



نشریه هفتگی

گزارش تعهد معامله گران

به زبان فارسی به همراه تفسیر

COT - Commitments of Traders

❖ تاریخ انتشار: یکشنبه ۱۹ فروردین ۱۴۰۳

❖ سال دوم / شماره ۲۴

❖ صاحب امتیاز: انتشارات ایسن

❖ قیمت: ~~۳۹,۰۰۰ تومان / ۱\$~~ رایگان



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: 2 آوریل 24 - 14 فروردین 03

تاریخ انتشار: 5 آوریل 24 - 17 فروردین 03

دلار کانادا (CAD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفا مربوط به معاملات آتی است

کد - 090741

[بازگشت به فهرست](#)

ارزش قراردادهای باز: 14,535,917,549 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 197,171				اندازه قراردادهای 100,000 دلار کانادا				
29,006	27,748	168,165	169,423	67,826	120,307	4,896	95,443	44,220
تغییرات در قراردادهای باز: +6,176				تغییرات				
-2,649	+280	+8,825	+5,896	+1,103	-893	+484	+7,238	+6,305
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
14.7%	14.1%	85.3%	85.9%	34.4%	61.0%	2.5%	48.4%	22.4%
تعداد کل معامله گران: 115				تعداد معامله گران در هر دسته				
		77	64	36	35	13	35	22

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 51,223 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 933 قرارداد افزایش فروش بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.77 و نسبت به کل 0.42 است.
- قراردادهای باز با 6,176 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 2,929 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای دلار کانادا رقم خورده است.

- چکیده این هفته: همانطور که در گزارش های منتشر شده در ایام نوروز مشاهده کردید، تجاری ها تعداد زیادی از قراردادهای خود را تسویه کردند که منجر به افزایش سهم غیرتجاری ها از بازار شد، اما غیر تجاری ها روال ماه های اخیر خود را تغییر ندادند و همچنان به تعداد قراردادهای فروش 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 صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 092741

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 11,995,306,975 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 87,108				اندازه قراردادهای 125,000 فرانک سوئیس					
25,995	9,682	61,113	77,426	17,461	56,144	62	43,590	21,220	
تغییرات در قراردادهای باز: +6,648				تغییرات					
+1,031	+204	+5,617	+6,444	+286	+1,515	+32	+5,299	+4,897	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
29.8%	11.1%	70.2%	88.9%	20.0%	64.5%	0.1%	50.0%	24.4%	
تعداد کل معامله گران: 65				تعداد معامله گران در هر دسته					
		37	36	17	20	3	19	14	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 7٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 22,370 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 402 قرارداد افزایش فروش بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.88 و نسبت به کل 0.46 است .
- قراردادهای باز با 6,648 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 827 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای فرانک سوئیس رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در ماه های اخیر در حال افزایش در قراردادهای خرید و فروش خود بودند، البته لازم به ذکر است که قراردادهای فروش آنها بصورت مداوم و محسوس افزایش پیدا کرده و اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش آنها از حدود 3 هزار به 22 هزار قرارداد به سمت فروش در سه ماه اخیر رسیده است. همچنین در سه هفته اخیر سهم آنها از بازار هم رشد چشمگیری داشته هم به علت افزایش در قراردادها هم به علت تسویه ای که دو هفته پیش در قراردادهای تجاری ها رخ داد.

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: 17,224,356,915 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 219,176				اندازه قراردادهای پوند انگلیس 62,500					
29,120	25,106	190,056	194,070	129,546	90,146	5,572	54,938	98,352	
تغییرات در قراردادهای باز: +16,067				تغییرات					
+1,809	-4,120	+14,258	+20,187	+14,302	+11,987	+1,109	-1,153	+7,091	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
13.3%	11.5%	86.7%	88.5%	59.1%	41.1%	2.5%	25.1%	44.9%	
تعداد کل معامله گران: 130				تعداد معامله گران در هر دسته					
		92	67	53	29	18	26	31	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 7٪ افزایش داشت.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 43,414 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 8,244 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.72 و نسبت به کل 0.41 است.
- قراردادهای باز با 16,067 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل نیز در این هفته 5,929 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای پوند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها که در سه ماه اخیر مشغول افزایش قراردادهای خرید بودند در دو هفته گذشته حدود 32 هزار قرارداد خرید خود را تسویه کردند اما از این هفته دو مرتبه شروع به افزایش در قراردادهای خرید نمودند.

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: 26,134,181,350 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 316,809				اندازه قراردادهای ین ژاپن 12,500,000				
46,740	50,476	270,069	266,333	65,701	205,195	5,948	198,420	55,190
تغییرات در قراردادهای باز: +11,108				تغییرات				
+609	+4,827	+10,499	+6,281	+1,244	+11,150	-90	+9,345	-4,779
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
14.8%	15.9%	85.2%	84.1%	20.7%	64.8%	1.9%	62.6%	17.4%
تعداد کل معامله گران: 166				تعداد معامله گران در هر دسته				
		104	88	40	54	12	59	27

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 143,230 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 14,124 قرارداد افزایش فروش بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.95 و نسبت به کل 0.48 است.
- قراردادهای باز با 11,108 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 4,218 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای ین رقم خورد.
- چکیده این هفته: سهم غیرتجاری ها از بازار از دو هفته قبل که تجاری ها بخشی از قراردادهای خرید و فروش خود را تسویه کردند افزایش داشته و بعد از دو هفته تسویه در قراردادهای فروش دو مرتبه افزایش در قراردادهای فروش را در سه هفته اخیر از پیش گرفته اند.

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: 91,909,107,400 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 682,768				اندازه قراردادهای 125,000 یورو				
56,929	73,567	625,839	609,201	445,912	412,480	8,463	171,464	188,258
تغییرات در قراردادهای باز: +25,468				تغییرات				
+3,460	-2,880	+22,008	+28,348	+2,409	+23,149	-2,866	+22,465	+8,065
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
8.3%	10.8%	91.7%	89.2%	65.3%	60.4%	1.2%	25.1%	27.6%
تعداد کل معامله گران: 306				تعداد معامله گران در هر دسته				
		178	207	96	116	29	63	81

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 16,794 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 14,400 قرارداد افزایش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.42 و نسبت به کل 0.29 است.
- قراردادهای باز با 25,468 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 6,340 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای یورو رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها بعد از چهار هفته متوالی که مشغول تسویه قراردادهای فروش خود بودند در سه هفته اخیر شروع به افزایش قراردادهای فروش خود نمودند و بالانس قراردادهای خرید و فروش این گروه در این مدت به شکل محسوسی به سمت فروش تمایل پیدا کرده است. همچنین سهم این گروه از بازار هم به علت افزایش در قراردادها هم به علت تسویه بخشی از قراردادهای گروه تجاری در هفته اول فروردین افزایش یافته است.

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: 14,651,169,418 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 224,894				اندازه قراردادهای 100,000 دلار استرالیا				
31,822	20,421	193,072	204,473	50,704	164,790	5,126	137,242	34,557
تغییرات در قراردادهای باز: +5,912				تغییرات				
+1,948	+2,635	+3,964	+3,277	+6,165	+2,711	+447	-2,648	+119
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
14.1%	9.1%	85.9%	90.9%	22.5%	73.3%	2.3%	61.0%	15.4%
تعداد کل معامله گران: 101				تعداد معامله گران در هر دسته				
		63	63	28	35	11	28	24

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 2.5٪ افزایش است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 102,685 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 2,767 قرارداد کاهش فروش بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.82 و نسبت به کل 0.44 است.
- قراردادهای باز با 5,912 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 687 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای دلار استرالیا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: دلار استرالیا هفته کم تلاطمی را سپری کرده است و تغییرات خاصی را شاهد نیستیم فقط کمی از سهم بازار غیرتجاری ها در سه هفته اخیر کم شده که بابت تسویه قراردادهای فروش بوده ولی در تمایلات آنها تغییری به وجود نیامده است.

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: 3,683,671,904 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 61,732				اندازه قراردادهای 100,000 دلار نیوزلند					
6,550	3,383	55,182	58,349	27,726	38,421	203	27,253	19,725	
تغییرات در قراردادهای باز: +8,316				تغییرات					
+1,076	-384	+7,240	+8,700	+873	+3,837	-182	+6,549	+5,045	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
10.6%	5.5%	89.4%	94.5%	44.9%	62.2%	0.3%	44.1%	32.0%	
تعداد کل معامله گران: 103				تعداد معامله گران در هر دسته					
		65	49	26	23	5	36	24	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 13٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 7,528 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 1,504 قرارداد کاهش خرید بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.71 و نسبت به کل 0.41 است.
- قراردادهای باز با 8,316 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,460 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای دلار نیوزلند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: روند افزایشی در سرمایه گذاری روی دلار نیوزلند در ماه اخیر مشهود است و تمایل غیرتجاری ها در این هفته ها بر افزایش قراردادهای فروش بوده است. این هفته آنها هم بر تعداد قراردادهای خرید اضافه نمودند هم فروش ولی همانطور که اشاره شد سهم قراردادهای فروش بیشتر بود و در مجموع نیز سهم این گروه از بازار افزایش داشته است.

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: 18,316,004,224 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 93,520				اندازه قراردادهای \$5 * شاخص داوجونز					
11,161	14,377	82,359	79,143	65,712	45,901	1,136	15,511	32,106	
تغییرات در قراردادهای باز: +779				تغییرات					
+785	-227	-6	+1,006	-3,215	+1,214	-78	+3,287	-130	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
11.9%	15.4%	88.1%	84.6%	70.3%	49.1%	1.2%	16.6%	34.3%	
تعداد کل معامله گران: 92				تعداد معامله گران در هر دسته					
		56	58	25	28	12	23	26	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته تقریباً بدون تغییر باقی مانده است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 16,595 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 3,417 قرارداد افزایش فروش بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.43 و نسبت به کل 0.30 است.
- قراردادهای باز با 779 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,012 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای شاخص داوجونز رقم خورده است.
- چکیده این هفته: در هفته اول فروردین تجاری ها بخشی از قراردادهای خرید و فروش خود بالاحص قراردادهای خرید را تسویه نمودند که باعث افزایش سهم غیرتجاری ها از بازار شد. همچنین روند کاهشی سرمایه گذاری در شاخص داوجونز در این هفته ها به چشم میخورد. غیرتجاری ها در این هفته بر خلاف سه هفته قبل رو به افزایش قراردادهای فروش آوردند.

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: 86,601,550,007 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری				
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید		
قراردادهای باز: 266,623				اندازه قراردادهای \$20 * شاخص نزدک						
37,700	46,290	228,923	220,333	151,423	149,656	6,394	71,106	64,284		
تغییرات در قراردادهای باز: +6,049				تغییرات						
+2,299	+2,199	+3,750	+3,850	+2,187	+1,840	+2,612	-1,049	-602		
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران										
14.1%	17.4%	85.9%	82.6%	56.8%	56.1%	2.4%	26.7%	24.1%		
تعداد کل معامله گران: 314				تعداد معامله گران در هر دسته						
		183	210	100	116	35	68	73		

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 2٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 6,822 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 447 قرارداد کاهش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.47 و نسبت به کل 0.31 است.
- قراردادهای باز با 6,049 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش چشمگیری داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 100 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای شاخص نزدک رقم خورده است.
- چکیده این هفته: در هفته اول فروردین شاهد تسویه معاملات در تمام گروه ها بودیم بطوریکه ارزش قراردادهای باز حدود 40٪ ریزش داشت و منجر به کاهش سرمایه گذاری در شاخص نزدک شد. همچنین تمایل غیرتجاری منعطف به افزایش در قراردادهای فروش شده است.

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: 438,469,500,000 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 4,384,695				اندازه قراردادهای 100,000 دلار امریکا ارزش اسمی				
398,788	429,927	3,985,907	3,954,768	2,863,361	3,402,179	107,578	1,014,968	445,011
تغییرات در قراردادهای باز: +55,774				تغییرات				
+21,953	+14,959	+33,821	+40,815	+7,931	+6,575	+2,255	+23,635	+31,985
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
9.1%	9.8%	90.9%	90.2%	65.3%	77.6%	2.5%	23.1%	10.1%
تعداد کل معامله گران: 403				تعداد معامله گران در هر دسته				
		279	274	186	194	35	76	62

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 1٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 569,957 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 8,350 قرارداد افزایش خرید بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.25 و نسبت به کل 0.19 است.
- قراردادهای باز با 55,774 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 6,994 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای این نماد رقم خورده است.
- چکیده این هفته: تمایل غیرتجاری ها در هفته های اخیر مبنی بر کاهش قراردادهای فروش و افزایش قراردادهای خرید بود اما در کل در اوراق قرضه 10 ساله ماه پیش ماه کم تلاطمی بوده و تغییرات خاصی ایجاد نشده و سهم گروه ها نیز در طی ماه گذشته تقریباً ثابت بوده است.

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: 3,984,013,050 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 38,130				اندازه قراردادهای 1,000 دلار امریکا * شاخص دلار					
2,543	4,744	35,587	33,386	8,751	8,446	1,259	25,577	23,681	
تغییرات در قراردادهای باز: +6,133				تغییرات					
+419	+981	+5,714	+5,152	+311	+1,016	-331	+5,734	+4,467	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
6.7%	12.4%	93.3%	87.6%	23.0%	22.2%	3.3%	67.1%	62.1%	
تعداد کل معامله گران: 105				تعداد معامله گران در هر دسته					
		38	70	4	7	2	32	63	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته در حدود 16.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 1,896 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 1,267 قرارداد افزایش فروش بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 2.93 و نسبت به کل 0.73 است.
- قراردادهای باز با 6,133 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 562 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای شاخص دلار رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در ماه اخیر مشغول افزایش در قراردادهای فروش خود بوده اند ولی سهم آنها از بازار تغییر خاصی نداشته و در یک محدوده کم در حال تغییر بوده است. همچنین روند تغییر در قراردادهای باز نشان می دهد که در ماه اخیر شاهد افزایش سرمایه گذاری در شاخص دلار هستیم.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: دلار آمریکا - 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: 9,757,847,250 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 29,745				اندازه قراردادهای 5 بیتکوین				
771	1,619	28,974	28,126	2,521	1,513	2,302	24,151	24,311
تغییرات در قراردادهای باز: -1,493				تغییرات				
-86	-204	-1,407	-1,289	+1,096	-21	-362	-2,141	-906
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
2.6%	5.4%	97.4%	94.6%	8.5%	5.1%	7.7%	81.2%	81.7%
تعداد کل معامله گران: 126				تعداد معامله گران در هر دسته				
		73	83	8	4	29	50	65

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 12٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 160 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 1,235 قرارداد کاهش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 12.54 و نسبت به کل 0.89 است.
- قراردادهای باز با 1,493 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 118 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای بیتکوین رقم خورده است.
- چکیده این هفته: تمایل غیرتجاری ها در هفته های اخیر به سمت افزایش در قراردادهای خرید و کاهش در قراردادهای فروش بوده است. البته این تغییر تمایل بیشتر با تسویه قراردادها همراه بوده یعنی سهم آنها از بازار کاسته شده است. همچنین در دو هفته اخیر شاهد کاهش سرمایه گذاری در بیتکوین بوده ایم.

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

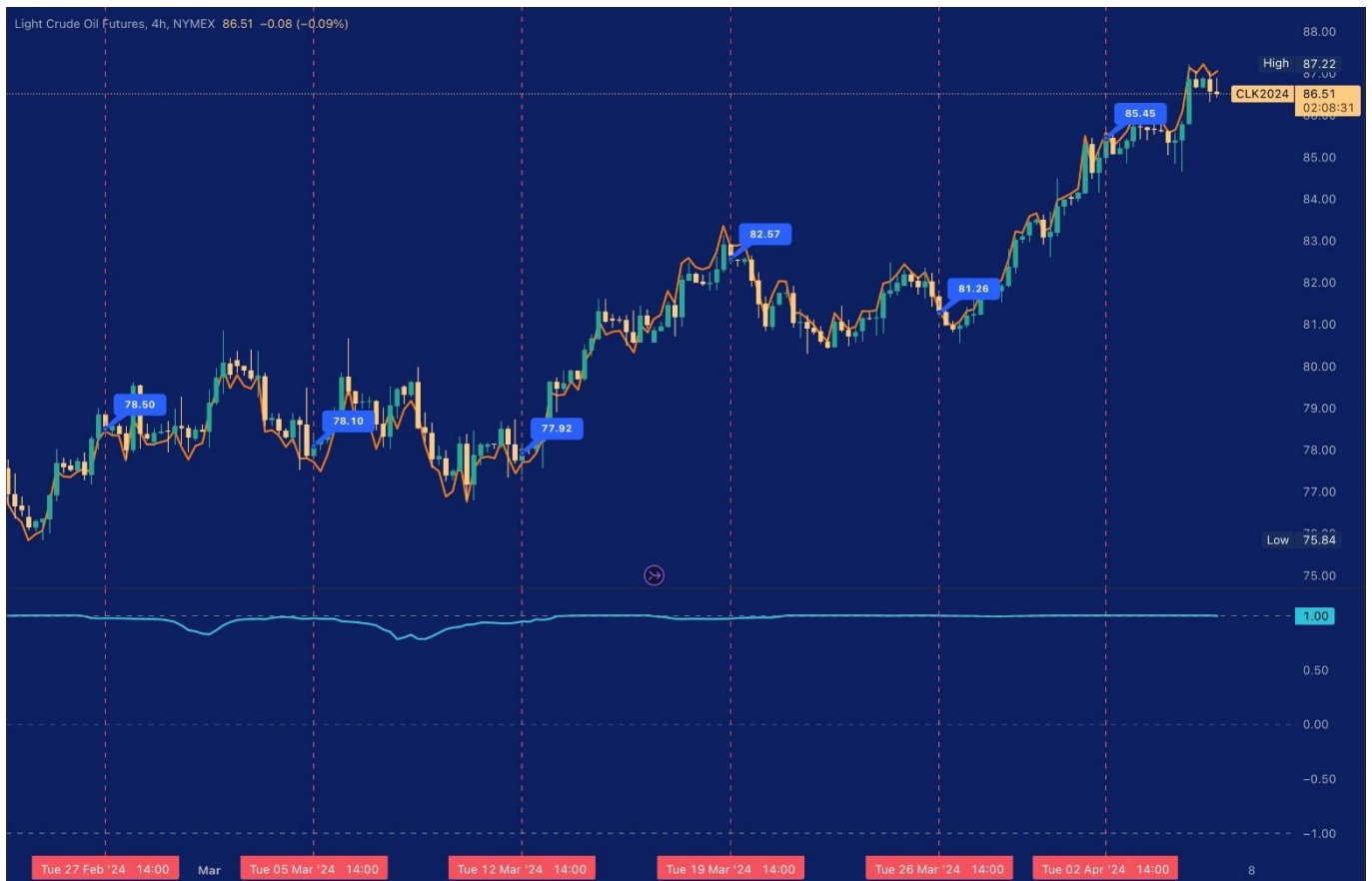
ارزش قراردادهای باز: 12,387,268,530 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 145,033				اندازه قراردادهای 1,000 بشکه				
34,445	22,773	110,588	122,260	83,086	59,646	4,579	22,923	58,035
تغییرات در قراردادهای باز: -19,199				تغییرات				
-2,433	-119	-16,766	-19,080	-6,457	-9,139	-8,787	-1,522	-1,154
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
23.7%	15.7%	76.3%	84.3%	57.3%	41.1%	3.2%	15.8%	40.0%
تعداد کل معامله گران: 44				تعداد معامله گران در هر دسته				
		36	32	27	25	6	5	5

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 8٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 35,112 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 368 قرارداد کاهش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.60 و نسبت به کل 0.36 است.
- قراردادهای باز با 19,199 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 2,314 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای نفت رقم خورده است.
- چکیده این هفته: روند افزایش سرمایه گذاری در نفت که در هفته های اخیر به وجود آمده بود در این هفته با کاهش 20 هزار قراردادی متوقف شد. تسویه قراردادها هم مربوط به تمام گروه ها بود. اما تغییر خاصی در را بالانس بازار شاهد نیستیم و سهم هر گروه از بازار تقریباً ثابت مانده است.
- در هفته ای که گذشت نیز جلسه اوپک و کمیته بازار مشترک نظارتی را از پیش رو گذرانیم که می توانید از طریق رسانه ها از تصمیمات آنها آگاه شوید و آنها را با تغییر در تمایلات بازیگران بازار آتی مطابقت دهید.

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: 114,021,761,035 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 500,045				اندازه قراردادهای 100 اونس تروی				
30,467	48,931	469,578	451,114	352,828	127,114	42,601	74,149	281,399
تغییرات در قراردادهای باز: -3,597				تغییرات				
+1,509	+927	-5,106	-4,524	-7,286	-14,660	-5,616	+7,796	+15,752
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
6.1%	9.8%	93.9%	90.2%	70.6%	25.4%	8.5%	14.8%	56.3%
تعداد کل معامله گران: 348				تعداد معامله گران در هر دسته				
		188	271	61	44	79	84	188

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 4٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 207,250 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 7,956 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.83 و نسبت به کل 0.43 است.
- قراردادهای باز با 3,597 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 582 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای طلا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: هفته قبل تسویه قراردادهای برای گروه غیرتجاری بود و این هفته تجاری ها بخشی از معاملات خود را تسویه کردند که در مجموع حدود 35 هزار کاهش در قراردادهای را شاهد بودیم. هفته قبل با تسویه ای که غیرتجاری ها داشتند سهمشان از بازار کاسته شده بود ولی این هفته با افزایشی که در قراردادهای خود داشتند بالاخص قراردادهای خرید و تسویه ای که تجاری ها داشتند سهمشان دو مرتبه افزایش یافت. روند تغییرات غیرتجاری ها همچنان نشان می دهد که این گروه سعی در افزایش هر چه بیشتر قراردادهای خرید خود دارند.

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: 21,780,911,349 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 166,823				اندازه قراردادهای 5,000 اونس تروی				
15,216	29,775	151,607	137,048	110,644	42,938	10,545	30,418	83,565
تغییرات در قراردادهای باز: +6,496				تغییرات				
+1,095	+1,413	+5,401	+5,083	+3,317	+688	+1,551	+533	+2,844
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
9.1%	17.8%	90.9%	82.2%	66.3%	25.7%	6.3%	18.2%	50.1%
تعداد کل معامله گران: 230				تعداد معامله گران در هر دسته				
		126	173	48	30	48	45	122

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 10٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 53,147 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 2,311 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.81 و نسبت به کل 0.43 است.
- قراردادهای باز با 6,496 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 318 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای نقره رقم خورده است.
- چکیده این هفته: در ماه اخیر شاهد افزایش سرمایه گذاری در نقره بودیم و در این افزایش سرمایه گذاری نقش غیرتجاری ها در افزایش قراردادهای خرید بوده است. این روند در 4 هفته اخیر کاملاً مشهود است و باعث افزایش سهم این گروه از بازار هم شده است. این روند افزایش در قراردادها در گروه تجاری هم مشاهده می شود ولی تمرکز آنها بیشتر معطوف به افزایش قراردادهای فروش بوده 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 معامله‌گران 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 چهارمین نسخه آموزشی - تحلیلی گزارش تعهد معامله‌گران 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 معامله‌گران (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 معامله‌گران بازار فیوچرز یا آتی از جمله معامله‌گران 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 معامله‌گران 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 معامله‌گران 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>