



نشریه هفتگی

گزارش تعهد معامله گران

به زبان فارسی به همراه تفسیر

COT - Commitments of Traders

❖ تاریخ انتشار: یکشنبه ۲۶ فروردین ۱۴۰۳

❖ سال دوم / شماره ۲۵

❖ 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: 9 آوریل 24 - 21 فروردین 03

تاریخ انتشار: 12 آوریل 24 - 24 فروردین 03

دلار کانادا (CAD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفا مربوط به معاملات آتی است

کد - 090741

[بازگشت به فهرست](#)

ارزش قراردادهای باز: 14,227,026,071 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 192,964				اندازه قراردادهای 100,000 دلار کانادا				
32,145	27,190	160,819	165,774	69,604	127,944	3,089	88,126	34,741
تغییرات در قراردادهای باز: -4,207				تغییرات				
+3,139	-558	-7,346	-3,649	+1,778	+7,637	-1,807	-7,317	-9,479
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
16.7%	14.1%	83.3%	85.9%	36.1%	66.3%	1.6%	45.7%	18.0%
تعداد کل معامله گران: 114				تعداد معامله گران در هر دسته				
		82	59	39	36	12	38	16

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 2٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 53,385 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 2,162 قرارداد کاهش خرید بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.64 و نسبت به کل 0.38 است.
- قراردادهای باز با 4,207 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 3,697 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای دلار کانادا رقم خورده است.

- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در این هفته بخشی از قراردادهای خرید و فروش خود را تسویه نمودند که سهم تسویه قراردادهای خرید دو هزار قرارداد بیشتر بود. همچنین این تصمیم باعث کاهش سهم آنها از بازار شد و منطبق با روند ماه گذشته آنها بود. تجاری ها اما در این هفته خریدار دلار کانادا بودند.

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: 12,569,327,592 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 90,833				اندازه قراردادهای 125,000 فرانک سوئیس				
25,854	9,535	64,979	81,298	16,582	64,665	7	48,390	16,626
تغییرات در قراردادهای باز: +3,725				تغییرات				
-141	-147	+3,866	+3,872	-879	+8,521	-55	+4,800	-4,594
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
28.5%	10.5%	71.5%	89.5%	18.3%	71.2%	0.0%	53.3%	18.3%
تعداد کل معامله گران: 65				تعداد معامله گران در هر دسته				
		39	33	17	19	2	22	12

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 4.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 31,764 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 9,394 قرارداد افزایش فروش بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.80 و نسبت به کل 0.44 است .
- قراردادهای باز با 3,725 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 6 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای فرانک سوئیس رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها همچنان به روال ماه های اخیر ادامه دادند و از قراردادهای خرید خود کسر و به قراردادهای فروش خود افزودند. البته در این هفته سهم آنها به علت اینکه بخشی از قراردادهای خرید خود را تسویه نمودند و تجاری ها نیز به قراردادهای خود افزودند به مقدار کمی کاهش یافت. در کل روند سرمایه گذاری در فرانک سوئیس در ماه های اخیر افزایشی بوده است.

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: 16,738,341,028 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 211,286				اندازه قراردادهای پوند انگلیس 62,500				
29,011	27,814	182,275	183,472	123,251	96,196	7,276	51,748	80,000
تغییرات در قراردادهای باز: -7,890				تغییرات				
-109	+2,708	-7,781	-10,598	-6,295	+6,050	+1,704	-3,190	-18,352
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
13.7%	13.2%	86.3%	86.8%	58.3%	45.5%	3.4%	24.5%	37.9%
تعداد کل معامله گران: 120				تعداد معامله گران در هر دسته				
		85	59	51	30	13	25	24

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3٪ کاهش داشت.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 28,252 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 15,162 قرارداد کاهش خرید بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.63 و نسبت به کل 0.38 است.
- قراردادهای باز با 7,890 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل نیز در این هفته 2,817 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای پوند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در سه ماه اخیر مشغول خرید پوند بودند اما در ماه گذشته شروع به تسویه قراردادهای خرید خود نمودند بطوریکه اختلاف قراردادهای خرید و فروش آنها از مقدار 70,451 در 12 مارس به 28,252 در 9 آوریل کاهش پیدا کرد. سهم این گروه نیز از بازار رو به کاهش است. در کل روند سرمایه گذاری در پوند نیز در بازار فیوچر متوقف 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: 26,736,193,508 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 324,479				اندازه قراردادهای ین ژاپن 12,500,000				
45,732	50,941	278,747	273,538	62,314	219,256	7,007	209,426	47,275
تغییرات در قراردادهای باز: +7,670				تغییرات				
-1,008	+465	+8,678	+7,205	-3,387	+14,061	+1,059	+11,006	-7,915
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
14.1%	15.7%	85.9%	84.3%	19.2%	67.6%	2.2%	64.5%	14.6%
تعداد کل معامله گران: 164				تعداد معامله گران در هر دسته				
		103	91	39	56	13	59	27

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 2.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 162,151 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 18,921 قرارداد افزایش فروش بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.93 و نسبت به کل 0.47 است.
- قراردادهای باز با 7,670 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,473 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای ین رقم خورد.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در این هفته هم بخشی از قراردادهای خرید خود را تسویه و به قراردادهای فروش خود افزودند که این روند در ماه های اخیر به همین شکل بوده و که شاهد تمایل به فروش ین توسط آنها هستیم. اما بر خلاف آنها در گروه تجاری شاهد افزایش در قراردادهای خرید هستیم. همچنین روند سرمایه گذاری در ین در سه ماه اخیر افزایشی بوده است.

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: 87,322,407,200 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 643,496				اندازه قراردادهای 125,000 یورو				
55,740	75,049	587,756	568,447	435,146	383,114	9,914	142,696	175,419
تغییرات در قراردادهای باز: -39,272				تغییرات				
-1,189	+1,482	-38,083	-40,754	-10,766	-29,366	+1,451	-28,768	-12,839
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
8.7%	11.7%	91.3%	88.3%	67.6%	59.5%	1.5%	22.2%	27.3%
تعداد کل معامله گران: 289				تعداد معامله گران در هر دسته				
		168	201	92	113	31	58	75

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 5٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 32,723 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 15,929 قرارداد کاهش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.40 و نسبت به کل 0.28 است.
- قراردادهای باز با 39,272 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 2,671 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای یورو رقم خورده است.
- چکیده این هفته: این هفته، هفته تسویه قراردادها برای تمام گروه ها بود. حاصل این تسویه برای غیرتجاری ها کاهش 16 هزار قرارداد فروش بیشتر نسبت به خرید بود ولی در گروه تجاری 19 هزار قرارداد خرید بیشتر مورد تسویه قرار گرفت. در کل در سه ماه اخیر با تسویه حدود 90 هزار قرارداد شاهد کاهش سرمایه گذاری در یورو هستیم.

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

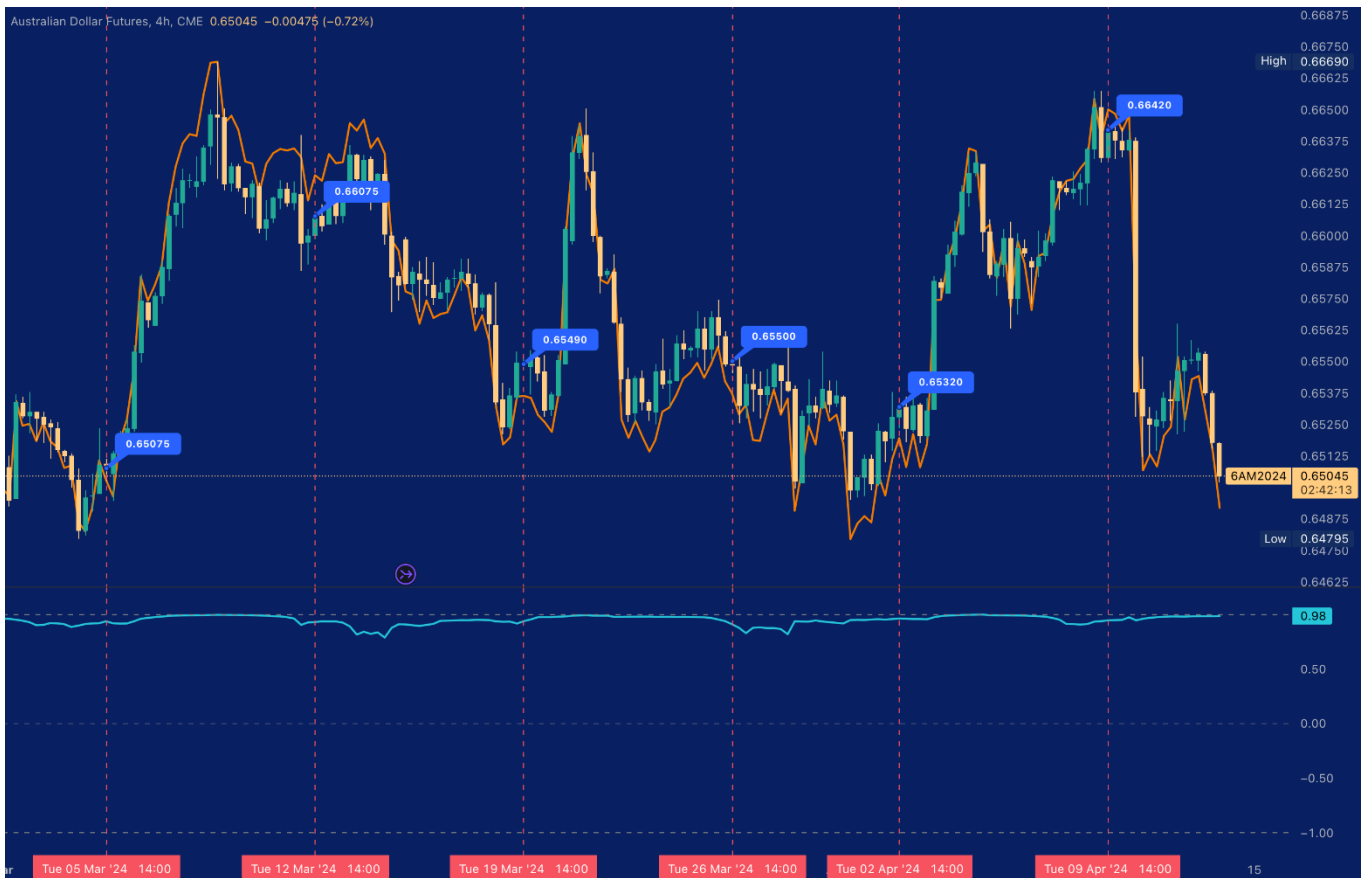
ارزش قراردادهای باز: 13,835,456,484 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری				
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید		
قراردادهای باز: 208,938				اندازه قراردادهای 100,000 دلار استرالیا						
30,836	21,567	178,102	187,371	49,811	151,421	5,394	122,897	30,556		
تغییرات در قراردادهای باز: -15,956				تغییرات						
-986	+1,146	-14,970	-17,102	-893	-13,369	+268	-14,345	-4,001		
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران										
14.8%	10.3%	85.2%	89.7%	23.8%	72.5%	2.6%	58.8%	14.6%		
تعداد کل معامله گران: 99				تعداد معامله گران در هر دسته						
		67	57	26	28	15	32	22		

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 6٪ کاهش است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 92,341 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 10,344 قرارداد کاهش فروش بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.79 و نسبت به کل 0.43 است.
- قراردادهای باز با 15,956 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 2,132 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای دلار استرالیا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: در این هفته برای دلار استرالیا هم شاهد تسویه قراردادهای توسط تمام گروه ها بودیم که در غیرتجاری ها سهم تسویه قراردادهای فروش بیشتر بود و در تجاری ها سهم تسویه قراردادهای خرید بیشتر بود. با این تصمیمات سهم غیرتجاری ها از بازار کاسته شد و کمی هم از روند سرمایه گذاری در این نماد کاسته شد.

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: 3,408,455,840 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 56,260				اندازه قراردادهای 100,000 دلار نیوزلند					
5,554	2,862	50,706	53,398	23,276	39,515	157	27,273	13,726	
تغییرات در قراردادهای باز: -5,472				تغییرات					
-996	-521	-4,476	-4,951	-4,450	+1,094	-46	+20	-5,999	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
9.9%	5.1%	90.1%	94.9%	41.4%	70.2%	0.3%	48.5%	24.4%	
تعداد کل معامله گران: 96				تعداد معامله گران در هر دسته					
		58	50	24	25	5	33	21	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 8٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 13,547 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 6,019 قرارداد کاهش خرید بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.65 و نسبت به کل 0.39 است.
- قراردادهای باز با 5,472 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 475 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای دلار نیوزلند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در این هفته بخشی از قراردادهای خرید خود را تسویه نمودند که در راستا تمایل آنها که فروش دلار نیوزلند است می باشد. تجار یها اما برخلاف غیرتجاری ها بخشی از قراردادهای فروش خود را تسویه و بر قراردادهای خرید خود افزودند. این تصمیمات باعث کاهش اندکی از سهم غیرتجاری ها از بازار 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: 17,980,276,860 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری				
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید		
قراردادهای باز: 92,484				اندازه قراردادهای \$5 * شاخص داوجونز						
12,797	14,234	79,687	78,250	65,690	47,292	2,099	11,898	28,859		
تغییرات در قراردادهای باز: -1,036				تغییرات						
+1,636	-143	-2,672	-893	-22	+1,391	+963	-3,613	-3,247		
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران										
13.8%	15.4%	86.2%	84.6%	71.0%	51.1%	2.3%	12.9%	31.2%		
تعداد کل معامله گران: 92				تعداد معامله گران در هر دسته						
		53	60	27	28	12	18	28		

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 2٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 16,961 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 0.38 و نسبت به کل 0.27 است.
- قراردادهای باز با 1,036 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,779 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای شاخص داوجونز رقم خورده است.
- چکیده این هفته: روند کاهش سرمایه گذاری در داوجونز این هفته هم به چشم می خورد. غیرتجاری ها بدون تغییر در تمایل و روند قبلی خود تقریباً به یک میزان از قراردادهای خرید و فروش خود کاستند و سهم شان از بازار کاهش پیدا کرد. همچنین تجاری ها در این هفته تمایل به خرید داشتند. البته تمام این اتفاقات خیلی چشمگیر نبودند و داوجونز هفته کم تلاطمی را پشت سر گذاشت.

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

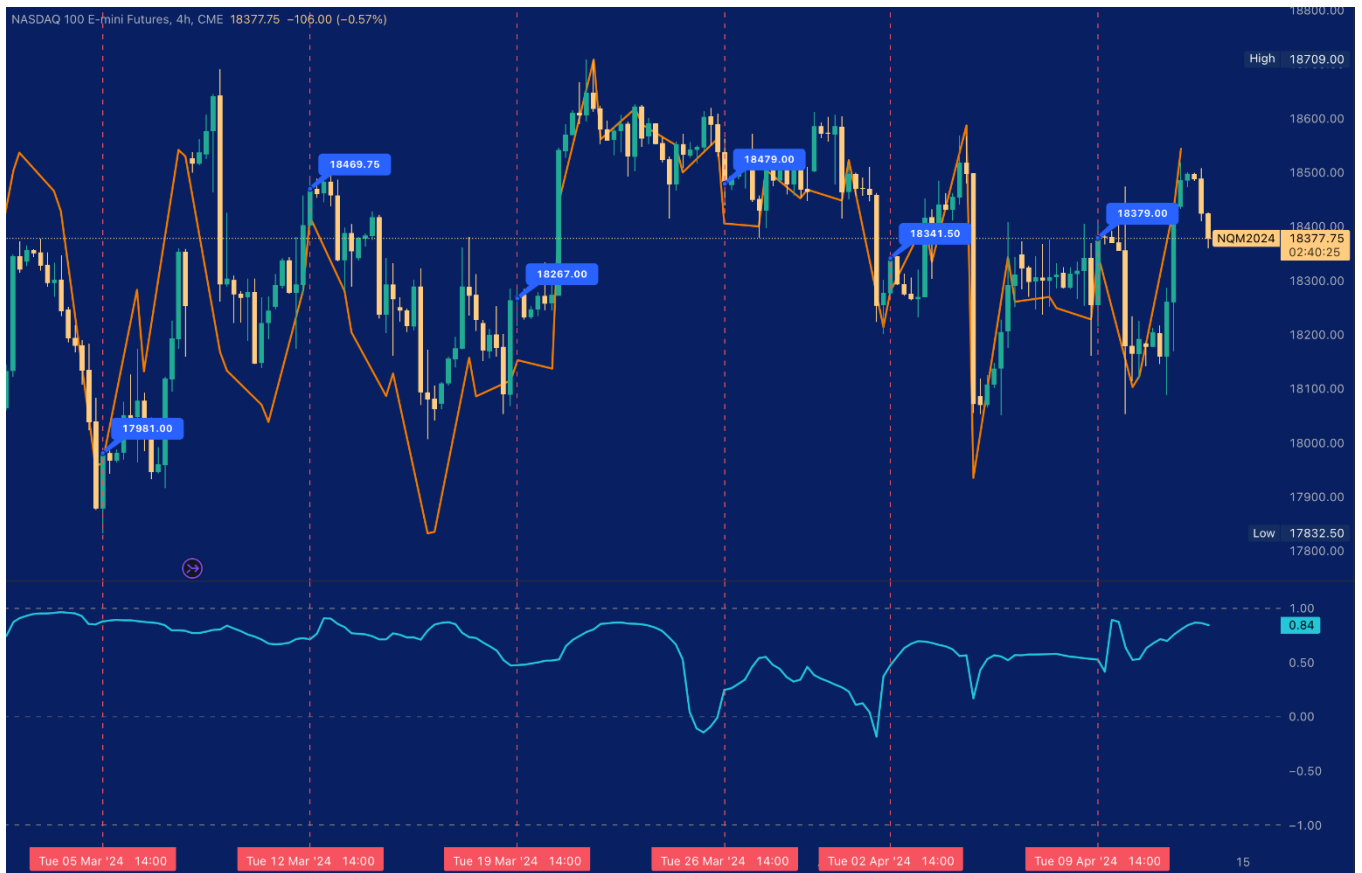
ارزش قراردادهای باز: 87,081,866,880 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 267,024				اندازه قراردادهای \$20 * شاخص نزدک					
39,412	46,404	227,612	220,620	162,419	147,614	6,826	58,367	66,179	
تغییرات در قراردادهای باز: +401				تغییرات					
+1,712	+114	-1,311	+287	+10,996	-2,041	+433	-12,739	+1,895	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
14.8%	17.4%	85.2%	82.6%	60.8%	55.3%	2.6%	21.9%	24.8%	
تعداد کل معامله گران: 318				تعداد معامله گران در هر دسته					
		184	209	102	112	36	62	79	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته کمتر از 1٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 7,812 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 14,634 قرارداد کاهش 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 401 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,598 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای شاخص نزدک رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در این هفته بخشی از قراردادهای فروش خود را تسویه نمودند و تجاری ها هم خریدار معاملات فروش آنها بودند در نتیجه سهم غیرتجاری ها از بازار کمی کاسته شد. در این هفته در روند کلی نزدک تغییر خاصی را مشاهده نکردیم و این نماد هفته کم تلاطمی را پشت سر گذاشت.

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: 436,151,300,000 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 4,361,513				اندازه قراردادهای 100,000 دلار امریکا ارزش اسمی				
400,130	407,654	3,961,383	3,953,859	2,863,371	3,362,732	96,217	1,001,795	494,910
تغییرات در قراردادهای باز: -23,182				تغییرات				
+1,342	-22,273	-24,524	-909	+10	-39,447	-11,361	-13,173	+49,899
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
9.2%	9.3%	90.8%	90.7%	65.7%	77.1%	2.2%	23.0%	11.3%
تعداد کل معامله گران: 414				تعداد معامله گران در هر دسته				
		297	271	198	196	36	85	53

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته کمتر از 1٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 506,885 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 63,072 قرارداد افزایش خرید بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.25 و نسبت به کل 0.20 است.
- قراردادهای باز با 23,182 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 23,615 قرارداد کاهش فروش 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: 4,200,524,800 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 40,448				اندازه قراردادهای 1,000 دلار امریکا * شاخص دلار					
2,045	3,617	38,403	36,831	9,624	9,194	904	27,875	26,733	
تغییرات در قراردادهای باز: +2,318				تغییرات					
-498	-1,127	+2,816	+3,445	+873	+748	-355	+2,298	+3,052	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
5.1%	8.9%	94.9%	91.1%	23.8%	22.7%	2.2%	68.9%	66.1%	
تعداد کل معامله گران: 110				تعداد معامله گران در هر دسته					
		36	78	4	10	2	30	68	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته در حدود 5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 1,142 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 754 قرارداد افزایش خرید بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 2.95 و نسبت به کل 0.73 است.
- قراردادهای باز با 2,318 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 629 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای شاخص دلار رقم خورده است.
- چکیده این هفته: تمام گروه‌ها در این هفته مشغول افزایش متوازن در قراردادهای خرید و فروش خود بودند البته غیرتجاری‌ها کمی بیشتر به افزایش قراردادهای خرید تمایل داشتند ولی در کل تغییر خاصی را شاهد نبودیم به غیر از تداوم افزایش سرمایه‌گذاری در شاخص دلار که در مدت سه ماه اخیر ادامه دار بوده است.

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: 10,048,119,770 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 29,074				اندازه قراردادهای 5 بیتکوین				
708	1,699	28,366	27,375	2,382	1,544	2,259	23,725	23,572
تغییرات در قراردادهای باز: -671				تغییرات				
-63	+80	-608	-751	-139	+31	-43	-426	-739
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
2.4%	5.8%	97.6%	94.2%	8.2%	5.3%	7.8%	81.6%	81.1%
تعداد کل معامله گران: 126				تعداد معامله گران در هر دسته				
		76	82	8	4	31	52	62

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 153 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 313 قرارداد کاهش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 12.63 و نسبت به کل 0.89 است.
- قراردادهای باز با 671 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 143 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای بیتکوین رقم خورده است.
- چکیده این هفته: همانطور که مشاهده می کنید بیتکوین هم در این هفته شاهد تغییرات خاصی نیست. غیرتجاری ها در این هفته بخشی از قراردادهای خرید و فروش خود را تسویه نمودند که سهم تسویه قراردادهای خرید بیشتر بود، همچنین در سه 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: 13,668,642,600 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 160,242				اندازه قراردادهای 1,000 بشکه				
29,423	20,660	130,819	139,582	98,612	72,912	4,804	27,403	61,866
تغییرات در قراردادهای باز: +15,209				تغییرات				
-5,022	-2,113	+20,231	+17,322	+15,526	+13,266	+225	+4,480	+3,831
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
18.4%	12.9%	81.6%	87.1%	61.5%	45.5%	3.0%	17.1%	38.6%
تعداد کل معامله گران: 47				تعداد معامله گران در هر دسته				
		39	35	29	27	7	6	5

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 9٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 34,463 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 649 قرارداد افزایش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.55 و نسبت به کل 0.35 است.
- قراردادهای باز با 15,209 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 2,909 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای نفت رقم خورده است.
- چکیده این هفته: در هفته ای که گذشت تمام گروه ها مشغول افزایش در قراردادهای خرید و فروش خود بودند که به اتفاق سهم افزایش در قراردادهای فروش آنها بیشتر بوده است. همچنین تجاری ها قراردادهای بیشتری منعقد نمودند که باعث کاهش سهم غیرتجاری ها از بازار 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: 118,887,968,908 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 505,214				اندازه قراردادهای 100 اونس تروی				
29,396	51,559	475,818	453,655	352,676	128,094	45,762	77,380	279,799
تغییرات در قراردادهای باز: +5,169				تغییرات				
-1,071	+2,628	+6,240	+2,541	-152	+980	+3,161	+3,231	-1,600
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
5.8%	10.2%	94.2%	89.8%	69.8%	25.4%	9.1%	15.3%	55.4%
تعداد کل معامله گران: 335				تعداد معامله گران در هر دسته				
		191	258	62	46	81	80	177

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 4٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 202,419 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 4,831 قرارداد افزایش فروش 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 5,169 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 3,699 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای طلا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها بر خلاف روندی که در ماه های اخیر حاکم بود عمل نمودند و بخشی از قراردادهای خرید خود را تسویه و به قراردادهای فروش خود افزودند البته لازم به ذکر است که این مقادیر ناچیز هستند و نمی توانند گواهی بر تغییر تمایل آنها باشد. همچنین سهم آنها از بازار ثابت ماند. تجاری ها نیز در این هفته تغییرات خاصی نداشتند و بدین صورت طلا هفته کم تلاطمی را پشت سر گذاشت.

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: 24,546,377,750 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 174,397				اندازه قراردادهای 5,000 اونس تروی				
14,259	32,322	160,138	142,075	115,637	44,362	12,887	31,614	84,826
تغییرات در قراردادهای باز: +7,574				تغییرات				
-957	+2,547	+8,531	+5,027	+4,993	+1,424	+2,342	+1,196	+1,261
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
8.2%	18.5%	91.8%	81.5%	66.3%	25.4%	7.4%	18.1%	48.6%
تعداد کل معامله گران: 233				تعداد معامله گران در هر دسته				
		140	175	52	31	59	52	115

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 11٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 53,212 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 65 قرارداد افزایش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.81 و نسبت به کل 0.43 است.
- قراردادهای باز با 7,574 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 3,504 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای نقره رقم خورده است.
- چکیده این هفته: در ماه های اخیر شاهد افزایش سرمایه گذاری در نقره بودیم و در این افزایش سرمایه گذاری نقش غیرتجاری ها در افزایش قراردادهای خرید بوده است ولی در این هفته تقریباً بصورت برابر به تعداد قراردادهای خرید و فروش خود افزودند. این روند در یک ماه و نیم 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 پنجمین 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>