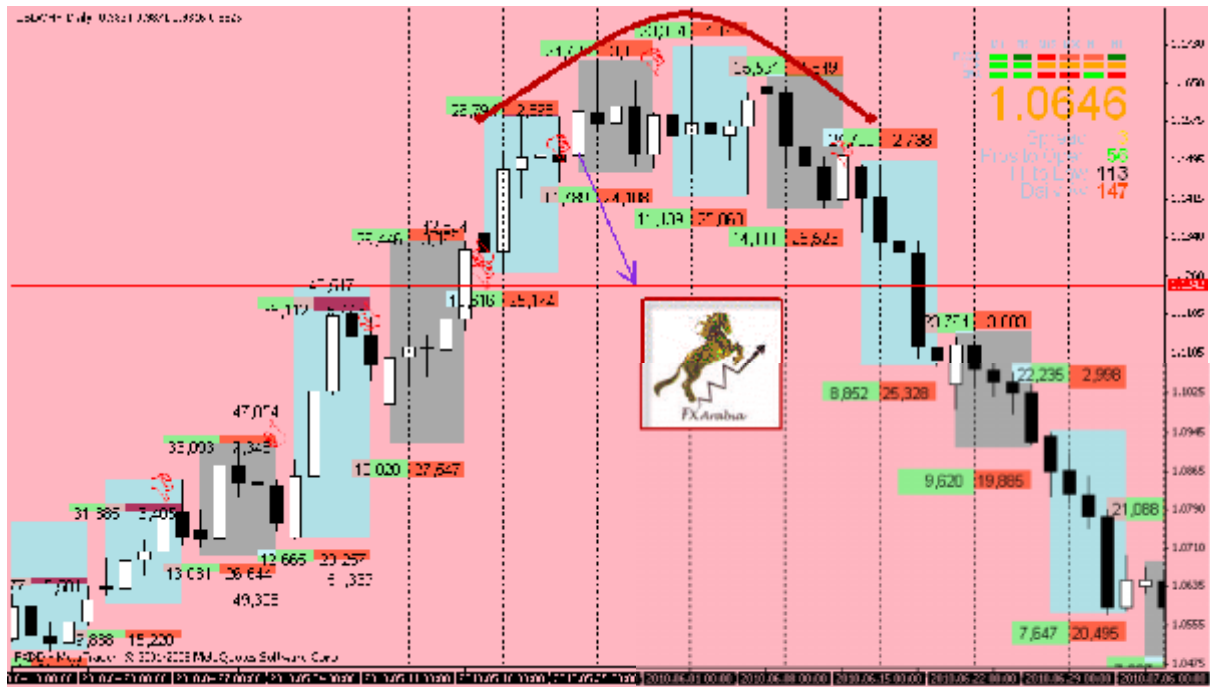
بالنسبة لقاع الترنند بعد التكبير للتوضيح



ترند آخر علي زوج الدولار فرنك حتى الآن أكثر من ١٦٠٠ نقطة



لتوضيح قمة التوند ولاحظ انخفاض الشراء علي الدولار وزيادة البيع وكذلك زيادة الشراء علي الفرنك وانخفاض البيع



mostafa amasha

بيان لجنة الاحتياطي الفيدرالي السابق كان يوم ٢١ سبتمبر الماضي

٧٥



08:15 م سا لجنة الاحتياطي الفيدرالي

خلاصة نتائج البيان كان

الاحتياطي الفدرالي يؤكد انه مستعد لتقديم دعم إضافي لتعزيز الانتعاش الاقتصادي .

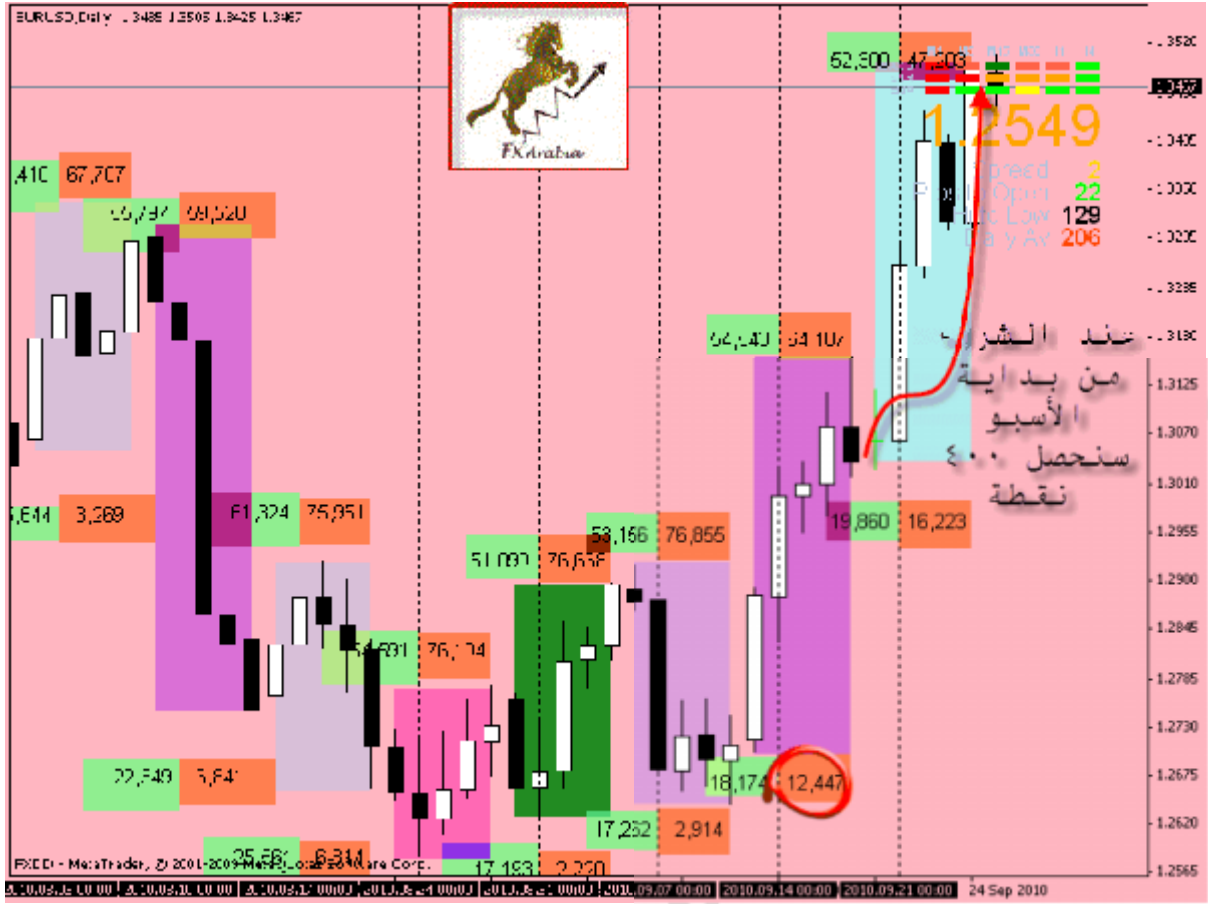
وهذا سلبي للدولار

قراءة لبيان الفدرالي

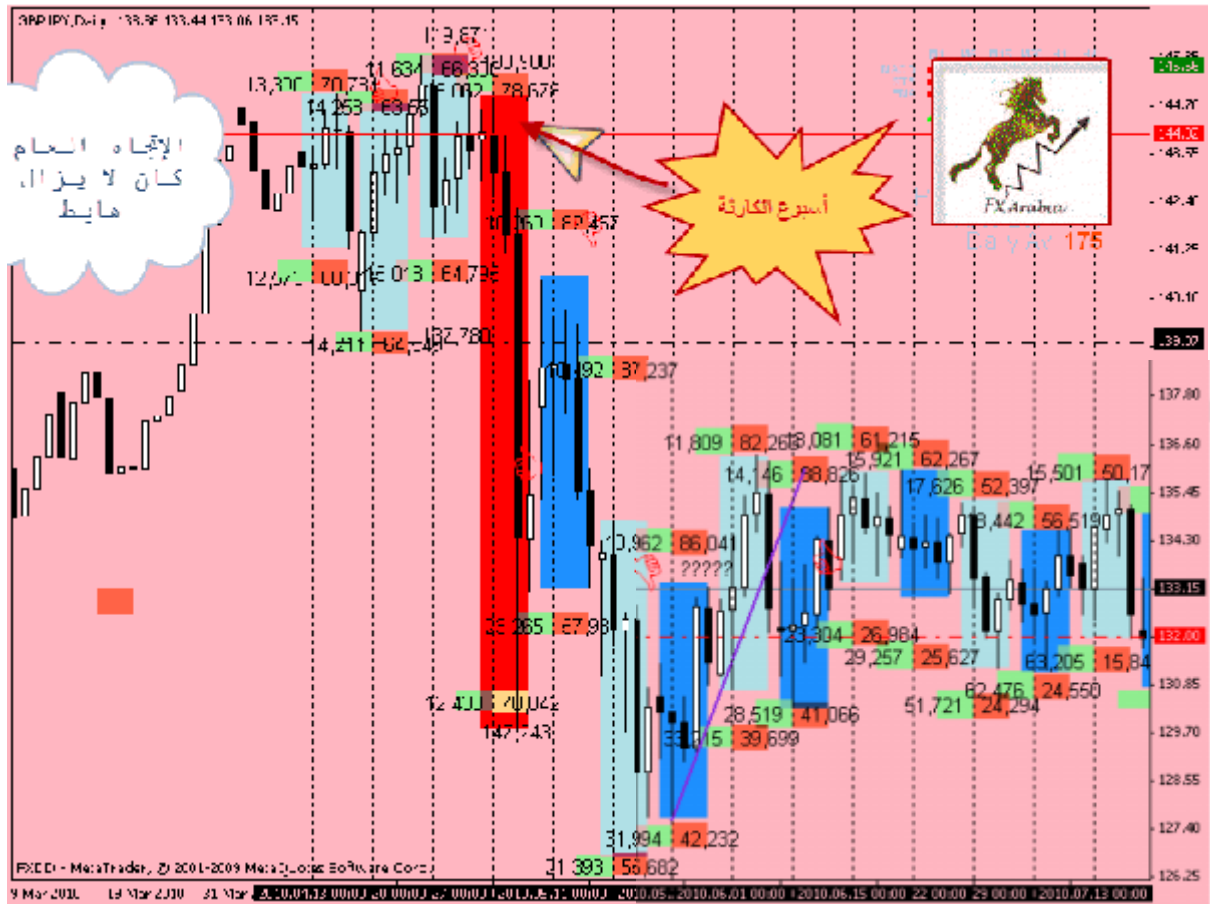
More Willingness to Do Dollar Sinks of Fed's

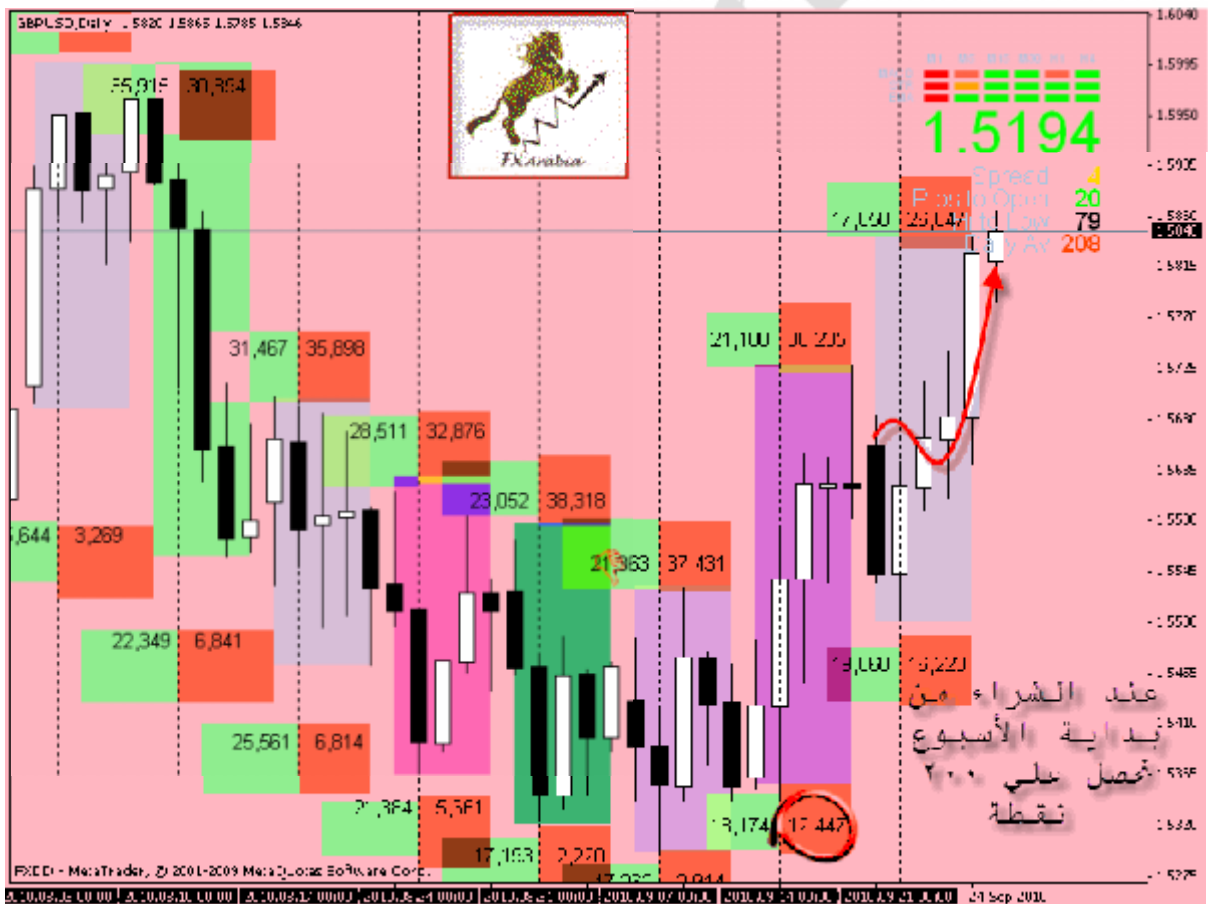
سوف أوضح الإشارة السلبية التي أعطتها الاستراتيجية بضعف الدولار حيث كانت بيانات الاسبوع السابق للبيان تشير الي ارتفاع بمقدار ٩,٥٣٣ في عقود البيع وهذه زيادة غير طبيعية تشير الي استمرار ضعف الدولار حيث كانت عدد عقود البيع للاسبوع السابق ١٢,٤٧٧ والاسبوع السابق له ٢,٩١٤

نتابع ماذا حدث علي الشارت



بالنسبة للكوارث التي حدثت في سوق الفوركس والتي عاصرتها مثلا يوم ٦ - ٥ - ٢٠١٠ يوم تحرك المجنون أكثر من ألف نقطة هبوط وكذلك بالقي الأزواج أكثر من ٥٠٠ نقطة وكذلك يوم تدخل البنك المركزي الياباني يوم ١٥ - ٩ - ٢٠١٠ وبيع الين بكميات ضخمة الاستراتيجية كانت معطية اشارة في نفس اتجاه الكارثة .





تقارير الكوت بتاريخ ٢٠١٠/٩/٢١

RUSSIAN RUBLE - CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
FUTURES ONLY POSITIONS AS OF 09/21/10

NON-COMMERCIAL				COMMERCIAL				TOTAL		NONREPORTABLE POSITIONS	
LONG	SHORT	SPREADS	NET	LONG	SHORT	SPREADS	NET	LONG	SHORT	LONG	SHORT
17,197	270	0	16,927	10,111	10,111	0	0	27,108	10,321	17,197	270
CHANGES FROM 09/14/10 (CHANGE IN OPEN INTEREST)											
1,000	0	0	1,000	0	0	0	0	1,000	0	1,000	0
PERCENT OF OPEN INTEREST FOR EACH CATEGORY OF TRADER											
40.1	30.9	0.1	37.2	23.2	23.2	0.0	0.0	43.6	36.1	36.4	13.9
NUMBER OF TRADERS IN EACH CATEGORY (TOTAL TRADERS)											
10	1	0	11	4	4	0	0	15	5	16	5

CANADIAN DOLLAR - CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
FUTURES ONLY POSITIONS AS OF 09/21/10

NON-COMMERCIAL				COMMERCIAL				TOTAL		NONREPORTABLE POSITIONS	
LONG	SHORT	SPREADS	NET	LONG	SHORT	SPREADS	NET	LONG	SHORT	LONG	SHORT
17,197	270	0	16,927	10,111	10,111	0	0	27,108	10,321	17,197	270
CHANGES FROM 09/14/10 (CHANGE IN OPEN INTEREST)											
1,000	0	0	1,000	0	0	0	0	1,000	0	1,000	0
PERCENT OF OPEN INTEREST FOR EACH CATEGORY OF TRADER											
40.1	30.9	0.1	37.2	23.2	23.2	0.0	0.0	43.6	36.1	36.4	13.9
NUMBER OF TRADERS IN EACH CATEGORY (TOTAL TRADERS)											
10	1	0	11	4	4	0	0	15	5	16	5

UK POUND STERLING - CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
FUTURES ONLY POSITIONS AS OF 09/21/10

NON-COMMERCIAL				COMMERCIAL				TOTAL		NONREPORTABLE POSITIONS	
LONG	SHORT	SPREADS	NET	LONG	SHORT	SPREADS	NET	LONG	SHORT	LONG	SHORT
17,197	270	0	16,927	10,111	10,111	0	0	27,108	10,321	17,197	270
CHANGES FROM 09/14/10 (CHANGE IN OPEN INTEREST)											
1,000	0	0	1,000	0	0	0	0	1,000	0	1,000	0
PERCENT OF OPEN INTEREST FOR EACH CATEGORY OF TRADER											
40.1	30.9	0.1	37.2	23.2	23.2	0.0	0.0	43.6	36.1	36.4	13.9
NUMBER OF TRADERS IN EACH CATEGORY (TOTAL TRADERS)											
10	1	0	11	4	4	0	0	15	5	16	5

BRITISH POUND STERLING - CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
FUTURES ONLY POSITIONS AS OF 09/21/10

NON-COMMERCIAL				COMMERCIAL				TOTAL		NONREPORTABLE POSITIONS	
LONG	SHORT	SPREADS	NET	LONG	SHORT	SPREADS	NET	LONG	SHORT	LONG	SHORT
17,197	270	0	16,927	10,111	10,111	0	0	27,108	10,321	17,197	270
CHANGES FROM 09/14/10 (CHANGE IN OPEN INTEREST)											
1,000	0	0	1,000	0	0	0	0	1,000	0	1,000	0
PERCENT OF OPEN INTEREST FOR EACH CATEGORY OF TRADER											
40.1	30.9	0.1	37.2	23.2	23.2	0.0	0.0	43.6	36.1	36.4	13.9
NUMBER OF TRADERS IN EACH CATEGORY (TOTAL TRADERS)											
10	1	0	11	4	4	0	0	15	5	16	5

JAPANESE YEN - CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
FUTURES ONLY POSITIONS AS OF 09/21/10

NON-COMMERCIAL				COMMERCIAL				TOTAL		NONREPORTABLE POSITIONS	
LONG	SHORT	SPREADS	NET	LONG	SHORT	SPREADS	NET	LONG	SHORT	LONG	SHORT
17,197	270	0	16,927	10,111	10,111	0	0	27,108	10,321	17,197	270
CHANGES FROM 09/14/10 (CHANGE IN OPEN INTEREST)											
1,000	0	0	1,000	0	0	0	0	1,000	0	1,000	0
PERCENT OF OPEN INTEREST FOR EACH CATEGORY OF TRADER											
40.1	30.9	0.1	37.2	23.2	23.2	0.0	0.0	43.6	36.1	36.4	13.9
NUMBER OF TRADERS IN EACH CATEGORY (TOTAL TRADERS)											
10	1	0	11	4	4	0	0	15	5	16	5

EURO FX - CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
FUTURES ONLY POSITIONS AS OF 09/21/10

NON-COMMERCIAL				COMMERCIAL				TOTAL		NONREPORTABLE POSITIONS	
LONG	SHORT	SPREADS	NET	LONG	SHORT	SPREADS	NET	LONG	SHORT	LONG	SHORT
17,197	270	0	16,927	10,111	10,111	0	0	27,108	10,321	17,197	270
CHANGES FROM 09/14/10 (CHANGE IN OPEN INTEREST)											
1,000	0	0	1,000	0	0	0	0	1,000	0	1,000	0
PERCENT OF OPEN INTEREST FOR EACH CATEGORY OF TRADER											
40.1	30.9	0.1	37.2	23.2	23.2	0.0	0.0	43.6	36.1	36.4	13.9
NUMBER OF TRADERS IN EACH CATEGORY (TOTAL TRADERS)											
10	1	0	11	4	4	0	0	15	5	16	5

NEW ZEALAND DOLLAR - CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE
FUTURES ONLY POSITIONS AS OF 09/21/10

NON-COMMERCIAL				COMMERCIAL				TOTAL		NONREPORTABLE POSITIONS	
LONG	SHORT	SPREADS	NET	LONG	SHORT	SPREADS	NET	LONG	SHORT	LONG	SHORT
17,197	270	0	16,927	10,111	10,111	0	0	27,108	10,321	17,197	270
CHANGES FROM 09/14/10 (CHANGE IN OPEN INTEREST)											
1,000	0	0	1,000	0	0	0	0	1,000	0	1,000	0
PERCENT OF OPEN INTEREST FOR EACH CATEGORY OF TRADER											
40.1	30.9	0.1	37.2	23.2	23.2	0.0	0.0	43.6	36.1	36.4	13.9
NUMBER OF TRADERS IN EACH CATEGORY (TOTAL TRADERS)											
10	1	0	11	4	4	0	0	15	5	16	5

U.S. DOLLAR INDEX - ICE FUTURES U.S.
FUTURES ONLY POSITIONS AS OF 09/21/10

Code-098862

-----							NONREPORTABLE		
NON-COMMERCIAL			COMMERCIAL		TOTAL		POSITIONS		
-----							-----		
LONG	SHORT	SPREADS	LCNG	SHORT	LONG	SHORT	LCNG	SHORT	
-----							-----		
(U.S. DOLLAR INDEX X \$1000)			الدولار الأمريكي		OPEN INTEREST:		28,701		
COMMITMENTS									
19,860	15,223	712	4,498	8,638	25,070	25,573	3,531	3,128	
CHANGES FROM 09/14/10 (CHANGE IN OPEN INTEREST:						3,816)			
1,686	3,775	-6	2,537	-212	4,217	3,558	-401	258	
PERCENT OF OPEN INTEREST FOR EACH CATEGORY OF TRADERS									
59.2	56.5	2.5	15.7	30.1	87.3	89.1	12.7	10.9	
NUMBER OF TRADERS IN EACH CATEGORY (TOTAL TRADERS:						65)			
20	29	6	8	9	29	44			

mostafa amasha