



نشریه هفتگی

گزارش تعهد معامله گران

به زبان فارسی به همراه تفسیر

COT - Commitments of Traders

❖ تاریخ انتشار: یکشنبه ۲۰ اسفند ۱۴۰۲

❖ سال اول / شماره ۲۰

❖ 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: 5 مارس 24 - 15 اسفند 02

تاریخ انتشار: 8 مارس 24 - 18 اسفند 02

دلار کانادا (CAD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 090741

[بازگشت به فهرست](#)

ارزش قراردادهای باز: 13,517,568,711 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 183,697				اندازه قراردادهای 100,000 دلار کانادا				
32,052	28,322	151,645	155,375	82,615	106,182	6,603	62,427	42,590
تغییرات در قراردادهای باز: +17,213				تغییرات				
+4,272	-1,409	+12,941	+18,622	-8,504	+15,636	+1,554	+19,891	+1,432
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
17.4%	15.4%	82.6%	84.6%	45.0%	57.8%	3.6%	34.0%	23.2%
تعداد کل معامله گران: 111				تعداد معامله گران در هر دسته				
		78	58	38	33	10	33	22

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 9٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 19,837 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 18,459 قرارداد افزایش فروش بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.59 و نسبت به کل 0.36 است.
- قراردادهای باز با 17,213 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 5,681 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای دلار کانادا رقم خورده است.

- چکیده این هفته: همانطور که مشاهده نمودید این هفته غیرتجاری ها بصورت کاملا محسوس بر قراردادهای فروش خود افزودند، هر چند که تمایل گروه تجاری عکس این قضیه بود و معاملات فروش را تسویه و وارد معاملات خرید جدید شدند اما حجم معاملات غیرتجاری ها بیشتر بود که باعث افزایش سهم آنها از بازار هم شد.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: دلار کانادا - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: USD/CAD - 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: 10,779,346,497 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 76,166				اندازه قراردادهای 125,000 فرانک سوئیس					
20,906	9,280	55,260	66,886	20,330	49,507	444	34,486	16,935	
تغییرات در قراردادهای باز: +10,959				تغییرات					
+927	+1,029	+10,032	+9,930	+3,323	+8,791	+61	+6,648	+1,078	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
27.4%	12.2%	72.6%	87.8%	26.7%	65.0%	0.6%	45.3%	22.2%	
تعداد کل معامله گران: 57				تعداد معامله گران در هر دسته					
		35	29	16	15	3	17	13	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 14٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 17,551 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 5,570 قرارداد افزایش فروش بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.74 و نسبت به کل 0.42 است .
- قراردادهای باز با 10,959 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 102 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای فرانک سوئیس رقم خورده است.
- چکیده این هفته: تمام گروه ها در این هفته همچون دو هفته قبل وارد معاملات خرید و فروش فرانک شده اند که غیرتجاری ها همچون روال یک ماه اخیر قراردادهای فروش خود را افزایش دادند ولی سهم این گروه از بازار افزایش نداشت زیرا حجم معاملات تجاری ها در این هفته بیشتر بود اما برابند بازار در این هفته تقریباً نزدیک به صفر 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: 17,605,321,558 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 221,726				اندازه قراردادهای پوند انگلیس 62,500				
26,858	32,596	194,868	189,130	135,778	71,655	15,196	43,894	102,279
تغییرات در قراردادهای باز: +10,898				تغییرات				
+1,042	+1,548	+9,856	+9,350	+8,426	-4,107	+3,148	-1,718	+10,309
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
12.1%	14.7%	87.9%	85.3%	61.2%	32.3%	6.9%	19.8%	46.1%
تعداد کل معامله گران: 115				تعداد معامله گران در هر دسته				
		80	63	53	27	15	20	27

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 58,385 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 12,027 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.77 و نسبت به کل 0.42 است.
- قراردادهای باز با 10,898 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل نیز در این هفته 506 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای پوند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: تمایل گروه غیرتجاری در ماه های اخیر بصورت مشهود در افزایش تعداد قراردادهای خرید بوده است و این روند در این هفته هم با قدرت بیشتری ادامه پیدا کرد که باعث افزایش سهم بازار این گروه هم شد، تمایل تجاری ها هم دقیقاً برعکس غیرتجاری ها بود که باعث شد برابری بازار تقریباً بدون تغییر باقی بماند.

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: 26,213,053,448 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 314,586				اندازه قراردادهای ین ژاپن 12,500,000				
42,062	47,380	272,524	267,206	86,604	200,129	12,406	173,514	54,671
تغییرات در قراردادهای باز: +4,953				تغییرات				
-511	+4,084	+5,464	+869	+14,161	-4,296	+1,755	-10,452	+3,410
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
13.4%	15.1%	86.6%	84.9%	27.5%	63.6%	3.9%	55.2%	17.4%
تعداد کل معامله گران: 167				تعداد معامله گران در هر دسته				
		109	91	50	52	14	54	30

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 2٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 118,843 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 13,862 قرارداد کاهش فروش بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.84 و نسبت به کل 0.44 است.
- قراردادهای باز با 4,953 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 4,595 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای ین رقم خورد.
- چکیده این هفته: سهم غیرتجاری ها از بازار به علت تسویه بخشی از قراردادهای فروش کمی کاسته شد، این تسویه هم برخلاف روند دو ماه اخیر آنها بوده است. اما تجاری ها در این هفته به تعداد قراردادهای فروش خود افزودند.

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 صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 099741

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 95,943,948,980 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 707,108				اندازه قراردادهای 125,000 یورو				
51,077	81,532	656,031	625,576	501,537	404,771	20,780	133,714	200,025
تغییرات در قراردادهای باز: -8,437				تغییرات				
-2,210	+1,198	-6,227	-9,635	+519	-6,346	+1,920	-8,666	-5,209
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
7.2%	11.5%	92.8%	88.5%	70.9%	57.2%	2.9%	18.9%	28.3%
تعداد کل معامله گران: 308				تعداد معامله گران در هر دسته				
		171	228	90	122	40	57	89

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 1٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 66,311 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 3,457 قرارداد کاهش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.39 و نسبت به کل 0.27 است.
- قراردادهای باز با 8,437 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 3,408 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای یورو رقم خورده است.
- چکیده این هفته: این هفته همچون دو هفته قبل، هفته تسویه معاملات در تمام گروه ها بود. غیرتجاری ها بیشتر مشغول تسویه قراردادهای فروش خود بودند ولی در گروه تجاری معاملات خرید تسویه شدند که نتیجه این تغییرات کاهش مختصری از سهم غیرتجاری ها و برابند کل کاهش فروش بیشتر بود.

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: 15,222,740,000 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 234,196				اندازه قراردادهای 100,000 دلار استرالیا				
30,699	19,697	203,497	214,499	56,158	151,903	8,630	138,709	53,966
تغییرات در قراردادهای باز: +29,204				تغییرات				
+708	+307	+28,496	+28,897	+16,643	+22,611	+1,960	+9,893	+4,326
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
13.1%	8.4%	86.9%	91.6%	24.0%	64.9%	3.7%	59.2%	23.0%
تعداد کل معامله گران: 110				تعداد معامله گران در هر دسته				
		76	66	34	34	15	34	25

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 12٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 84,743 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 5,567 قرارداد افزایش فروش بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.96 و نسبت به کل 0.48 است.
- قراردادهای باز با 29,204 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش چشمگیری داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 401 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای دلار استرالیا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در این هفته قراردادهای خرید و فروش خود را افزایش دادند که سهم قراردادهای فروش 2 برابر قراردادهای خرید بود و این روند افزایش قراردادهای فروش در ماه های اخیر ادامه دارد بوده، اما با وجود افزایش 14 هزار قرارداد غیرتجاری سهم آنها از بازار کاسته شد زیرا تجاری ها بصورت چشمگیری بر قراردادهای خود افزودند که برابری قراردادهای خرید آنها حدود 5 هزار قرارداد بیشتر بود.

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

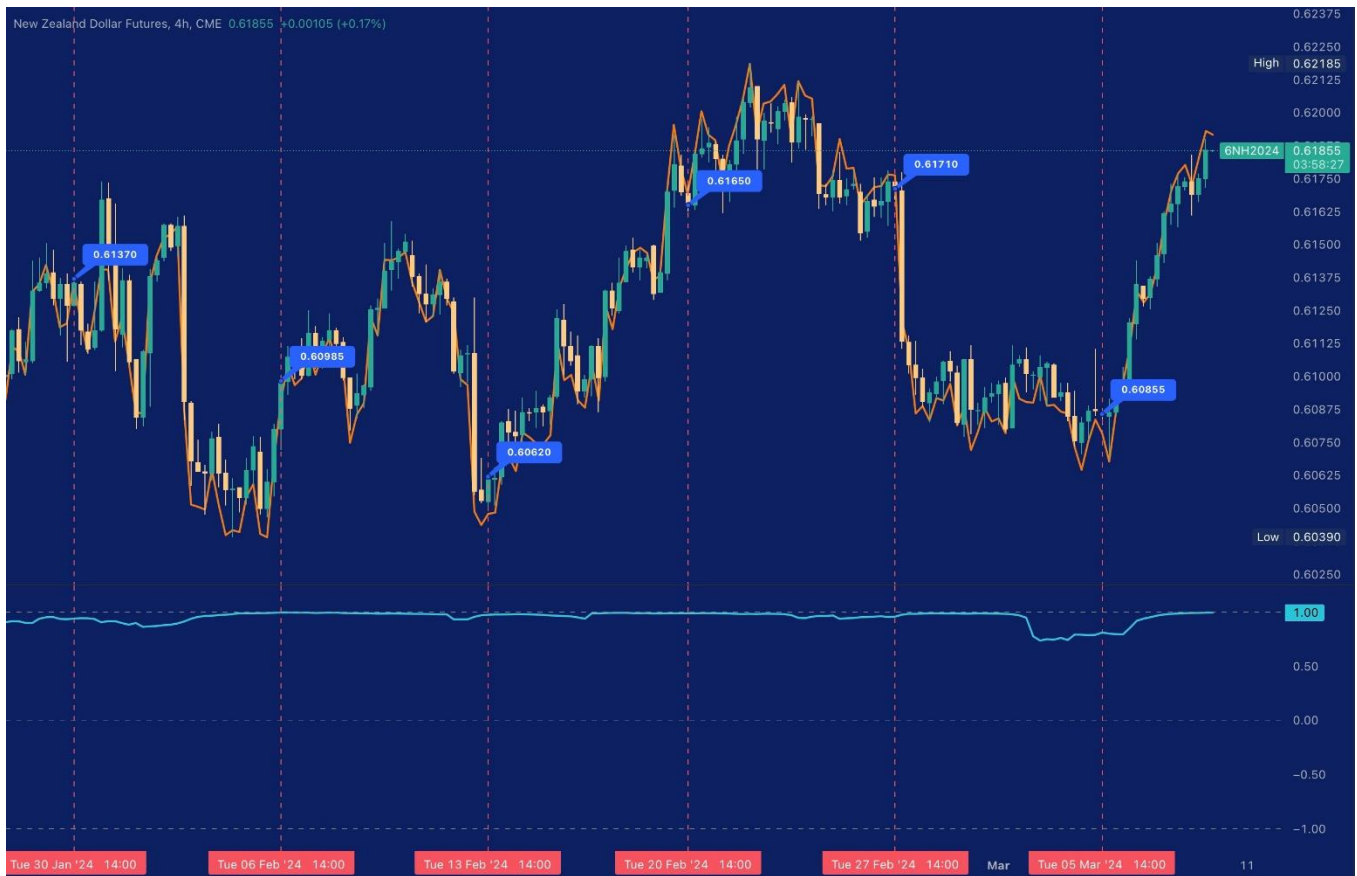
ارزش قراردادهای باز: 3,049,784,058 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 50,123				اندازه قراردادهای 100,000 دلار نیوزلند				
3,723	4,281	46,400	45,842	29,205	21,419	2,524	14,671	21,899
تغییرات در قراردادهای باز: +1,660				تغییرات				
+1,071	-739	+589	+2,399	-694	+3,945	+497	+786	-2,043
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
7.4%	8.5%	92.6%	91.5%	58.3%	42.7%	5.0%	29.3%	43.7%
تعداد کل معامله گران: 93				تعداد معامله گران در هر دسته				
		61	52	32	20	10	25	26

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 2٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 7,228 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 2,829 قرارداد کاهش خرید بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.77 و نسبت به کل 0.42 است.
- قراردادهای باز با 1,660 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,810 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای دلار نیوزلند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در این هفته برخلاف روال ماه گذشته بخشی از قراردادهای خرید خود را تسویه کردند و تجاری ها هم بر تعداد قراردادهای خرید خود افزودند که این اتفاقات باعث کاهش سهم بازار غیرتجاری ها شد.

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: 19,549,861,950 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری				
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید		
قراردادهای باز: 101,334				اندازه قراردادهای \$5 * شاخص داوجونز						
13,022	15,538	88,312	85,796	71,427	53,467	1,643	15,242	30,685		
تغییرات در قراردادهای باز: -5,229				تغییرات						
-269	-1,022	-4,960	-4,207	-4,664	-32	-1,305	+1,009	-2,869		
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران										
12.9%	15.3%	87.1%	84.7%	70.5%	52.8%	1.6%	15.0%	30.3%		
تعداد کل معامله گران: 119				تعداد معامله گران در هر دسته						
		64	84	31	37	12	28	40		

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 6٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 15,443 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 3,878 قرارداد افزایش فروش بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.38 و نسبت به کل 0.27 است.
- قراردادهای باز با 5,229 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 754 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای شاخص داوجونز رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در این هفته بخشی از قراردادهای خود را تسویه کردند و طبق روال ماه اخیر به تعداد قراردادهای فروش خود افزودند ولی تجاری ها حدود 5 هزار قرارداد فروش خود را تسویه کردند که باعث شد در برابری بازار تغییر چشمگیری ایجاد نشود و سهم گروه ها از بازار تقریباً بدون تغییر باقی ماند.

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: 98,783,174,178 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 309,873				اندازه قراردادهای \$20 * شاخص نزدک					
35,637	45,816	274,236	264,056	172,013	161,680	32,889	69,335	69,488	
تغییرات در قراردادهای باز: +2,321				تغییرات					
-1,115	+3,221	+3,436	-900	+304	+7,894	+1,624	+1,508	-10,418	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
11.5%	14.8%	88.5%	85.2%	55.5%	52.2%	10.6%	22.4%	22.4%	
تعداد کل معامله گران: 320				تعداد معامله گران در هر دسته					
		183	221	98	121	38	67	78	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته تقریباً بدون تغییر باقی مانده است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 153 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 11,927 قرارداد کاهش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.51 و نسبت به کل 0.31 است.
- قراردادهای باز با 2,321 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 4,337 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای شاخص نزدک رقم خورده است.
- چکیده این هفته: این هفته طبق روند دو ماه اخیر غیرتجاری ها به کاهش قراردادهای خرید خود و افزایش قراردادهای فروش مبادرت ورزیدند ولی سهم آنها از بازار افزایش نیافت زیرا تجاری ها افزایش بیشتری در قراردادهای خود داشتند که برابری آنها به سمت 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: 427,777,600,000 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 4,277,776				اندازه قراردادهای 100,000 دلار امریکا ارزش اسمی					
372,285	414,574	3,905,491	3,863,202	2,692,916	3,363,885	87,059	1,125,516	412,258	
تغییرات در قراردادهای باز: -254,403				تغییرات					
-8,412	-15,320	-245,991	-239,083	-183,569	-128,985	-47,827	-14,595	-62,271	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
8.7%	9.7%	91.3%	90.3%	63.0%	78.6%	2.0%	26.3%	9.6%	
تعداد کل معامله گران: 391				تعداد معامله گران در هر دسته					
		277	258	187	190	32	77	49	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 6٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 713,258 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 47,676 قرارداد کاهش خرید بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.27 و نسبت به کل 0.21 است.
- قراردادهای باز با 254,403 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 6,908 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای این نماد رقم خورده است.
- چکیده این هفته: این هفته، در نماد اوراق قرضه 10 ساله همچون هفته قبل 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 به تسویه قراردادهای فروش پرداختند اما این هفته برابری تسویه معاملات خرید بیشتر بود، 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 تقریباً 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 صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 098662

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 2,950,122,750 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 28,450				اندازه قراردادهای 1,000 دلار امریکا * شاخص دلار					
2,511	3,387	25,939	25,063	9,557	5,582	1,715	14,667	17,766	
تغییرات در قراردادهای باز: -1,099				تغییرات					
+364	0	-1,463	-1,099	+635	-17	-21	-2,077	-1,061	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
8.8%	11.9%	91.2%	88.1%	33.6%	19.6%	6.0%	51.6%	62.4%	
تعداد کل معامله گران: 107				تعداد معامله گران در هر دسته					
		54	63	8	7	7	42	53	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته در حدود 4٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 3,099 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 1,016 قرارداد کاهش فروش بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 2.25 و نسبت به کل 0.67 است.
- قراردادهای باز با 1,099 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 364 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای شاخص دلار رقم خورده است.
- چکیده این هفته: در سایر گروه ها شاهد تغییر خاصی نیستیم ولی غیرتجاری ها مشغول تسویه قراردادهای خرید و فروش خود بودند که برابری آنها تسویه هزار قرارداد فروش بیشتر بود و سهم آنها هم از بازار کاهش پیدا کرد.

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: 8,768,468,205 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 27,747				اندازه قراردادهای 5 بیتکوین				
813	1,705	26,934	26,042	1,040	1,500	2,186	23,708	22,356
تغییرات در قراردادهای باز: +2,518				تغییرات				
+94	-21	+2,424	+2,539	+241	-259	+476	+1,707	+2,322
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
2.9%	6.1%	97.1%	93.9%	3.7%	5.4%	7.9%	85.4%	80.6%
تعداد کل معامله گران: 130				تعداد معامله گران در هر دسته				
		73	91	6	5	32	50	70

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 18.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 1,352 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 615 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 19.11 و نسبت به کل 0.91 است.
- قراردادهای باز با 2,518 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 115 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای بیتکوین رقم خورده است.
- چکیده این هفته: این هفته غیرتجاری ها وارد معاملات خرید و فروش شدند و برابند قراردادهای خرید همانطور که مشاهده می کنید 615 قرارداد بیشتر بوده است، با این افزایش سرمایه گذاری سهم این گروه از بازار هم در این هفته افزایشی بود.

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: 10,628,505,810 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 136,071				اندازه قراردادهای 1,000 بشکه					
33,329	22,366	102,742	113,705	75,127	48,276	6,326	21,289	59,103	
تغییرات در قراردادهای باز: -15,248				تغییرات					
-5,497	-1,313	-9,751	-13,935	-8,462	-12,965	-5,792	+4,503	+4,822	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
24.5%	16.4%	75.5%	83.6%	55.2%	35.5%	4.6%	15.6%	43.4%	
تعداد کل معامله گران: 42				تعداد معامله گران در هر دسته					
		36	30	26	22	7	5	6	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 12٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 37,814 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 319 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.70 و نسبت به کل 0.40 است.
- قراردادهای باز با 15,248 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 4,010 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای نفت رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها تقریباً بصورت برابر به قراردادهای خرید و فروش خود افزودند و سهمشان از بازار رشد چشمگیری پیدا کرد، البته افزایش سهم این گروه از بازار بیشتر به تسویه حجم زیادی از معاملات خرید و فروش گروه تجاری مرتبط است که حدوداً 21 هزار قرارداد را تسویه کردند! تجاری ها 4 هزار قرارداد خرید بیشتری را نسبت به فروش تسویه کردند.

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: 100,352,810,560 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 471,616				اندازه قراردادهای 100 اونس تروی				
29,283	44,782	442,333	426,834	310,815	104,023	58,663	72,855	264,148
تغییرات در قراردادهای باز: +60,421				تغییرات				
+7,056	+5,839	+53,365	+54,582	+44,031	-4,409	+9,791	-457	+49,200
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
6.2%	9.5%	93.8%	90.5%	65.9%	22.1%	12.4%	15.4%	56.0%
تعداد کل معامله گران: 342				تعداد معامله گران در هر دسته				
		188	274	56	46	89	87	182

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 17٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 191,293 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 49,657 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.95 و نسبت به کل 0.45 است.
- قراردادهای باز با 60,421 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش چشمگیری داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,217 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای طلا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: این هفته برای طلا هفته پر تلاطمی بود، غیرتجاری ها در این هفته 49 هزار قرارداد خرید افزودند و با وجود اینکه تجاری ها هم 44 هزار قرارداد فروش افزودند اما سهم غیرتجاری ها از بازار افزایش داشت. نکته مهم بعدی این است که غیرتجاری ها این افزایش در قراردادهای خرید را بر خلاف روند یک ماه اخیر معاملاتشان انجام دادند!

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: 16,690,427,100 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 141,026				اندازه قراردادهای 5,000 اونس تروی				
12,382	29,092	128,644	111,934	87,899	42,874	10,175	30,570	58,885
تغییرات در قراردادهای باز: -3,356				تغییرات				
-656	-1,895	-2,700	-1,461	+6,339	-6,238	+438	-9,477	+4,339
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
8.8%	20.6%	91.2%	79.4%	62.3%	30.4%	7.2%	21.7%	41.8%
تعداد کل معامله گران: 217				تعداد معامله گران در هر دسته				
		126	164	39	31	56	55	105

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 28,315 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 13,816 قرارداد کاهش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.76 و نسبت به کل 0.41 است.
- قراردادهای باز با 3,356 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,239 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 بخشی از قراردادهای فروش خود را تسویه نمودند و به قراردادهای خرید خود افزودند 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 سه 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 بیستمین 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>