



نشریه هفتگی

گزارش تعهد معامله گران

به زبان فارسی به همراه تفسیر

COT - Commitments of Traders

❖ تاریخ انتشار: یکشنبه ۱۳ اسفند ۱۴۰۲

❖ سال اول / شماره ۱۹

❖ صاحب امتیاز: انتشارات ایسن

❖ قیمت: ۳۰,۰۰۰ تومان / ۱\$

فهرست

- ۲ [دلار کانادا – CAD](#)
- ۴ [فرانک سوئیس – CHF](#)
- ۶ [پوند انگلیس – GBP](#)
- ۸ [ین ژاپن – JPY](#)
- ۱۰ [یورو – EUR](#)
- ۱۲ [دلار استرالیا – AUD](#)
- ۱۴ [دلار نیوزلند – NZD](#)
- ۱۶ [شاخص داو جونز – DJIX](#)
- ۱۸ [شاخص نزدک – NASDAQ-100](#)
- ۲۰ [اوراق قرضه ۱۰ ساله امریکا – UST 10Y NOTE](#)
- ۲۲ [شاخص دلار امریکا – USD INDEX](#)
- ۲۴ [بیتکوین – BITCOIN](#)
- ۲۶ [نفت وست تگزاس – WTI](#)
- ۲۸ [طلا – GOLD](#)
- ۳۰ [نقره – SILVER](#)
- ۳۲ [راهنما](#)
- ۳۳ [درباره ما](#)



گزارش تعهد معامله گران (COT)

تاریخ ایجاد: 27 فوریه 24 - 8 اسفند 02

تاریخ انتشار: 1 مارس 24 - 11 اسفند 02

دلار کانادا (CAD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفا مربوط به معاملات آتی است

کد - 090741

[بازگشت به فهرست](#)

ارزش قراردادهای باز: 12,314,725,093 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 166,484				اندازه قراردادهای 100,000 دلار کانادا				
27,780	29,731	138,704	136,753	91,119	90,546	5,049	42,536	41,158
تغییرات در قراردادهای باز: +8,818				تغییرات				
-1,894	+539	+10,712	+8,279	+4,259	+2,341	+1,888	+4,565	+4,050
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
16.7%	17.9%	83.3%	82.1%	54.7%	54.4%	3.0%	25.5%	24.7%
تعداد کل معامله گران: 102				تعداد معامله گران در هر دسته				
		72	52	38	28	9	30	19

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 1,378 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 515 قرارداد افزایش فروش بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.48 و نسبت به کل 0.32 است.
- قراردادهای باز با 8,818 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 2,433 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای دلار کانادا رقم خورده است.

- چکیده این هفته: غالب تغییرات این هفته مبنی بر افزایش در قراردادهای خرید و فروش از سمت تمام گروه ها بود، برابند این تغییرات هم در افزایش قراردادهای فروش دلار کانادا بود، سهم غیرتجاری ها هم در این هفته رشد داشت که نشان از سرمایه گذاری بیشتر این گروه نسبت به سایر گروه ها در این هفته بود.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: دلار کانادا - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: USDCAD - فارکس
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتی
خطوط عمودی: زمان انتشار گزارش
لیبل قیمت: آخرین قیمت در زمان انتشار گزارش
تایم فریم 4 ساعته

فرانک سوئیس (CHF) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 092741

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 9,282,293,790 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 65,207				اندازه قراردادهای 125,000 فرانک سوئیس					
19,979	8,251	45,228	56,956	17,007	40,716	383	27,838	15,857	
تغییرات در قراردادهای باز: +5,177				تغییرات					
+1,013	-1,162	+4,164	+6,339	-972	+3,261	+257	+4,879	+2,821	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
30.6%	12.7%	69.4%	87.3%	26.1%	62.4%	0.6%	42.7%	24.3%	
تعداد کل معامله گران: 55				تعداد معامله گران در هر دسته					
		32	29	14	14	3	16	14	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 8٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 11,981 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 2,058 قرارداد افزایش فروش بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.76 و نسبت به کل 0.43 است .
- قراردادهای باز با 5,177 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 2,175 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای فرانک سوئیس رقم خورده است.
- چکیده این هفته: تمام گروه ها در این هفته همچون هفته قبل وارد معاملات خرید و فروش فرانک شده اند که غیرتجاری ها قراردادهای فروش را افزایش دادند و سهم این گروه از بازار همچون هفته های قبل افزایشی بوده و سایر گروه ها هم وارد معاملات جدید شدند که سهم معاملات خرید بیشتر از فروش بود.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: فرانک سوئیس - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: USDCHF - فارکس
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتی
خطوط عمودی: زمان انتشار گزارش
لیبل قیمت: آخرین قیمت در زمان انتشار گزارش
تایم فریم 4 ساعته

پوند انگلیس (GBP) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 096742

[بازگشت به فهرست](#)

ارزش قراردادهای باز: 16,704,165,975 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 210,828				اندازه قراردادهای پوند انگلیس 62,500					
25,816	31,048	185,012	179,780	127,352	75,762	12,048	45,612	91,970	
تغییرات در قراردادهای باز: +11,553				تغییرات					
-1,504	+1,034	+13,057	+10,519	+5,445	+2,861	+3,290	+4,322	+4,368	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
12.2%	14.7%	87.8%	85.3%	60.4%	35.9%	5.7%	21.6%	43.6%	
تعداد کل معامله گران: 109				تعداد معامله گران در هر دسته					
		78	55	49	28	12	24	19	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 6٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 46,358 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 46 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.73 و نسبت به کل 0.41 است.
- قراردادهای باز با 11,553 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش ناچیزی داشته است.
- در بخش تغییرات کل نیز در این هفته 2,538 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای پوند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: تغییری در تمایل غیرتجاری ها در این هفته مشاهده نمی شود زیرا تقریباً به یک اندازه به تعداد قراردادهای خرید و فروش خود افزودند و همینطور این افزایش چون بیشتر از افزایش قرارداد نسبت به سایر گروه ها بوده، منجر به افزایش سهم غیرتجاری ها از بازار هم شده است.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: پوند انگلیس - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: GBPUSD - فارکس
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتی
خطوط عمودی: زمان انتشار گزارش
لیبل قیمت: آخرین قیمت در زمان انتشار گزارش
تایم فریم 4 ساعته

ین ژاپن (JPY) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 097741

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 25,719,589,992 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 309,633				اندازه قراردادهای ین ژاپن 12,500,000				
42,573	43,296	267,060	266,337	72,443	204,425	10,651	183,966	51,261
تغییرات در قراردادهای باز: +4,195				تغییرات				
-4,121	+1,678	+8,316	+2,517	-764	+5,364	-246	+9,326	-2,601
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
13.7%	14.0%	86.3%	86.0%	23.4%	66.0%	3.4%	59.4%	16.6%
تعداد کل معامله گران: 166				تعداد معامله گران در هر دسته				
		113	82	46	50	12	61	26

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 1٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 132,705 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 11,927 قرارداد افزایش فروش بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.89 و نسبت به کل 0.46 است.
- قراردادهای باز با 4,195 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 5,799 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای ین رقم خورد.
- چکیده این هفته: سهم غیرتجاری ها از بازار افزایش چشمگیری نداشته ولی قراردادهای فروش خود را باز هم افزایش دادند، این افزایش قراردادهای فروش در دو ماه اخیر ادامه دار بوده است. برابری این هفته کل بازار هم نشان از افزایش در قراردادهای فروش ین می دهد.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: بین ژاپن - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: USDJPY - فارکس
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتی
خطوط عمودی: زمان انتشار گزارش
لیبل قیمت: آخرین قیمت در زمان انتشار گزارش
تایم فریم 4 ساعته

یورو (EUR) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفا مربوط به معاملات آتی است

کد - 099741

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 96,987,652,594 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 715,545				اندازه قراردادهای 125,000 یورو				
53,287	80,334	662,258	635,211	501,018	411,117	18,860	142,380	205,234
تغییرات در قراردادهای باز: -6,754				تغییرات				
-3,235	+2,377	-3,519	-9,131	-4,616	-5,066	+3,895	-2,798	-7,960
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
7.4%	11.2%	92.6%	88.8%	70.0%	57.5%	2.6%	19.9%	28.7%
تعداد کل معامله گران: 308				تعداد معامله گران در هر دسته				
		169	227	91	121	37	57	90

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته تقریبا بدون تغییر باقی مانده است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 62,854 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 5,162 قرارداد کاهش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.40 و نسبت به کل 0.28 است.
- قراردادهای باز با 6,754 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 5,612 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای یورو رقم خورده است.
- چکیده این هفته: این هفته همچون هفته قبل، هفته تسویه معاملات در تمام گروه ها بود. غیرتجاری ها بیشتر مشغول تسویه قراردادهای خرید خود بودند ولی در سایر گروه ها هم معاملات خرید و هم فروش تسویه شدند اما بالانس بازار تغییری نکرد و سهم گروه ها از بازار ثابت باقی ماند.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: یورو - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: EURUSD - فارکس
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتی
خطوط عمودی: زمان انتشار گزارش
لیبل قیمت: آخرین قیمت در زمان انتشار گزارش
تایم فریم 4 ساعته

دلار استرالیا (AUD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 232741

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 13,408,526,720 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 204,992				اندازه قراردادهای 100,000 دلار استرالیا				
29,991	19,390	175,001	185,602	39,515	129,292	6,670	128,816	49,640
تغییرات در قراردادهای باز: -664				تغییرات				
-120	+15	-544	-679	+432	-2,402	+1,183	-2,159	+540
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
14.6%	9.5%	85.4%	90.5%	19.3%	63.1%	3.3%	62.8%	24.2%
تعداد کل معامله گران: 106				تعداد معامله گران در هر دسته				
		68	67	30	35	13	30	27

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته تقریباً بدون تغییر باقی مانده است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 79,176 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 2,699 قرارداد کاهش فروش بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 1.09 و نسبت به کل 0.51 است.
- قراردادهای باز با 664 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 135 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای دلار استرالیا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در این هفته بخشی از معاملات فروش خود را تسویه کردند اما چون تسویه معاملات گروه تجاری بیشتر از غیرتجاری بود سهم آنها از بازار کمی رشد داشت. در کل دلار استرالیا در این هفته شاهد تغییرات خاصی نبود.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: دلار استرالیا - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: AUDUSD - فارکس
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتی
خطوط عمودی: زمان انتشار گزارش
لیبل قیمت: آخرین قیمت در زمان انتشار گزارش
تایم فریم 4 ساعته

دلار نیوزلند (NZD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 112741

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 2,987,743,950 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 48,463				اندازه قراردادهای 100,000 دلار نیوزلند				
2,652	5,020	45,811	43,443	29,899	17,474	2,027	13,885	23,942
تغییرات در قراردادهای باز: +7,513				تغییرات				
-755	+440	+8,268	+7,073	+7,759	+3,133	-244	+753	+4,184
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
5.5%	10.4%	94.5%	89.6%	61.7%	36.1%	4.2%	28.7%	49.4%
تعداد کل معامله گران: 89				تعداد معامله گران در هر دسته				
		49	49	23	20	5	24	26

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 15٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 10,057 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 3,431 قرارداد افزایش خرید بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.84 و نسبت به کل 0.44 است.
- قراردادهای باز با 7,513 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,195 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای دلار نیوزلند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در این هفته همانند روال ماه گذشته تعداد قراردادهای خرید خود را افزایش دادند، اما به علت اینکه تجاری ها وارد حجم زیادی از معاملات خرید و فروش که برابری آنها معاملات فروش بیشتر بود شدند، باعث کاهش سهم بازار غیرتجاری ها شدند.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: دلار نیوزلند - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: NZDUSD - فارکس
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتی
خطوط عمودی: زمان انتشار گزارش
لیبل قیمت: آخرین قیمت در زمان انتشار گزارش
تایم فریم 4 ساعته

شاخص داوجونز (DJIA) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 12460+

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 20,765,079,306 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری				
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید		
قراردادهای باز: 106,563				اندازه قراردادهای \$5 * شاخص داوجونز						
13,291	16,561	93,272	90,002	76,091	53,500	2,949	14,233	33,554		
تغییرات در قراردادهای باز: +1,820				تغییرات						
-599	+1,218	+2,419	+602	+3,008	-190	+250	-839	+542		
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران										
12.5%	15.5%	87.5%	84.5%	71.4%	50.2%	2.8%	13.4%	31.5%		
تعداد کل معامله گران: 124				تعداد معامله گران در هر دسته						
		66	88	31	38	13	27	45		

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 2.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 19,321 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 1,380 قرارداد کاهش فروش بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.39 و نسبت به کل 0.27 است.
- قراردادهای باز با 1,821 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,817 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای شاخص داوجونز رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در این هفته برخلاف هفته گذشته بخشی از قراردادهای فروش خود را تسویه و به قراردادهای خرید خود افزودند و با توجه به اینکه در سایر گروه ها افزایش ورود به معاملات فروش را داشتیم سهم غیرتجاری ها از بازار کمی کاهش پیدا کرد.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: شاخص داوجونز - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: DJI - سهام
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتی
خطوط عمودی: زمان انتشار گزارش
لیبل قیمت: آخرین قیمت در زمان انتشار گزارش
تایم فریم 4 ساعته

شاخص نزدک (NASDAQ-100) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 20974+

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 98,633,771,712 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 307,552				اندازه قراردادهای \$20 * شاخص نزدک				
36,752	42,596	270,800	264,957	171,709	153,785	31,265	67,827	79,907
تغییرات در قراردادهای باز: +2,580				تغییرات				
-3,052	-3,577	+5,632	+6,157	-9,812	+4,862	+4,368	+11,076	-3,072
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
11.9%	13.8%	88.1%	86.2%	55.8%	50.0%	10.2%	22.1%	26.0%
تعداد کل معامله گران: 314				تعداد معامله گران در هر دسته				
		178	220	100	122	41	59	73

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 12,080 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 14,149 قرارداد افزایش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.55 و نسبت به کل 0.33 است.
- قراردادهای باز با 2,580 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 526 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای شاخص نزدک رقم خورده است.
- چکیده این هفته: طبق روند دو ماه اخیر غیرتجاری ها در حال کاهش قراردادهای خرید خود و افزایش قراردادهای فروش خود هستند و این هفته هم با برابری 12 هزار قرارداد فروش بیشتر و افزایش در سهم بازار به قدرت این روند افزودند، اما برابری تغییرات کل تا حدودی به سمت افزایش در معاملات خرید بود.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: شاخص نزدک - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: NDX - سهام
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتی
خطوط عمودی: زمان انتشار گزارش
لیبل قیمت: آخرین قیمت در زمان انتشار گزارش
تایم فریم 4 ساعته

اوراق قرضه 10 ساله امریکا (UST 10Y NOTE) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 043602

[بازگشت به فهرست](#)

ارزش قراردادهای باز: 453,217,900,000 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 4,532,179				اندازه قراردادهای 100,000 دلار امریکا ارزش اسمی					
380,697	429,894	4,151,482	4,102,285	2,876,485	3,492,870	134,886	1,140,111	474,529	
تغییرات در قراردادهای باز: -287,314				تغییرات					
+22,424	+1,008	-309,738	-288,322	-189,832	-231,900	-53,939	-65,967	-2,483	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
8.4%	9.5%	91.6%	90.5%	63.5%	77.1%	3.0%	25.2%	10.5%	
تعداد کل معامله گران: 392				تعداد معامله گران در هر دسته					
		283	279	184	201	43	81	53	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 6٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 665,582 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 63,484 قرارداد کاهش فروش بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.27 و نسبت به کل 0.21 است.
- قراردادهای باز با 287,314 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 21,416 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای این نماد رقم خورده است.
- چکیده این هفته: این هفته، در نماد اوراق قرضه 10 ساله هفته تسویه معاملات بود، بطوری که روند سه ماهه افزایش سرمایه گذاری در این نماد منفی شد، غیرتجاری ها که در هفته ی اخیر مدام در حال تسویه قراردادهای فروش خود بودند، در این هفته هم با میزان بیشتری این رویه را ادامه دادند، در سایر گروه ها هم وضعیت مشابهی در رابطه با تسویه قراردادهای خرید و فروش برقرار بود ولی با این همه تغییرات، بالانس بازار بهم نریخت و سهم گروه ها از بازار ثابت باقی ماند.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: اوراق قرضه 10 ساله امریکا - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: US10Y - اوراق قرضه
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتی
خطوط عمودی: زمان انتشار گزارش
لیبل قیمت: آخرین قیمت در زمان انتشار گزارش
تایم فریم 4 ساعته

شاخص دلار امریکا (USD INDEX) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفا مربوط به معاملات آتی است

کد - 098662

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 3,064,379,045 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 29,549				اندازه قراردادهای 1,000 دلار امریکا * شاخص دلار					
2,147	3,387	27,402	26,162	8,922	5,599	1,736	16,744	18,827	
تغییرات در قراردادهای باز: -409				تغییرات					
-189	-529	-220	+120	+171	-26	+51	-442	+95	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
7.3%	11.5%	92.7%	88.5%	30.2%	18.9%	5.9%	56.7%	63.7%	
تعداد کل معامله گران: 108				تعداد معامله گران در هر دسته					
		50	71	6	8	10	38	58	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته در حدود 1.5٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 2,083 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 537 قرارداد کاهش فروش بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 2.57 و نسبت به کل 0.69 است.
- قراردادهای باز با 409 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 340 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای شاخص دلار رقم خورده است.
- چکیده این هفته: شاخص دلار این هفته بازار کم تلاطمی را سپری کرد و تغییرات خاصی در تمایلات گروه ها ایجاد نشد.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: دلار امریکا - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: EURUSD - فارکس
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتی
خطوط عمودی: زمان انتشار گزارش
لیبل قیمت: آخرین قیمت در زمان انتشار گزارش
تایم فریم 4 ساعته

بیتکوین (BITCOIN) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 133741

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 7,146,534,313 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 25,229				اندازه قراردادهای 5 بیتکوین				
719	1,726	24,510	23,503	799	1,759	1,710	22,001	20,034
تغییرات در قراردادهای باز: -301				تغییرات				
-109	+2	-192	-303	+139	-103	-610	+279	+410
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
2.8%	6.8%	97.2%	93.2%	3.2%	7.0%	6.8%	87.2%	79.4%
تعداد کل معامله گران: 129				تعداد معامله گران در هر دسته				
		65	91	4	4	27	47	73

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 7٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 1,967 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 131 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 17.00 و نسبت به کل 0.91 است.
- قراردادهای باز با 301 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 111 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای بیتکوین رقم خورده است.
- چکیده این هفته: بازار قراردادهای آتی بیتکوین هم در این هفته کم تلاطم بود و سهم گروه ها از بازار هم تقریباً بدون تغییر باقی ماند.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: بیتکوین - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: BTC - کریپتوکارنسی
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتی
خطوط عمودی: زمان انتشار گزارش
لیبل قیمت: آخرین قیمت در زمان انتشار گزارش
تایم فریم 4 ساعته

نفت وست تگزاس (WTI) - بورس کالای نیویورک

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 06765A

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 11,878,541,500 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 151,319				اندازه قراردادهای 1,000 بشکه				
38,826	23,679	112,493	127,640	83,589	61,241	12,118	16,786	54,281
تغییرات در قراردادهای باز: +5,445				تغییرات				
+1,492	+482	+3,953	+4,963	+3,472	+3,698	+101	+380	+1,164
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
25.7%	15.6%	74.3%	84.4%	55.2%	40.5%	8.0%	11.1%	35.9%
تعداد کل معامله گران: 43				تعداد معامله گران در هر دسته				
		36	30	27	23	6	4	6

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 37,495 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 784 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.57 و نسبت به کل 0.34 است.
- قراردادهای باز با 5,445 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,010 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای نفت رقم خورده است.
- چکیده این هفته: در سه ماه اخیر شاهد افزایش سرمایه گذاری در نفت هستیم که این میزان حدود 10٪ بوده است، غیرتجاری ها نیز در این مدت بطور مرتب به قراردادهای خرید خود افزوده اند ولی قراردادهای فروش آنها بطور متناوب کم و زیاد شده است و در این هفته هم به علت مشارکت بیشتر سایر گروه ها کمی سهم آنها از بازار کاهش پیدا کرد.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: نفت وست تگزاس - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: WTI - کالا
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتی
خطوط عمودی: زمان انتشار گزارش
لیبل قیمت: آخرین قیمت در زمان انتشار گزارش
تایم فریم 4 ساعته

طلا (GOLD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 088691

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 83,483,276,070 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 411,195				اندازه قراردادهای 100 اونس تروی				
22,227	38,943	388,968	372,252	266,784	108,432	48,872	73,312	214,948
تغییرات در قراردادهای باز: +4,132				تغییرات				
-470	-2,903	+4,602	+7,035	+954	+2,013	+1,108	+2,540	+3,914
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
5.4%	9.5%	94.6%	90.5%	64.9%	26.4%	11.9%	17.8%	52.3%
تعداد کل معامله گران: 320				تعداد معامله گران در هر دسته				
		186	262	53	49	93	79	170

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 1.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 141,636 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 1,374 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.89 و نسبت به کل 0.44 است.
- قراردادهای باز با 4,132 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 2,433 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای طلا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: با این حال که تغییرات چشمگیری را در این هفته مشاهده نکردیم ولی گروه غیرتجاری با افزایش در قراردادهای خود که برابند آنها هم متمایل به خرید بیشتر بود سهم خود را از بازار کمی افزایش داد. سایر گروه ها هم در این هفته مشغول افزایش در قراردادهای خود بودند ولی این تغییرات چشمگیر نبود.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: طلا - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: XAUUSD - فارکس
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتی
خطوط عمودی: زمان انتشار گزارش
لیبل قیمت: آخرین قیمت در زمان انتشار گزارش
تایم فریم 4 ساعته

نقره (SILVER) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 084691

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 16,212,654,780 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 144,382				اندازه قراردادهای 5,000 اونس تروی					
13,038	30,987	131,344	113,395	81,560	49,112	9,737	40,047	54,546	
تغییرات در قراردادهای باز: -2,202				تغییرات					
-1,788	+593	-414	-2,795	-1,892	+3,605	-3,364	+4,842	-3,036	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
9.0%	21.5%	91.0%	78.5%	56.5%	34.0%	6.7%	27.7%	37.8%	
تعداد کل معامله گران: 216				تعداد معامله گران در هر دسته					
		125	162	39	38	51	54	102	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 4٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 14,499 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 7,878 قرارداد افزایش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.79 و نسبت به کل 0.42 است.
- قراردادهای باز با 2,202 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 2,381 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای نقره رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها که در یک ماه و نیم اخیر در حال افزایش قراردادهای فروش خود بودند، در این هفته هم به تعداد قراردادهای فروش خود افزودند و برخی از معاملات خرید خود را تسویه نمودند که با توجه به عملکرد سایر گروه ها سهم این گروه از بازار کمی کاهش پیدا کرد. در ماه گذشته روند سرمایه گذاری در نقره افزایشی بود ولی در دو هفته اخیر این روند متوقف شده است.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: نقره - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: XAGUSD - فارکس
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتی
خطوط عمودی: زمان انتشار گزارش
لیبل قیمت: آخرین قیمت در زمان انتشار گزارش
تایم فریم 4 ساعته

همه مواردی که در بالا بدان اشاره شد را به عنوان یک ابزار مکمل در تحلیل خود استفاده کنید و وزن اضافه‌تری به آن‌ها ندهید. بسیاری از معامله گران در دام برداشت‌های غلط از این گزارش و اندیکاتورهای آن می‌افتند و موجب ضرر و زیان خود می‌شوند. این گزارش را به عنوان یک راهنما در کنار تحلیل‌های میان‌مدت و بلندمدت خود قرار دهید و برای معاملات کوتاه مدت خود به دنبال توجیه نگردید. مواردی که در بخش تفسیر هم عنوان شد، تحلیل نیستند و تفسیر به این معنی است که صرفاً اطلاعات موجود در اعداد گزارش شده برای تفهیم بیشتر و راحت‌تر به نگارش فارسی درآمده است.

شما نوزدهمین نسخه آموزشی - تحلیلی گزارش تعهد معامله گران به زبان فارسی را مطالعه کردید. امیدواریم که محتوا تهیه شده باعث بهتر شدن نتایج تحلیل‌های شما شود.

پیشنهادات و انتقادات شما راهگشای ما خواهد بود، پس ما را از این موهبت بی بهره نسازید و از طریق راه‌های ارتباطی که در انتهای نشریه آورده شده با ما در ارتباط باشید.

با سپاس فراوان

راهنما

- COT چیست؟ گزارش تعهد معامله گران (COT) یک گزارش هفتگی است که مجموع دارایی‌های بازیگران مختلف در بازار آتی ایالات متحده را نشان می‌دهد.
- این گزارش تغییرات ایجاد شده در موقعیت‌های معاملاتی باز معامله گران بازار فیوچرز یا آتی از جمله معامله گران بزرگ، سفته‌بازهای کوچک و سفته‌بازهای بزرگ را نشان می‌دهد.
- داده‌های گزارش COT توسط کمیسیون معاملات آتی کالای ایالات متحده آمریکا (CFTC) گردآوری و منتشر می‌شود.
- این گزارش منبع بسیار مفیدی برای ارزیابی احساسات بازار است و اساساً یکی از استفاده‌های آن در تحلیل سنتیمنتال و پیدا کردن رد پول هوشمند است. در نگارش تفسیر این گزارش تمرکز بر تمایلات گروه غیرتجاری است، زیرا این گروه از معامله گران صرفاً به قصد انتفاع مالی از نوسانات قیمت وارد معامله می‌شوند.
- گزارش COT هر جمعه در ساعت ET 3:30 منتشر می‌شود و بیانگر تعهدات معامله گران تا سه‌شنبه قبل است.

- گزارش COT کل موقعیت‌های باز شده توسط سه نوع معامله گر مختلف زیر را به تفکیک نشان می‌دهد:
 - معامله گران تجاری یا Commercial traders در فارکس، معمولاً هیچ فاند‌ها
 - معامله گران غیرتجاری یا Non-commercial traders معمولاً سفته‌بازان بزرگ
 - غیر قابل گزارش (معمولاً معامله گران خرد)
- قراردادهای باز یا به بیان دیگر، بهره باز به معنی مجموع تمامی قراردادهای آتی و اختیار معامله است که منعقد شده‌اند اما هنوز با انواع روش‌های تراکنش، تحویل، اجرا و غیره آفست نشده‌اند. این ارقام خالص نیستند، بلکه حجم کلی (یعنی بهره) را نشان می‌دهند.
- نمودار تغییرات قیمت: نمودار تغییرات قیمت نشان دهنده انعکاس رفتار معامله گران در قیمت کالا بوده است.
- درصد قراردادهای باز: درصد قراردادهای باز نشان می‌دهد که چه مقدار از کل قراردادهای آتی در حال حاضر باز است. درصد بالاتر نشان می‌دهد که بازار نسبتاً فعال است، در حالی که درصد کمتر نشان می‌دهد که بازار نسبتاً غیرفعال است.
- تغییرات در پوزیشن‌های خرید و فروش: تغییرات در پوزیشن‌های خرید و فروش می‌تواند نشان دهنده تغییر در تمایلات بازار باشد. افزایش پوزیشن‌های خرید نشان می‌دهد که خریداران نسبت به بازار خوشبین‌تر شده‌اند، در حالی که افزایش پوزیشن‌های فروش نشان می‌دهد که فروشندگان نسبت به بازار بدبین‌تر شده‌اند.

درباره ما

ما در صدد گرد هم آوری خدمات مطلوب با استفاده از فناوری‌های نوین برای سهولت کار معامله گران هستیم. به همین منظور از تخصص و تجربه‌هایمان استفاده کردیم تا ایده‌های جدیدی را برایتان به ارمغان بیاوریم.

ایسن ارائه دهنده جامع‌ترین خدمات بازارهای مالی

سایت: www.iecen.ir

تقویم اقتصادی: www.forexfactory.live

پل‌های ارتباطی: <https://bio.site/iecen>