



نشریه هفتگی

گزارش تعهد معامله گران

به زبان فارسی به همراه تفسیر

COT - Commitments of Traders

❖ تاریخ انتشار: یکشنبه ۲۳ اردیبهشت ۱۴۰۳

❖ سال دوم / شماره ۲۹

❖ 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: 7 می 24 - 18 اردیبهشت 03

تاریخ انتشار: 10 می 24 - 21 اردیبهشت 03

دلار کانادا (CAD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفا مربوط به معاملات آتی است

کد - 090741

[بازگشت به فهرست](#)

ارزش قراردادهای باز: 15,795,504,242 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 216,708				اندازه قراردادهای 100,000 دلار کانادا				
32,343	29,719	184,365	186,989	76,545	148,390	5,654	102,166	32,945
تغییرات در قراردادهای باز: +5,153				تغییرات				
-3,267	+1,398	+8,420	+3,755	+2,676	+4,031	+572	+5,172	-848
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
14.9%	13.7%	85.1%	86.3%	35.3%	68.5%	2.6%	47.1%	15.2%
تعداد کل معامله گران: 121				تعداد معامله گران در هر دسته				
		88	57	40	35	11	43	16

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 69,221 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 6,020 قرارداد افزایش فروش بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.62 و نسبت به کل 0.37 است.
- قراردادهای باز با 5,153 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 4,665 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای دلار کانادا رقم خورده است.

- چکیده این هفته: همانطور که در گزارش هفته قبل اشاره شد روند دو هفته قبل تر نمی تواند نشانی از تغییر تمایل در گروه ها باشد و عملکرد این هفته معامله گران همین موضوع را نشان داد. غیرتجاری ها همچون روند سه ماه گذشته خود به قراردادهای فروش خود افزودند و از قراردادهای خرید خود کاستند. اما در کل تغییرات به وجود آمده در گروه ها در این هفته خیلی چشمگیر نبود و تغییری در سهم آنها از بازار ایجاد نکرد.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: دلار کانادا - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: USD/CAD - فارکس
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتی
خطوط عمودی: زمان انتشار گزارش
لیبل قیمت: آخرین قیمت در زمان انتشار گزارش
تایم فریم 4 ساعته

فرانک سوئیس (CHF) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 092741

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 13,031,044,852 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 94,645				اندازه قراردادهای 125,000 فرانک سوئیس				
21,879	10,557	72,766	84,088	20,575	73,684	1,167	51,024	9,237
تغییرات در قراردادهای باز: -4,281				تغییرات				
-3,738	+1,437	-543	-5,718	+412	-4,762	+847	-1,802	-1,803
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
23.1%	11.2%	76.9%	88.8%	21.7%	77.9%	1.2%	53.9%	9.8%
تعداد کل معامله گران: 65				تعداد معامله گران در هر دسته				
		41	32	20	18	3	21	11

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 41,787 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 1 قرارداد کاهش خرید بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.65 و نسبت به کل 0.39 است .
- قراردادهای باز با 4,281 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 5,175 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای فرانک سوئیس رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها حدود 4 هزار قرارداد خرید و فروش خود را بصورت برابر تسویه نمودند و با توجه به تسویه حدود 4 هزار قرارداد خرید گروه تجاری تغییری در سهم گروه ها ایجاد نشد ولی با توجه به تسویه های انجام شده ارزش قراردادهای فرانک حدود 3٪ کاهش یافت.

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: 17,487,435,956 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 223,730				اندازه قراردادهای پوند انگلیس 62,500					
32,602	21,445	191,128	202,285	108,865	141,835	8,673	73,590	51,777	
تغییرات در قراردادهای باز: -11,880				تغییرات					
-3,183	+230	-8,697	-12,110	-9,941	-20,531	+312	+932	+8,109	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
14.6%	9.6%	85.4%	90.4%	48.7%	63.4%	3.9%	32.9%	23.1%	
تعداد کل معامله گران: 123				تعداد معامله گران در هر دسته					
		99	57	53	29	17	36	20	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 5٪ کاهش داشت.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 21,813 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 7,177 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.53 و نسبت به کل 0.34 است.
- قراردادهای باز با 11,880 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل نیز در این هفته 3,413 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای پوند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: در این هفته برخلاف روند ماه گذشته غیرتجاری ها حدود 7 هزار قرارداد خرید افزودند ولی تجاری ها در این هفته بالغ بر 30 هزار قرارداد تسویه نمودند که بیش از 20 هزار قرارداد تسویه شده مربوط به پوزیشن های خرید بود و موجب کاهش 5٪ در ارزش قراردادهای باز پوند شد. همچون با این تغییرات سهم غیرتجاری ها از بازار پوند افزایش یافت.

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: 24,235,652,213 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 299,859				اندازه قراردادهای 12,500,000 ین ژاپن				
44,184	37,333	255,675	262,526	77,532	219,305	8,231	169,912	34,990
تغییرات در قراردادهای باز: -34,989				تغییرات				
-5,467	-4,584	-29,522	-30,405	+8,734	-25,615	+655	-38,911	-5,445
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
14.7%	12.5%	85.3%	87.5%	25.9%	73.1%	2.7%	56.7%	11.7%
تعداد کل معامله گران: 159				تعداد معامله گران در هر دسته				
		104	83	45	52	9	56	25

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 9.5٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 134,922 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 33,466 قرارداد کاهش فروش بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.72 و نسبت به کل 0.41 است.
- قراردادهای باز با 34,989 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 883 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای ین رقم خورد.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها روند هفته قبل خود را پیش گرفتند و این بار حدود 39 هزار قرارداد فروش خود را تسویه نمودند آنها همچنین بالغ بر 5 هزار قرارداد خرید خود را نیز تسویه نمودند. تجاری ها هم حدود 26 هزار قرارداد خرید را تسویه نمودند که نتیجه این تغییرات کاهش 10٪ بازار ین فیوچر بود. ثمره دیگر این تغییرات کاهش سهم غیرتجاری ها از بازار ین بود.

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: 88,026,120,225 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 654,804				اندازه قراردادهای 125,000 یورو				
57,467	75,156	597,337	579,648	416,124	393,845	15,209	166,004	170,594
تغییرات در قراردادهای باز: +2,507				تغییرات				
+1,946	+2,121	+561	+386	+6,224	-5,318	+2,295	-7,958	+3,409
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
8.8%	11.5%	91.2%	88.5%	63.5%	60.1%	2.3%	25.4%	26.1%
تعداد کل معامله گران: 279				تعداد معامله گران در هر دسته				
		165	196	88	108	34	57	74

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 1٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 4,590 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 11,367 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.43 و نسبت به کل 0.30 است.
- قراردادهای باز با 2,507 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 175 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای یورو رقم خورده است.
- چکیده این هفته: برابری عملکرد غیرتجاری ها در این هفته هم معطوف به کاهش قراردادهای فروش و افزایش قراردادهای خرید بود. در گروه تجاری هم دقیقاً شاهد عکس این اتفاق بودیم و آنها قراردادهای خرید خود را کاهش و به قراردادهای فروش خود افزودند. اما این تغییرات بالانس بازار را تغییر نداد و یورو تقریباً هفته کم تلاطمی را پشت سر گذاشت.

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: 13,824,591,450 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 209,670				اندازه قراردادهای 100,000 دلار استرالیا				
27,865	19,859	181,805	189,811	62,501	135,023	5,308	113,996	49,480
تغییرات در قراردادهای باز: -14,903				تغییرات				
-1,907	-754	-12,996	-14,149	-2,734	-22,606	+270	-10,532	+8,187
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
13.3%	9.5%	86.7%	90.5%	29.8%	64.4%	2.5%	54.4%	23.6%
تعداد کل معامله گران: 100				تعداد معامله گران در هر دسته				
		61	64	29	33	11	25	27

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 5٪ کاهش است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 64,516 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 18,719 قرارداد کاهش فروش بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.85 و نسبت به کل 0.45 است.
- قراردادهای باز با 14,903 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,153 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای دلار استرالیا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: روند این هفته دلار استرالیا بسیار شبیه به هفته قبل بود. در این هفته هم شاهد کاهش حدود 15 هزار قرارداد در برابند بازار بودیم و غیرتجاری ها و تجاری ها بیش از 32 هزار قرارداد خرید خود را کاهش دادند که سهم غیرتجاری ها حدود 10 هزار قرارداد بود. با این تغییرات سهم غیرتجاری ها از بازار افزایش پیدا کرد.

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: 3,347,868,628 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 55,822				اندازه قراردادهای 100,000 دلار نیوزلند					
5,725	3,124	50,097	52,698	19,739	33,531	107	30,251	19,060	
تغییرات در قراردادهای باز: -2,989				تغییرات					
+416	-129	-3,405	-2,860	-3,596	-411	+5	+186	-2,454	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
10.3%	5.6%	89.7%	94.4%	35.4%	60.1%	0.2%	54.2%	34.1%	
تعداد کل معامله گران: 91				تعداد معامله گران در هر دسته					
		57	48	25	25	5	30	20	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 11,191 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 2,640 قرارداد کاهش خرید بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.92 و نسبت به کل 0.48 است.
- قراردادهای باز با 2,989 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این 545 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای دلار نیوزلند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها حدود 2,500 قرارداد خرید تسویه نمودند و تجاری ها حدود 3,500 قرارداد فروش را تسویه نمودند. در انواع قراردادهای دیگر آنها شاهد تغییرات چشمگیری نبودیم و نتیجه این تغییرات افزایش سهم غیرتجاری ها از بازار و کاهش 3 درصدی ارزش قراردادهای باز دلار نیوزلند 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: 18,032,843,840 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 92,752				اندازه قراردادهای \$5 * شاخص داوجونز					
11,590	13,773	81,162	78,979	67,908	57,061	2,613	10,641	19,305	
تغییرات در قراردادهای باز: +2,792				تغییرات					
+87	+829	+2,705	+1,963	+4,310	+102	+439	-2,044	+1,422	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
12.5%	14.8%	87.5%	85.2%	73.2%	61.5%	2.8%	11.5%	20.8%	
تعداد کل معامله گران: 88				تعداد معامله گران در هر دسته					
		47	61	26	32	9	17	24	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 5.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 8,664 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 3,466 قرارداد افزایش خرید بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.26 و نسبت به کل 0.20 است.
- قراردادهای باز با 2,792 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 742 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای شاخص داوجونز رقم خورده است.
- چکیده این هفته: روند افزایش قراردادهای فروش و کاهش قراردادهای خرید که تمایل یک ماه و نیم گذشته غیرتجاری ها بود در این هفته متوقف شد. هر چند که این توقف نمی تواند نمایانگر تغییر تمایلات آنها باشد اما زنگ هشدار برای بررسی های بیشتر در این نماد خواهد بود. نکته مهم بعدی کاهش مداوم سهم غیرتجاری ها از بازار در همین مدت زمان بوده است که در این هفته هم شاهد آن بودیم!

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: 79,344,122,400 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 242,910				اندازه قراردادهای \$20 * شاخص نزدک					
39,016	44,041	203,895	198,870	135,421	125,015	8,148	60,326	65,707	
تغییرات در قراردادهای باز: -19,051				تغییرات					
+3,588	-5,751	-22,639	-13,300	-19,571	-15,077	-2,615	-454	+4,392	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
16.1%	18.1%	83.9%	81.9%	55.7%	51.5%	3.4%	24.8%	27.0%	
تعداد کل معامله گران: 292				تعداد معامله گران در هر دسته					
		173	195	95	108	39	57	69	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3.5٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 5,381 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 4,846 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.51 و نسبت به کل 0.33 است.
- قراردادهای باز با 19,052 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 9,339 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای شاخص نزدک رقم خورده است.
- چکیده این هفته: نکته چشمگیر این هفته تسویه حدود 35 هزار قرارداد خرید و فروش تجاری ها بود که سهم قراردادهای فروش تسویه شده حدود 20 هزار فقره بود. اما غیرتجاری ها بالغ بر 4 هزار قرارداد خرید افزودند که در ادامه تمایلات ماه های اخیر آنها بود و با این تفاسیر شاهد افزایش سهم غیرتجاری ها از بازار بودیم.

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: 441,222,800,000 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 4,412,228				اندازه قراردادهای 100,000 دلار امریکا ارزش اسمی					
387,400	411,798	4,024,828	4,000,430	2,980,496	3,437,718	106,788	937,544	455,924	
تغییرات در قراردادهای باز: -3,165				تغییرات					
-42,376	+6,336	+39,211	-9,501	+9,407	+9,350	-23,132	+52,936	+4,281	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
8.8%	9.3%	91.2%	90.7%	67.6%	77.9%	2.4%	21.2%	10.3%	
تعداد کل معامله گران: 413				تعداد معامله گران در هر دسته					
		295	283	200	203	42	77	x	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته تقریباً بدون تغییر باقی مانده است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 481,620 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 48,655 قرارداد افزایش فروش بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.23 و نسبت به کل 0.18 است.
- قراردادهای باز با 3,165 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 48,712 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای این نماد رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها حدود 53 هزار قرارداد فروش جدید افزودند که برخلاف تمایل 3 ماه اخیر آنها بود. سایر تغییرات در بین گروه ها نیز طوری بود که تعادل بازار بر هم نریخت و نماد اوراق قرضه هفته کم تلاطمی را پشت سر گذاشت.

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: 4,519,817,210 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 42,962				اندازه قراردادهای 1,000 دلار امریکا * شاخص دلار					
2,214	3,753	40,748	39,209	12,652	9,260	1,068	27,028	28,881	
تغییرات در قراردادهای باز: -5,822				تغییرات					
+28	-657	-5,850	-5,165	+569	-634	+181	-6,600	-4,712	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
5.2%	8.7%	94.8%	91.3%	29.4%	21.6%	2.5%	62.9%	67.2%	
تعداد کل معامله گران: 111				تعداد معامله گران در هر دسته					
		34	83	4	10	5	27	71	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته در حدود 14.5٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 1,853 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 1,888 قرارداد کاهش فروش بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 2.60 و نسبت به کل 0.71 است.
- قراردادهای باز با 5,822 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 685 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای شاخص دلار رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها که سهم بالایی در این نماد دارند با تصمیم این هفته خود مبنی بر کاهش بیش از 11 هزار قرارداد خود که سهم قراردادهای فروش تسویه شده 6,600 فقره بود، باعث ریزش 14 درصدی در ارزش قراردادهای باز شدند. همچنین با این تغییرات سهم آنها از بازار کاهش پیدا کرد اما نکته مهم قابل اشاره تداوم در روند یک ماه و نیم اخیر آنهاست که موجب افزایش بالانس در قراردادهای خرید آنها نسبت به فروش شده است.

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: 8,229,016,875 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 26,155				اندازه قراردادهای 5 بیتکوین				
939	1,588	25,216	24,567	1,047	1,181	2,616	21,553	20,770
تغییرات در قراردادهای باز: +1,360				تغییرات				
+2	+127	+1,358	+1,233	-774	-110	+142	+1,990	+1,201
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
3.6%	6.1%	96.4%	93.9%	4.0%	4.5%	10.0%	82.4%	79.4%
تعداد کل معامله گران: 119				تعداد معامله گران در هر دسته				
		79	71	7	4	30	63	46

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 10٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 783 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 789 قرارداد افزایش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 20.21 و نسبت به کل 0.90 است.
- قراردادهای باز با 1,360 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 125 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای بیتکوین رقم خورده است.
- چکیده این هفته: همانطور که از نسبت قراردادها مشخص است غیرتجاری ها در بازار بیتکوین فیوچر شیکاگو با 90 درصد سهم، حاکمان بلامنازعه این نماد هستند و تغییرات تمایل آنها کاملاً بر بازار تاثیر گذار است. در این هفته غیرتجاری ها حدود 3 هزار قرارداد جدید افزودند که حدود 2 هزار قرارداد مربوط به قراردادهای فروش بود و با این تغییرات سهم آنها از بازار بیتکوین باز هم افزایش یافت.

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: 11,807,855,850 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 150,745				اندازه قراردادهای 1,000 بشکه					
25,983	17,652	124,762	133,093	94,074	67,322	3,853	26,835	61,918	
تغییرات در قراردادهای باز: -22,952				تغییرات					
-2,266	-662	-20,686	-22,290	-17,923	-14,808	-2,127	-636	-5,355	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
17.2%	11.7%	82.8%	88.3%	62.4%	44.7%	2.6%	17.8%	41.1%	
تعداد کل معامله گران: 49				تعداد معامله گران در هر دسته					
		41	38	31	31	6	7	4	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 20٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 35,083 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 4,719 قرارداد کاهش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.57 و نسبت به کل 0.36 است.
- قراردادهای باز با 22,952 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,604 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای نفت رقم خورده است.
- چکیده این هفته: بازار نفت نایمکس در این هفته شاهد تغییرات چشمگیری بود که در طی آن تجاری ها حدود 33 هزار فقره از قراردادهای خود را تسویه نمودند که سهم قراردادهای فروش تسویه شده حدود 18 هزار فقره بود. غیرتجاری ها هم برخلاف روند هفته های قبل تر خود در این هفته نسبت به تسویه بیش از 5 هزار قرارداد خرید خود اقدام نمودند. با تغییرات اعمال شده در این هفته شاهد کاهش 20 درصدی ارزش قراردادهای بازار نفت و همچنین افزایش سهم غیرتجاری ها از بازار بودیم. همچنین روند رو به رشد سرمایه گذاری در نفت که در یک ماه اخیر آغاز شده بود با این تغییرات متوقف 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 صرفا مربوط به معاملات آتی است

کد - 088691

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 122,579,446,590 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 529,835				اندازه قراردادهای 100 اونس تروی				
27,002	54,701	502,833	475,134	352,165	124,899	78,091	72,577	272,144
تغییرات در قراردادهای باز: +10,044				تغییرات				
+16	+4,427	+10,028	+5,617	-2,258	-2,026	+14,349	-2,063	-6,706
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
5.1%	10.3%	94.9%	89.7%	66.5%	23.6%	14.7%	13.7%	51.4%
تعداد کل معامله گران: 327				تعداد معامله گران در هر دسته				
		176	261	53	42	82	73	183

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 199,567 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 4,643 قرارداد کاهش خرید بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.88 و نسبت به کل 0.43 است.
- قراردادهای باز با 10,044 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 4,411 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای طلا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: در یک ماه اخیر تمایل غیرتجاری ها بیشتر به افزایش سرمایه گذاری در طلا بصورت هج بوده است و این روند را در این هفته هم شاهد هستیم. اما آنها حدود 9 هزار قرارداد خرید و فروش خود را در این هفته تسویه نمودند که سهم قراردادهای خرید تسویه شده حدود 7 هزار فقره بود. تجاری ها هم در این هفته تقریبا بصورت متوازن به مقدار 4 هزار قرارداد خرید و فروش خود را تسویه نمودند. با این تغییرات سهم غیرتجاری ها از بازار به مقدار کمی افزایش یافت.

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: 22,046,421,600 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 161,868				اندازه قراردادهای 5,000 اونس تروی				
11,678	32,441	150,190	129,427	113,640	39,225	8,552	27,998	81,650
تغییرات در قراردادهای باز: -4,447				تغییرات				
+71	+132	-4,518	-4,579	-2,301	-1,520	-1,615	-602	-1,444
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
7.2%	20.0%	92.8%	80.0%	70.2%	24.2%	5.3%	17.3%	50.4%
تعداد کل معامله گران: 230				تعداد معامله گران در هر دسته				
		122	177	48	40	45	48	113

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 1٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 53,652 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 842 قرارداد کاهش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.77 و نسبت به کل 0.42 است.
- قراردادهای باز با 4,447 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 61 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای نقره رقم خورده است.
- چکیده این هفته: روند این هفته نقره هم همانند هفته قبل بود و در طی آن تمام گروه ها مشغول تسویه بخشی از قراردادهای خرید و فروش خود بودند اما زمانیکه که به نسبت های کلی تر توجه می کنیم می بینیم که تغییر چشمگیری در بازار ایجاد نشده، بنابراین با تغییراتی که در این هفته صورت پذیرفته شاهد تغییر در تمایلات گروه خاصی نیستیم هر چند که غیرتجاری ها در این دو هفته بر خلاف روند کلی خود حرکت نمودند اما همانطور که ذکر شد این تغییرات محسوس نیستند.

نمودار تغییرات قیمت



به

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 نهمین 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 هج 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>