



نشریه هفتگی

گزارش تعهد معامله گران

به زبان فارسی به همراه تفسیر

COT - Commitments of Traders

❖ تاریخ انتشار: یکشنبه ۲ اردیبهشت ۱۴۰۳

❖ سال دوم / شماره ۲۶

❖ صاحب امتیاز: انتشارات ایسن

❖ قیمت: ۳۹,۰۰۰ تومان / ۱\$ رایگان



فارکس
فکتوری



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: 16 آوریل 24 - 28 فروردین 03

تاریخ انتشار: 19 آوریل 24 - 31 فروردین 03

دلار کانادا (CAD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً 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: 237,526				اندازه قراردادهای 100,000 دلار کانادا				
36,402	27,645	201,124	209,881	75,262	166,834	5,980	119,882	37,067
تغییرات در قراردادهای باز: +44,562				تغییرات				
+4,257	+455	+40,305	+44,107	+5,658	+38,890	+2,891	+31,756	+2,326
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
15.3%	11.6%	84.7%	88.4%	31.7%	70.2%	2.5%	50.5%	15.6%
تعداد کل معامله گران: 132				تعداد معامله گران در هر دسته				
		95	61	40	38	11	48	19

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 17٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 821,815 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 29,430 قرارداد افزایش فروش بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.67 و نسبت به کل 0.39 است.
- قراردادهای باز با 44,562 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش چشمگیری داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 3,802 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای دلار کانادا رقم خورده است.

- چکیده این هفته: غیرتجاری ها بالغ بر سی هزار قرارداد فروش جدید افزودند. این افزایش دقیقا در راستای تمایلات سه ماه اخیر آنها بوده است. هر چند که تجاری ها بر خلاف غیرتجاری ها بر تعداد قراردادهای خرید خود افزودند اما سهم غیرتجاری ها از بازار افزایش یافت.

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: 93,411				اندازه قراردادهای 125,000 فرانک سوئیس				
26,093	9,349	67,318	84,062	16,456	69,412	0	50,862	14,650
تغییرات در قراردادهای باز: +2,578				تغییرات				
+239	-186	+2,339	+2,764	-126	+4,747	-7	+2,472	-1,976
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
27.9%	10.0%	72.1%	90.0%	17.6%	74.3%	0.0%	54.4%	15.7%
تعداد کل معامله گران: 66				تعداد معامله گران در هر دسته				
		41	30	18	19	0	23	11

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 1.75٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 36,212 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 4,448 قرارداد افزایش فروش بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.76 و نسبت به کل 0.43 است .
- قراردادهای باز با 2,578 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 425 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: 229,420				اندازه قراردادهای پوند انگلیس 62,500						
33,312	21,721	196,108	207,699	126,985	129,957	5,942	63,181	71,800		
تغییرات در قراردادهای باز: +18,134				تغییرات						
+4,301	-6,093	+13,833	+24,227	+3,734	+33,761	-1,334	+11,433	-8,200		
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران										
14.5%	9.5%	85.5%	90.5%	55.4%	56.6%	2.6%	27.5%	31.3%		
تعداد کل معامله گران: 130				تعداد معامله گران در هر دسته						
		98	60	52	29	15	36	25		

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 6٪ افزایش داشت.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 8,619 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 19,633 قرارداد افزایش فروش بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.54 و نسبت به کل 0.35 است.
- قراردادهای باز با 18,134 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل نیز در این هفته 10,394 قرارداد افزایش 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 8,619 در 16 آوریل کاهش پیدا کرد. اما تجاری ها در این هفته بالغ بر سی هزار قرارداد خرید افزودند که کمی به روند کاهشی سرمایه گذاری در پوند بهبود بخشید.

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: 331,110				اندازه قراردادهای 12,500,000 ین ژاپن				
47,496	45,373	283,614	285,737	62,900	230,642	5,632	215,082	49,463
تغییرات در قراردادهای باز: +6,631				تغییرات				
+1,764	-5,568	+4,867	+12,199	+586	+11,386	-1,375	+5,656	+2,188
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
14.3%	13.7%	85.7%	86.3%	19.0%	69.7%	1.7%	65.0%	14.9%
تعداد کل معامله گران: 163				تعداد معامله گران در هر دسته				
		108	84	38	54	13	62	25

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته تقریباً بدون تغییر باقی مانده است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 165,619 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 3,468 قرارداد افزایش فروش بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.92 و نسبت به کل 0.47 است.
- قراردادهای باز با 6,631 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 7,332 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای ین رقم خورد.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در این هفته هم به قراردادهای خرید و هم به فروش خود افزودند اما برابری قراردادهای فروش بیشتر بوده که این روند در ماه های اخیر به همین شکل بوده و شاهد تمایل به فروش ین توسط آنها هستیم. اما برخلاف 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: 658,865				اندازه قراردادهای 125,000 یورو				
57,364	73,794	601,501	585,071	424,633	395,979	10,180	166,688	178,912
تغییرات در قراردادهای باز: +15,369				تغییرات				
+1,624	-1,255	+13,745	+16,624	-10,513	+12,865	+266	+23,992	+3,493
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
8.7%	11.2%	91.3%	88.8%	64.4%	60.1%	1.5%	25.3%	27.2%
تعداد کل معامله گران: 293				تعداد معامله گران در هر دسته				
		176	195	96	110	28	63	74

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته تقریباً بدون تغییر باقی مانده است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 12,224 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 20,499 قرارداد افزایش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.43 و نسبت به کل 0.30 است.
- قراردادهای باز با 15,369 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 2,879 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای یورو رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در این هفته حدود 24 هزار قرارداد فروش افزودند، اگر روند سه ماهه اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش این گروه را مورد بررسی قرار دهیم متوجه می شویم که از مقدار 88,700 در 30 ژانویه به مقدار 12,200 در 16 آوریل رسیده است. تمایل تجاری ها اما در این هفته به افزایش قراردادهای خرید و کاهش قراردادهای فروش بود. اما سهم غیرتجاری ها به علت سرمایه گذاری بیشتر نسبت به سایر گروه ها افزایش داشت.

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: 234,919				اندازه قراردادهای 100,000 دلار استرالیا					
33,403	18,142	201,516	216,777	52,990	169,334	5,078	143,448	42,365	
تغییرات در قراردادهای باز: +25,981				تغییرات					
+2,567	-3,425	+23,414	+29,406	+3,179	+17,913	-316	+20,551	+11,809	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
14.2%	7.7%	85.8%	92.3%	22.6%	72.1%	2.2%	61.1%	18.0%	
تعداد کل معامله گران: 114				تعداد معامله گران در هر دسته					
		77	63	28	33	14	42	23	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 8٪ افزایش است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 101,083 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 8,742 قرارداد افزایش فروش بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.86 و نسبت به کل 0.45 است.
- قراردادهای باز با 25,981 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 5,992 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای دلار استرالیا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: در این هفته بر خلاف هفته گذشته تمایل گروه ها به افزایش سرمایه گذاری در دلار استرالیا بود بطوریکه غیرتجاری ها حدود 32 هزار افزایش قرارداد داشتند که برابند قراردادهای فروش با حدود 9 هزار قرارداد بیشتر بود و در کل نیز موجب افزایش سهم این گروه از بازار شد. تجاری ها اما تمایل به افزایش قراردادهای خرید خود داشتند.

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: 62,857				اندازه قراردادهای 100,000 دلار نیوزلند					
6,116	3,272	56,741	59,585	26,625	41,195	371	29,745	18,019	
تغییرات در قراردادهای باز: +6,597				تغییرات					
+562	+410	+6,035	+6,187	+3,349	+1,680	+214	+2,472	+4,293	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
9.7%	5.2%	90.3%	94.8%	42.4%	65.5%	0.6%	47.3%	28.7%	
تعداد کل معامله گران: 99				تعداد معامله گران در هر دسته					
		60	51	25	24	5	31	26	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 8٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 11,726 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 1,821 قرارداد افزایش خرید بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.71 و نسبت به کل 0.41 است.
- قراردادهای باز با 6,597 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این 152 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای دلار نیوزلند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: تمام گروه ها در این هفته به افزایش در قراردادهای خود مبادرت ورزیدند. غیرتجاری ها حدود 6,700 قرارداد جدید داشتند که سهم قراردادهای خرید حدود 2 هزار قرارداد بیشتر بود. تجاری ها بیشتر بر تعداد قراردادهای فروش خود افزودند اما مجموع سرمایه گذاری های آنها در این هفته حدود 5 هزار قرارداد بود که در نتیجه باعث افزایش 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: 93,614				اندازه قراردادهای \$5 * شاخص داوجونز					
11,630	14,410	81,984	79,204	69,157	52,698	2,801	10,026	23,705	
تغییرات در قراردادهای باز: +1,130				تغییرات					
-1,167	+176	+2,297	+954	+3,467	+5,406	+702	-1,872	-5,154	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
12.4%	15.4%	87.6%	84.6%	73.9%	56.3%	3.0%	10.7%	25.3%	
تعداد کل معامله گران: 88				تعداد معامله گران در هر دسته					
		48	57	24	29	9	19	24	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 1.5٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 13,679 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 3,282 قرارداد کاهش خرید بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.30 و نسبت به کل 0.22 است.
- قراردادهای باز با 1,130 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,343 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای شاخص داوجونز رقم خورده است.
- چکیده این هفته: روند کاهش سرمایه گذاری غیرتجاری ها در داوجونز این هفته هم به چشم می خورد. اما برخلاف هفته قبل این هفته تمایل آنها به کاهش بیشتر در قراردادهای خرید بود، همچنین با افزایشی که در قراردادهای گروه تجاری ایجاد شد سهم غیرتجاری ها از بازار کاهش یافت.

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: 263,134				اندازه قراردادهای \$20 * شاخص نزدک					
36,476	48,636	226,658	214,498	159,836	141,517	7,630	59,192	65,351	
تغییرات در قراردادهای باز: -3,890				تغییرات					
-2,937	+2,231	-954	-6,122	-2,583	-6,097	+804	+825	-828	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
13.9%	18.5%	86.1%	81.5%	60.7%	53.8%	2.9%	22.5%	24.8%	
تعداد کل معامله گران: 321				تعداد معامله گران در هر دسته					
		183	214	103	118	34	64	78	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 4٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 6,159 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 1,53 قرارداد افزایش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.43 و نسبت به کل 0.30 است.
- قراردادهای باز با 3,890 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 5,168 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای شاخص نزدک رقم خورده است.
- چکیده این هفته: تغییرات این هفته نزدک هم چشمگیر نیست و تقریباً هفته بی سر و صدایی را پشت سر گذاشت. تجاری ها اما در این هفته حدود 8,500 قرارداد را تسویه نمودند که منجر به افزایش مقدار کمی در سهم غیرتجاری ها از بازار 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: 436,151,300,000 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 4,435,697				اندازه قراردادهای 100,000 دلار امریکا ارزش اسمی					
397,983	410,016	4,037,714	4,025,681	3,015,802	3,365,808	126,269	895,643	533,604	
تغییرات در قراردادهای باز: +74,184				تغییرات					
-2,147	+2,362	+76,331	+71,822	+152,431	+3,076	+30,052	-106,152	+38,694	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
9.0%	9.2%	91.0%	90.8%	68.0%	75.9%	2.8%	20.2%	12.0%	
تعداد کل معامله گران: 410				تعداد معامله گران در هر دسته					
		297	282	198	196	47	76	62	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 1.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 362,039 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 144,846 قرارداد کاهش فروش بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.24 و نسبت به کل 0.19 است.
- قراردادهای باز با 74,184 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 4,509 قرارداد افزایش 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 که در این هفته نمود بیشتری پیدا کرد و این گروه اقدام به تسویه 106 هزار قرارداد فروش و افزایش 38 هزار قرارداد خرید نمود. اما افزایش 152 هزار قرارداد فروش تجاری ها باعث برقراری توازن که در هفته های قبل در بازار بود شد.

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: 44,069				اندازه قراردادهای 1,000 دلار امریکا * شاخص دلار				
2,358	4,596	41,711	39,473	9,349	8,040	1,522	30,840	29,911
تغییرات در قراردادهای باز: +3,621				تغییرات				
+313	+979	+3,308	+2,642	-275	-1,154	+618	+2,965	+3,178
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
5.4%	10.4%	94.6%	89.6%	21.2%	18.2%	3.5%	70.0%	67.9%
تعداد کل معامله گران: 119				تعداد معامله گران در هر دسته				
		39	85	5	7	4	31	77

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته در حدود 10٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 929 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 213 قرارداد افزایش خرید بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 3.59 و نسبت به کل 0.77 است.
- قراردادهای باز با 3,621 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 666 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای شاخص دلار رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها این هفته هم همچون هفته قبل به قراردادهای خرید و فروش خود افزودند که سهم قراردادهای خرید بیشتر بود و با توجه به تسویه ای که در قراردادهای گروه تجاری رخ داد سهم این گروه از بازار افزایش قابل توجهی 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: 10,048,119,770 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 29,526				اندازه قراردادهای 5 بیتکوین				
856	1,532	28,670	27,994	1,826	1,513	4,142	22,702	22,339
تغییرات در قراردادهای باز: +452				تغییرات				
+148	-167	+304	+619	-556	-31	+1,883	-1,023	-1,233
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
2.9%	5.2%	97.1%	94.8%	6.2%	5.1%	14.0%	76.9%	75.7%
تعداد کل معامله گران: 125				تعداد معامله گران در هر دسته				
		76	81	8	4	32	53	59

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 8٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 363 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 210 قرارداد کاهش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 14.74 و نسبت به کل 0.87 است.
- قراردادهای باز با 452 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 315 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای بیتکوین رقم خورده است.
- چکیده این هفته: همانطور که مشاهده می کنید در این هفته هم غیرتجاری ها بخشی از قراردادهای خرید و فروش خود را تسویه نمودند که سهم تسویه قراردادهای خرید 200 قرارداد بیشتر بود، همچنین از ماه گذشته شاهد شکل گیری روند 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: 164,559				اندازه قراردادهای 1,000 بشکه				
31,589	20,904	132,970	143,655	100,051	74,749	5,506	27,413	63,400
تغییرات در قراردادهای باز: +4,317				تغییرات				
+2,166	+244	+2,151	+4,073	+1,439	+1,837	+702	+10	+1,534
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
19.2%	12.7%	80.8%	87.3%	60.8%	45.4%	3.3%	16.7%	38.5%
تعداد کل معامله گران: 46				تعداد معامله گران در هر دسته				
		39	35	30	27	7	5	5

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 2٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 35,987 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 1,524 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.55 و نسبت به کل 0.35 است.
- قراردادهای باز با 4,317 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,922 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای نفت رقم خورده است.
- چکیده این هفته: در هفته ای که گذشت همچون هفته قبل تمام گروه ها مشغول افزایش در قراردادهای خرید و فروش خود بودند اما این افزایش ها ناچیز بود و شاهد تغییر خاصی در تغییر تمایل یا سهم گروهی از بازار نیستیم.

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: 517,193				اندازه قراردادهای 100 اونس تروی				
29,410	50,245	487,783	466,948	355,442	132,684	55,487	76,854	278,777
تغییرات در قراردادهای باز: +11,979				تغییرات				
+14	-1,314	+11,965	+13,293	+2,766	+4,590	+9,725	-526	-1,022
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
5.7%	9.7%	94.3%	90.3%	68.7%	25.7%	10.7%	14.9%	53.9%
تعداد کل معامله گران: 340				تعداد معامله گران در هر دسته				
		186	268	61	48	80	77	186

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 201,923 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 496 قرارداد کاهش خرید بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.84 و نسبت به کل 0.43 است.
- قراردادهای باز با 11,979 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,328 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای طلا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها بر خلاف روندی که در ماه های اخیر حاکم بود عمل نمودند و همچون هفته قبل تر بخشی از قراردادهای خرید و فروش خود را تسویه نمودند 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 در این هفته 7 هزار افزایش قرارداد داشتند که برابند قراردادهای خرید حدود 2 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: 24,546,377,750 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 175,784				اندازه قراردادهای 5,000 اونس تروی					
11,989	32,658	163,795	143,126	120,470	46,442	14,269	29,056	82,415	
تغییرات در قراردادهای باز: +1,387				تغییرات					
-2,270	+336	+3,657	+1,051	+4,833	+2,080	+1,382	-2,558	-2,411	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
6.8%	18.6%	93.2%	81.4%	68.5%	26.4%	8.1%	16.5%	46.9%	
تعداد کل معامله گران: 227				تعداد معامله گران در هر دسته					
		134	172	53	35	53	47	109	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته کمتر از 1٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 53,359 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 147 قرارداد کاهش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.75 و نسبت به کل 0.41 است.
- قراردادهای باز با 1,387 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 2,606 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای نقره رقم خورده است.
- چکیده این هفته: در ماه های اخیر شاهد افزایش سرمایه گذاری در نقره بودیم و روند حاکم بر نقره همچون هفته های قبل تر ادامه پیدا کرده است ولی نکته قابل توجه تسویه 5 هزار قرارداد توسط غیرتجاری هاست که تقریباً به میزان برابر از قراردادهای خرید و فروش بوده است ولی باعث کاهش سهم آنها از بازار شده اما تمایل آنها تغییری نکرده است. تجاری ها هم حدود 7 هزار افزایش در قراردادهایشان داشتند که برابری قراردادهای فروش حدود 2,800 قرارداد بیشتر 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 ششمین 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>