



نشریه هفتگی

گزارش تعهد معامله گران

به زبان فارسی به همراه تفسیر

COT - Commitments of Traders

❖ تاریخ انتشار: یکشنبه ۲۷ اسفند ۱۴۰۲

❖ سال اول / شماره ۲۱

❖ صاحب امتیاز: انتشارات ایسن

❖ قیمت: ۳۰,۰۰۰ تومان / ۱\$



فارکس
فکتوری فارسی



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: 12 مارس 24 - 22 اسفند 02

تاریخ انتشار: 15 مارس 24 - 25 اسفند 02

دلار کانادا (CAD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفا مربوط به معاملات آتی است

کد - 090741

[بازگشت به فهرست](#)

ارزش قراردادهای باز: 14,322,681,551 USD

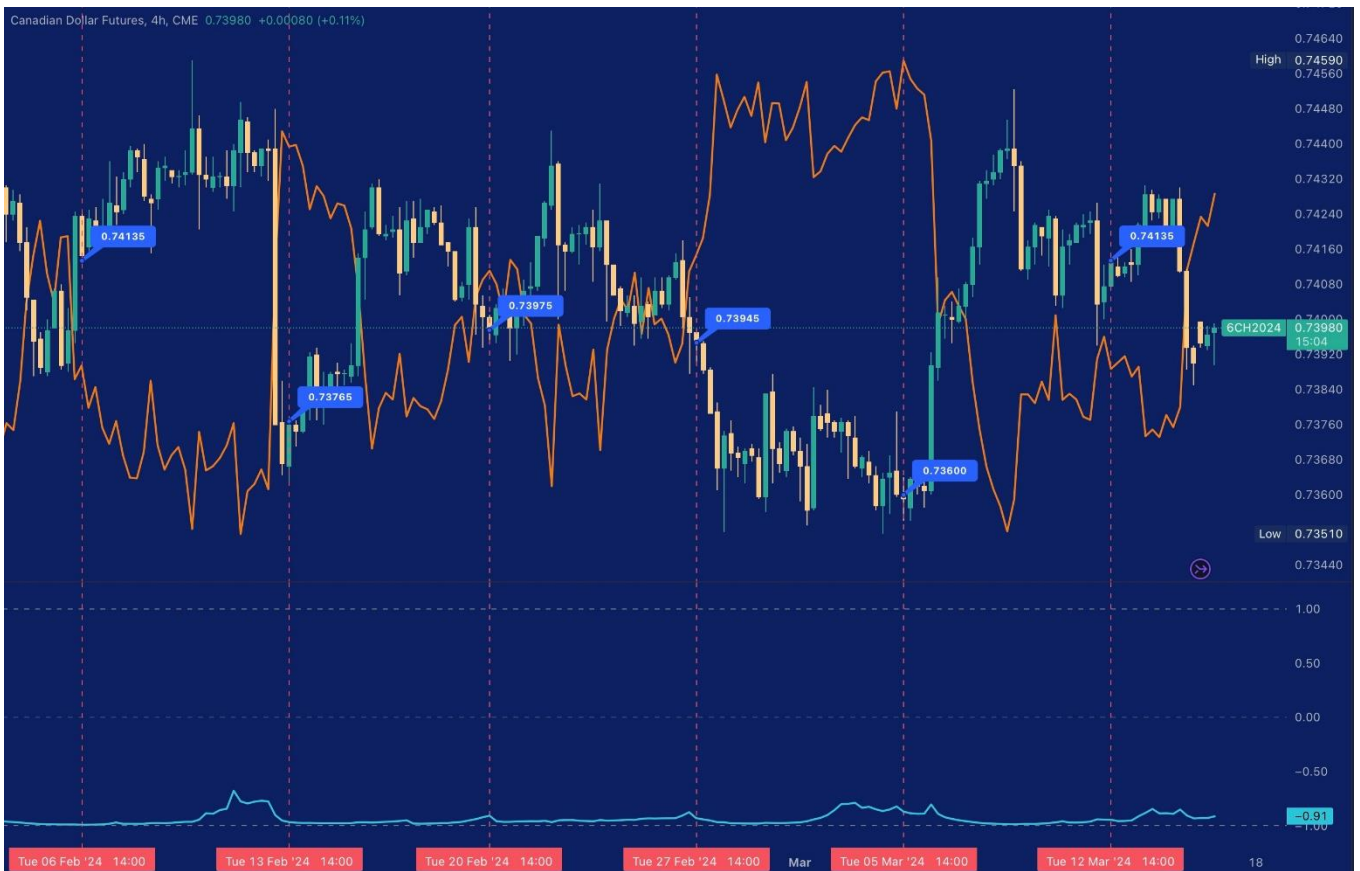
غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 193,223				اندازه قراردادهای 100,000 دلار کانادا				
29,571	30,149	163,652	163,074	83,646	113,942	13,168	66,838	35,964
تغییرات در قراردادهای باز: +9,526				تغییرات				
-2,481	+1,827	+12,007	+7,699	+1,031	+7,760	+6,565	+4,411	-6,626
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
15.3%	15.6%	84.7%	84.4%	43.3%	59.0%	6.8%	34.6%	18.6%
تعداد کل معامله گران: 105				تعداد معامله گران در هر دسته				
		72	63	35	38	12	30	20

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 5.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 30,874 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 11,037 قرارداد افزایش فروش بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.58 و نسبت به کل 0.35 است.
- قراردادهای باز با 9,526 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 4,308 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای دلار کانادا رقم خورده است.

- چکیده این هفته: غیرتجاری ها بخشی از قراردادهای خرید خود را تسویه کردند و به قراردادهای فروش خود افزودند تا بالانس قراردادهای آنها به سمت فروش سنگینی بیشتری کند، اما سهم آنها از بازار کمی کاسته شد چون تجاری ها هم بر قراردادهای فروش و هم خرید خود افزودند.

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 صرفا مربوط به معاملات آتی است

کد - 092741

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 11,746,819,715 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 82,442				اندازه قراردادهای 125,000 فرانک سوئیس				
20,408	9,575	62,034	72,867	28,182	56,885	4,746	29,106	11,236
تغییرات در قراردادهای باز: +6,276				تغییرات				
-498	+295	+6,774	+5,981	+7,852	+7,378	+4,302	-5,380	-5,699
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
24.8%	11.6%	75.2%	88.4%	34.2%	69.0%	5.8%	35.3%	13.6%
تعداد کل معامله گران: 61				تعداد معامله گران در هر دسته				
		40	38	21	19	7	16	14

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 8٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 17,870 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 319 قرارداد کاهش خرید بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.53 و نسبت به کل 0.33 است .
- قراردادهای باز با 6,276 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 793 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای فرانک سوئیس رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها بخش زیادی (حدود 11 هزار قرارداد) از قراردادهای خود را تسویه کردند که برابند قراردادهای تسویه شده تقریبا نزدیک به صفر بود به همین خاطر در بالانس قراردادهای آنها تغییر خاصی ایجاد نشد ولی سهم آنها از بازار کاهش چشمگیری داشت. تجاری ها اما هم به قراردادهای خرید و هم فروش خود افزودند، بالانس معاملات خرید و فروش این گروه هم تقریبا تغییر خاصی نداشت.

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: 22,204,357,665 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 277,702				اندازه قراردادهای پوند انگلیس 62,500					
21,654	30,123	256,048	247,579	183,258	104,338	19,956	52,834	123,285	
تغییرات در قراردادهای باز: +55,976				تغییرات					
-5,204	-2,473	+61,180	+58,449	+47,480	+32,683	+4,760	+8,940	+21,006	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
7.8%	10.8%	92.2%	89.2%	66.0%	37.6%	7.2%	19.0%	44.4%	
تعداد کل معامله گران: 131				تعداد معامله گران در هر دسته					
		89	76	56	34	15	26	33	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 20٪ افزایش داشت که تغییر چشمگیری بود.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 70,451 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 12,066 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.68 و نسبت به کل 0.38 است.
- قراردادهای باز با 55,976 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل نیز در این هفته 2,731 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 اما باعث افزایش سهم بازار این گروه نشد، چونکه تجاری ها در این هفته بالغ بر 80 هزار قرارداد جدید ایجاد کردند که بالانس قراردادهای فروش همچون روال هفته های قبل بیشتر بود.

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: 27,576,580,208 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 325,675				اندازه قراردادهای ین ژاپن 12,500,000				
43,141	47,586	282,534	278,089	109,601	207,478	15,688	157,245	54,923
تغییرات در قراردادهای باز: +11,089				تغییرات				
+1,079	+206	+10,010	+10,883	+22,997	+7,349	+3,282	-16,269	+252
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
13.2%	14.6%	86.8%	85.4%	33.7%	63.7%	4.8%	48.3%	16.9%
تعداد کل معامله گران: 165				تعداد معامله گران در هر دسته				
		111	95	54	54	15	53	30

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 102,322 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 16,521 قرارداد کاهش فروش بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.71 و نسبت به کل 0.40 است.
- قراردادهای باز با 11,089 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 873 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای ین رقم خورد.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها همچون هفته قبل بخشی از قراردادهای فروش خود را تسویه کردند و با توجه به اینکه تجاری ها در حال افزایش قراردادهای خرید و فروش خود بالاخص قراردادهای فروش بودند سهم غیرتجاری ها از بازار کاسته شد.

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: 98,027,094,750 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 717,720				اندازه قراردادهای 125,000 یورو				
54,109	84,306	663,611	633,414	506,685	402,081	37,335	119,591	193,998
تغییرات در قراردادهای باز: +10,612				تغییرات				
+3,032	+2,774	+7,580	+7,838	+5,148	-2,690	+16,555	-14,123	-6,027
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
7.5%	11.7%	92.5%	88.3%	70.6%	56.0%	5.2%	16.7%	27.0%
تعداد کل معامله گران: 293				تعداد معامله گران در هر دسته				
		173	214	95	119	39	54	80

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 2٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 74,407 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 8,096 قرارداد کاهش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.38 و نسبت به کل 0.27 است.
- قراردادهای باز با 10,612 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 258 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای یورو رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها برای چهارمین هفته متوالی دست به تسویه قراردادهای خود زدند که سهم قراردادهای فروش بطور چشمگیری بیشتر از خرید بود و سهم آنها از بازار مختصری کاهش یافت. در سایر گروه ها هم شاهد تغییرات خاصی نبودیم.

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: 15,175,731,103 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 229,723				اندازه قراردادهای 100,000 دلار استرالیا				
27,696	20,858	202,027	208,865	54,053	151,731	15,543	132,431	41,591
تغییرات در قراردادهای باز: -4,473				تغییرات				
-3,003	+1,161	-1,470	-5,634	-2,105	-172	+6,913	-6,278	-12,375
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
12.1%	9.1%	87.9%	90.9%	23.5%	66.0%	6.8%	57.6%	18.1%
تعداد کل معامله گران: 109				تعداد معامله گران در هر دسته				
		72	75	32	39	18	30	27

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته تقریباً بدون تغییر باقی مانده است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 90,840 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 6,097 قرارداد کاهش خرید بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.92 و نسبت به کل 0.46 است.
- قراردادهای باز با 4,473 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 4,164 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای دلار استرالیا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در این هفته مشغول تسویه حدود 20 هزار قرارداد خود بودند که سهم قراردادهای خرید بیشتر بود، سهم این گروه از بازار هم کمی کاهش داشت. گروه تجاری هم بخش کوچکی از قراردادهای خود را تسویه نمودند ولی برابند بازار با حدود 4 هزار قرارداد تحت تاثیر تسویه قراردادهای خرید غیرتجاری قرار گرفت.

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: 3,241,252,101 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 52,711				اندازه قراردادهای 100,000 دلار نیوزلند					
2,828	4,700	49,883	48,011	30,745	26,408	5,212	13,926	16,391	
تغییرات در قراردادهای باز: +2,588				تغییرات					
-895	+419	+3,483	+2,169	+1,540	+4,989	+2,688	-745	-5,508	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
5.4%	8.9%	94.6%	91.1%	58.3%	50.1%	9.9%	26.4%	31.1%	
تعداد کل معامله گران: 89				تعداد معامله گران در هر دسته					
		56	60	23	23	18	24	27	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 6٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 2,465 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 4,763 قرارداد کاهش خرید بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.62 و نسبت به کل 0.36 است.
- قراردادهای باز با 2,588 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,314 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای دلار نیوزلند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در این هفته همچون هفته قبل بخشی از قراردادهای خرید خود را تسویه کردند و تجاری ها هم بر تعداد قراردادهای خرید و فروش خود افزودند که این اتفاقات باعث کاهش سهم بازار غیرتجاری ها برای پنجمین هفته متوالی 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: 22,440,059,178 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 115,061				اندازه قراردادهای \$5 * شاخص داوجونز					
15,144	16,851	99,917	98,211	75,691	56,972	10,208	14,018	31,031	
تغییرات در قراردادهای باز: +13,727				تغییرات					
+2,122	+1,312	+11,605	+12,415	+4,264	+3,505	+8,565	-1,224	+346	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
13.2%	14.6%	86.8%	85.4%	65.8%	49.5%	8.9%	12.2%	27.0%	
تعداد کل معامله گران: 118				تعداد معامله گران در هر دسته					
		68	88	31	34	22	29	39	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 13٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 17,013 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 1,570 قرارداد کاهش فروش بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.41 و نسبت به کل 0.28 است.
- قراردادهای باز با 13,727 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 810 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای شاخص داوجونز رقم خورده است.
- چکیده این هفته: تحرک زیاد غیرتجاری ها در این هفته در اسپرد بود و با این حال که تجاری ها هم بر قراردادهای خرید و هم فروش خود افزودند ولی سهم غیرتجاری ها کمی افزایش داشت.

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: 115,004,977,073 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 353,521				اندازه قراردادهای \$20 * شاخص نزدک					
41,963	48,369	311,558	305,152	197,956	189,424	42,524	71,077	73,204	
تغییرات در قراردادهای باز: +43,648				تغییرات					
+6,326	+2,552	+37,322	+41,096	+25,944	+27,745	+9,636	+1,743	+3,715	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
11.9%	13.7%	88.1%	86.3%	56.0%	53.6%	12.0%	20.1%	20.7%	
تعداد کل معامله گران: 306				تعداد معامله گران در هر دسته					
		186	217	97	122	44	59	75	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 14٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 2,127 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 1,974 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.48 و نسبت به کل 0.30 است.
- قراردادهای باز با 43,648 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش چشمگیری داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 3,774 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای شاخص نزدک رقم خورده است.
- چکیده این هفته: این هفته تمام گروه ها مشغول افزودن به قراردادهای خرید و فروش خود بودند اما تغییر خاصی در تمایلات آنها وجود نداشت. همچنین تجاری ها افزایش چشمگیری در قراردادهای خود داشتند که باعث کاهش سهم غیرتجاری ها شد.

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: 425,309,800,000 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 4,253,098				اندازه قراردادهای 100,000 دلار امریکا ارزش اسمی					
347,689	390,056	3,905,409	3,863,042	2,781,088	3,342,267	62,936	1,061,385	457,839	
تغییرات در قراردادهای باز: -24,678				تغییرات					
-24,596	-24,518	-82	-160	+88,172	-21,618	-24,123	-64,131	+45,581	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
8.2%	9.2%	91.8%	90.8%	65.4%	78.6%	1.5%	25.0%	10.8%	
تعداد کل معامله گران: 403				تعداد معامله گران در هر دسته					
		283	271	188	198	34	79	55	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته تقریباً بدون تغییر باقی مانده است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 603,546 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 109,712 قرارداد کاهش خرید بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.26 و نسبت به کل 0.20 است.
- قراردادهای باز با 24,678 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 78 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای این نماد رقم خورده است.
- چکیده این هفته: تمایلات این هفته غیرتجاری ها به تسویه قراردادهای فروش و افزایش قراردادهای خرید بود و تجاری ها هم دقیقاً عکس غیرتجاری ها بودند. همچنان که از برابری بازار مشخص است در این هفته فقط تعدادی از قراردادها در بین این گروه ها دست به دست شد و تغییر چشمگیری در بازار رخ نداد.

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: 2,712,167,550 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 26,365				اندازه قراردادهای 1,000 دلار امریکا * شاخص دلار					
2,658	2,853	23,707	23,512	9,508	3,127	2,838	11,361	17,547	
تغییرات در قراردادهای باز: -2,085				تغییرات					
+147	-534	-2,232	-1,551	-49	-2,455	+1,123	-3,306	-219	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
10.1%	10.8%	89.9%	89.2%	36.1%	11.9%	10.8%	43.1%	66.6%	
تعداد کل معامله گران: 93				تعداد معامله گران در هر دسته					
		55	52	9	5	11	39	42	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته در حدود 9٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 6,186 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 3,087 قرارداد کاهش فروش بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 2.51 و نسبت به کل 0.67 است.
- قراردادهای باز با 2,085 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 681 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای شاخص دلار رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها همچون هفته قبل بخشی از قراردادهای فروش خود را تسویه کردند و برخلاف آنها تجاری ها بخشی از قراردادهای خرید خود را تسویه نمودند. با توجه به این تغییرات سهم غیرتجاری ها از بازار مقدار کمی افزایش داشت.

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: 30,398				اندازه قراردادهای 5 بیتکوین				
865	1,800	29,533	28,598	1,427	1,486	2,135	25,971	24,977
تغییرات در قراردادهای باز: +2,651				تغییرات				
+52	+95	+2,599	+2,556	+387	-14	-51	+2,263	+2,621
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
2.8%	5.9%	97.2%	94.1%	4.7%	4.9%	7.0%	85.4%	82.2%
تعداد کل معامله گران: 132				تعداد معامله گران در هر دسته				
		72	92	5	4	32	53	69

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 18.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 994 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 358 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 18.18 و نسبت به کل 0.91 است.
- قراردادهای باز با 2,651 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 43 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای بیتکوین رقم خورده است.
- چکیده این هفته: این هفته غیرتجاری ها وارد معاملات خرید و فروش شدند و برابری قراردادهای خرید همانطور که مشاهده می کنید 358 قرارداد بیشتر بوده است، اما افزایش سرمایه گذاری در سایر گروه ها بیشتر بود که منجر به کاهش اندکی از سهم غیرتجاری ها از بازار شد.

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: 11,709,828,000 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 150,126				اندازه قراردادهای 1,000 بشکه					
33,679	21,406	116,447	128,720	82,601	61,351	11,353	22,493	56,016	
تغییرات در قراردادهای باز: +14,055				تغییرات					
+350	-960	+13,705	+15,015	+7,474	+13,075	+5,027	+1,204	-3,087	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
22.4%	14.3%	77.6%	85.7%	55.0%	40.9%	7.6%	15.0%	37.3%	
تعداد کل معامله گران: 46				تعداد معامله گران در هر دسته					
		39	36	29	28	7	5	6	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 9٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 33,523 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 4,291 قرارداد کاهش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.62 و نسبت به کل 0.36 است.
- قراردادهای باز با 14,055 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,310 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای نفت رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها بخشی از قراردادهای خرید خود را تسویه و به قراردادهای فروش خود افزودند.
- تمایلات این گروه نسبت به نفت در بلند مدت بدون تغییر باقی مانده است. اما تجاری ها حدود 20 هزار قرارداد جدید اضافه نمودند که منجر به کاهش سهم بازار غیرتجاری ها شد.

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: 111,403,804,875 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 516,057				اندازه قراردادهای 100 اونس تروی				
31,321	47,992	484,736	468,065	347,705	129,432	55,571	81,460	283,062
تغییرات در قراردادهای باز: +44,441				تغییرات				
+2,038	+3,210	+42,403	+41,231	+36,890	+25,409	-3,092	+8,605	+18,914
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
6.1%	9.3%	93.9%	90.7%	67.4%	25.1%	10.8%	15.8%	54.9%
تعداد کل معامله گران: 342				تعداد معامله گران در هر دسته				
		195	262	59	42	84	85	184

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 10٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 201,602 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 10,309 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.88 و نسبت به کل 0.44 است.
- قراردادهای باز با 44,441 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش چشمگیری داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,172 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای طلا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها هم به قراردادهای خرید و هم به فروش خود افزودند اما برابند آنها 10 هزار قرارداد خرید بیشتر بود و با این افزایش سهم آنها از بازار کاهش داشت زیرا تجاری ها حدود 42 هزار افزایش در قراردادهایشان داشتند که سهم قراردادهای فروش حدود 11 هزار قرارداد بیشتر بود.

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: 144,534				اندازه قراردادهای 5,000 اونس تروی					
13,674	27,826	130,860	116,708	96,127	40,997	8,617	26,116	67,094	
تغییرات در قراردادهای باز: +3,508				تغییرات					
+1,292	-1,266	+2,216	+4,774	+8,228	-1,877	-1,558	-4,454	+8,209	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
9.5%	19.3%	90.5%	80.7%	66.5%	28.4%	6.0%	18.1%	46.4%	
تعداد کل معامله گران: 222				تعداد معامله گران در هر دسته					
		133	154	45	28	49	59	103	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 4٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 40,978 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 12,663 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.74 و نسبت به کل 0.41 است.
- قراردادهای باز با 3,508 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 2,558 قرارداد افزایش 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، ولی در دو هفته اخیر 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. تجاری ها در این هفته تمایل بیشتری به افزایش قراردادهای فروش خود داشتند ولی بخشی از قراردادهای خرید خود را تسویه نمودند.

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 بیست و یکمین 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>