



نشریه هفتگی

گزارش تعهد معامله گران

به زبان فارسی به همراه تفسیر

COT - Commitments of Traders

❖ تاریخ انتشار: یکشنبه ۳۰ اردیبهشت ۱۴۰۳

❖ سال دوم / شماره ۳۰

❖ 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: 14 می 24 - 25 اردیبهشت 03

تاریخ انتشار: 17 می 24 - 28 اردیبهشت 03

دلار کانادا (CAD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفا مربوط به معاملات آتی است

کد - 090741

[بازگشت به فهرست](#)

ارزش قراردادهای باز: 16,187,648,891 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 220,840				اندازه قراردادهای دلار کانادا 100,000				
30,409	32,492	190,431	188,348	69,406	147,626	6,436	114,589	34,286
تغییرات در قراردادهای باز: +4,132				تغییرات				
-1,934	+2,773	+6,066	+1,359	-7,139	-764	+782	+12,423	+1,341
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
13.8%	14.7%	86.2%	85.3%	31.4%	66.8%	2.9%	51.9%	15.5%
تعداد کل معامله گران: 116				تعداد معامله گران در هر دسته				
		84	59	39	37	11	41	15

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 2.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 80,303 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 11,082 قرارداد افزایش فروش بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.71 و نسبت به کل 0.41 است.
- قراردادهای باز با 4,132 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 4,707 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای دلار کانادا رقم خورده است.

- چکیده این هفته: همانطور که مشاهده می کنید در این هفته برآیند معاملات غیرتجاری ها افزایش 11 هزار قرارداد فروش بود و از آنجایی که تجاری ها در این هفته مشغول تسویه قراردادهای خود بودند سهم غیرتجاری ها از بازار افزایش یافت. همچنین گرایش آنها نسبت به فروش دلار کانادا تقویت شد.

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: 12,512,968,093 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 90,701				اندازه قراردادهای 125,000 فرانک سوئیس					
21,783	11,121	68,918	79,580	19,976	71,745	1,189	47,753	6,646	
تغییرات در قراردادهای باز: -3,944				تغییرات					
-96	+564	-3,848	-4,508	-599	-1,939	+22	-3,271	-2,591	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
24.0%	12.3%	76.0%	87.7%	22.0%	79.1%	1.3%	52.6%	7.3%	
تعداد کل معامله گران: 59				تعداد معامله گران در هر دسته					
		40	30	21	18	3	19	9	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 4٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 41,107 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 680 قرارداد کاهش فروش بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.60 و نسبت به کل 0.37 است .
- قراردادهای باز با 3,944 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 660 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای فرانک سوئیس رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها همچون هفته قبل حدود 6 هزار قرارداد خرید و فروش خود را تسویه نمودند که سهم قرارداد های فروش تسویه شده بیش از 3 هزار فقره بود و تجاری ها نیز بالغ بر 2 هزار قرارداد را تسویه نمودند و از آنجایی که سهم تسویه غیرتجاری ها بیشتر بود سهم آنها از بازار کاهش یافت و با توجه به تسویه های انجام شده ارزش قراردادهای فرانک حدود 4٪ 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: 17,565,378,191 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 223,242				اندازه قراردادهای پوند انگلیس 62,500					
32,589	25,869	190,653	197,373	111,122	137,917	10,782	68,749	48,674	
تغییرات در قراردادهای باز: -488				تغییرات					
-13	+4,424	-475	-4,912	+2,257	-3,918	+2,109	-4,841	-3,103	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
14.6%	11.6%	85.4%	88.4%	49.8%	61.8%	4.8%	30.8%	21.8%	
تعداد کل معامله گران: 119				تعداد معامله گران در هر دسته					
		95	54	52	26	15	36	19	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته تقریباً بدون تغییر باقی ماند.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 20,075 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 1,738 قرارداد کاهش فروش بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.51 و نسبت به کل 0.33 است.
- قراردادهای باز با 488 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل نیز در این هفته 4,437 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای پوند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها حدود 8 هزار قرارداد را تسویه نمودند که سهم قراردادهای فروش حدود 5 هزار فقره بود ولی 2 هزار فقره به قراردادهای هج خود افزودند. تجاری ها هم حدود 4 هزار قرارداد خرید تسویه نمودند و بالغ بر 2 هزار قرارداد فروش افزودند که در نتیجه این تغییرات سهم غیرتجاری ها کمی کاهش یافت ولی در کل تغییرات پوند در این هفته چشمگیر نبود.

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: 23,787,166,699 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 297,606				اندازه قراردادهای 12,500,000 ین ژاپن				
46,558	39,446	251,048	258,160	83,148	216,442	6,415	161,485	35,303
تغییرات در قراردادهای باز: -2,253				تغییرات				
+2,374	+2,113	-4,627	-4,366	+5,616	-2,863	-1,816	-8,427	+313
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
15.6%	13.3%	84.4%	86.7%	27.9%	72.7%	2.2%	54.3%	11.9%
تعداد کل معامله گران: 151				تعداد معامله گران در هر دسته				
		98	82	43	52	12	51	22

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 2٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 126,182 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 8,740 قرارداد کاهش فروش بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.68 و نسبت به کل 0.40 است.
- قراردادهای باز با 2,253 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 261 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای ین رقم خورد.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها همچون دو هفته قبل مشغول تسویه قراردادهای فروش خود بودند و تجاری ها هم از قراردادهای خرید خود کاستند و به قراردادهای فروش خود افزودند اما تغییرات این هفته ین خیلی چشمگیر نبود و تنها نکته قابل ذکر ادامه دار شدن روند کاهش قراردادهای فروش غیرتجاری ها بود.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: یین 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: 88,782,389,348 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 656,802				اندازه قراردادهای 125,000 یورو				
55,345	76,472	601,457	580,330	426,094	387,812	14,120	161,243	178,398
تغییرات در قراردادهای باز: +1,998				تغییرات				
-2,122	+1,316	+4,120	+682	+9,970	-6,033	-1,089	-4,761	+7,804
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
8.4%	11.6%	91.6%	88.4%	64.9%	59.0%	2.1%	24.5%	27.2%
تعداد کل معامله گران: 289				تعداد معامله گران در هر دسته				
		166	209	88	117	35	58	77

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 1٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 17,155 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 12,565 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 1,998 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 3,438 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: 13,351,561,074 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 201,798				اندازه قراردادهای 100,000 دلار استرالیا				
27,865	25,881	175,946	175,917	54,454	131,596	4,262	117,230	40,059
تغییرات در قراردادهای باز: -7,872				تغییرات				
-2,013	+6,022	-5,859	-13,894	-8,047	-3,427	-1,046	+3,234	-9,421
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
12.8%	12.8%	87.2%	87.2%	27.0%	65.2%	2.1%	58.1%	19.9%
تعداد کل معامله گران: 101				تعداد معامله گران در هر دسته				
		60	66	24	35	14	25	28

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3.5٪ کاهش است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 77,171 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 12,655 قرارداد کاهش خرید بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.87 و نسبت به کل 0.46 است.
- قراردادهای باز با 7,872 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 8,035 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای دلار استرالیا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها بر خلاف هفته های قبل تر حدود 10 هزار قرارداد خرید خود را تسویه نمودند، تجاری ها هم در مجموع به تسویه بالغ بر 11 هزار قرارداد پرداختند که 8 هزار فقره آن مربوط به قراردادهای فروش بود. با این تغییرات سهم غیرتجاری ها از بازار کمی افزایش یافت.

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: 3,344,854,240 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 55,640				اندازه قراردادهای 100,000 دلار نیوزلند				
4,645	3,683	50,995	51,957	20,289	32,451	222	30,484	19,284
تغییرات در قراردادهای باز: -182				تغییرات				
-1,080	+559	+898	-741	+550	-1,080	+115	+233	+224
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
8.3%	6.6%	91.7%	93.4%	36.5%	58.3%	0.4%	54.8%	34.7%
تعداد کل معامله گران: 97				تعداد معامله گران در هر دسته				
		63	50	27	23	8	34	21

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته تقریباً بدون تغییر باقی مانده است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 11,200 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 9 قرارداد افزایش فروش بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.94 و نسبت به کل 0.48 است.
- قراردادهای باز با 182 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این 1,639 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای دلار نیوزلند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: دلار نیوزلند هفته بی سر و صدایی را پشت سر گذاشت. در این هفته تغییر خاصی در تمایلات گروه ها مشاهده نمی کنیم و مقدار تغییرات ناچیز هستند.

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: 19,622,152,530 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 99,207				اندازه قراردادهای \$5 * شاخص داوجونز				
11,398	14,802	87,809	84,405	76,183	57,006	2,660	8,966	24,739
تغییرات در قراردادهای باز: +6,455				تغییرات				
-192	+1,029	+6,647	+5,426	+8,275	-55	+47	-1,675	+5,434
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
11.5%	14.9%	88.5%	85.1%	76.8%	57.5%	2.7%	9.0%	24.9%
تعداد کل معامله گران: 91				تعداد معامله گران در هر دسته				
		51	62	26	31	12	18	26

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 8٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 15,773 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 7,109 قرارداد افزایش خرید بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.27 و نسبت به کل 0.21 است.
- قراردادهای باز با 6,455 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,221 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای شاخص داوجونز رقم خورده است.
- چکیده این هفته: هفته قبل اشاره کردیم که روند افزایش قراردادهای فروش و کاهش قراردادهای خرید که تمایل یک ماه و نیم گذشته غیرتجاری ها بود در این هفته متوقف شد ولی این توقف نمی تواند نمایانگر تغییر تمایلات آنها باشد اما زنگ هشدار برای بررسی های بیشتر در این نماد خواهد بود و این اتفاق در این هفته هم تکرار شد. ضمن اینکه تجاری ها 8 هزار قرارداد فروش جدید افزودند، غیرتجاری ها از قراردادهای فروش خود به میزان 1,675 قرارداد کاستند و بالغ بر 5 هزار قرارداد خرید افزودند.

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: 84,783,324,560 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری				
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید		
قراردادهای باز: 256,748				اندازه قراردادهای \$20 * شاخص نزدک						
37,569	44,037	219,179	212,710	145,213	134,445	9,697	64,269	68,568		
تغییرات در قراردادهای باز: +13,837				تغییرات						
-1,447	-4	+15,284	+13,841	+9,792	+9,430	+1,549	+3,944	+2,862		
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران										
14.6%	17.2%	85.4%	82.8%	56.6%	52.4%	3.8%	25.0%	26.7%		
تعداد کل معامله گران: 308				تعداد معامله گران در هر دسته						
		182	207	102	112	40	58	76		

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 6.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 4,299 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 1,082 قرارداد افزایش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.51 و نسبت به کل 0.33 است.
- قراردادهای باز با 13,838 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,444 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای شاخص نزدک رقم خورده است.
- چکیده این هفته: تغییرات این هفته باعث تغییر در بالانس سهم گروه ها از بازار نشد زیرا میزان ورود به قراردادهای خرید و فروش برابر بود ولی از آنجا که همه گروه ها مشغول افزایش سرمایه گذاری بودند بعد از حدود یکماه شاهد افزایش در ارزش قراردادهای باز نزدک 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: 444,223,000,000 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 4,442,230				اندازه قراردادهای 100,000 دلار امریکا ارزش اسمی				
412,892	409,062	4,029,338	4,033,168	3,027,060	3,378,701	132,116	870,162	522,351
تغییرات در قراردادهای باز: +30,002				تغییرات				
+25,492	-2,736	+4,510	+32,738	+46,564	-59,017	+25,328	-67,382	+66,427
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
9.3%	9.2%	90.7%	90.8%	68.1%	76.1%	3.0%	19.6%	11.8%
تعداد کل معامله گران: 413				تعداد معامله گران در هر دسته				
		293	291	203	208	45	68	60

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته کمتر از 1٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 347,811 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 133,809 قرارداد افزایش خرید بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.24 و نسبت به کل 0.19 است.
- قراردادهای باز با 30,002 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 28,228 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای این نماد رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها با روند هفته های قبل تر خود مجدد هماهنگ شدند و رو به کاهش قراردادهای فروش و افزایش قراردادهای خرید آوردند. این در حالی بود که تجاری ها بر خلاف آنها مشغول تسویه قراردادهای خرید و افزودن به قراردادهای فروش خود بودند.

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: 4,488,934,280 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری			
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید	
قراردادهای باز: 42,817				اندازه قراردادهای 1,000 دلار امریکا * شاخص دلار					
2,180	3,535	40,637	39,282	12,262	8,472	1,128	27,247	29,682	
تغییرات در قراردادهای باز: -145				تغییرات					
-34	-218	-111	+73	-390	-788	+60	+219	+801	
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران									
5.1%	8.3%	94.9%	91.7%	28.6%	19.8%	2.6%	63.6%	69.3%	
تعداد کل معامله گران: 116				تعداد معامله گران در هر دسته					
		41	82	6	9	6	32	70	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته کمتر از 0.1٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 2,435 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 582 قرارداد افزایش خرید بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 2.80 و نسبت به کل 0.72 است.
- قراردادهای باز با 145 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 184 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای شاخص دلار رقم خورده است.
- چکیده این هفته: نکته مهم این هفته هم برای غیرتجاری ها حفظ روند تمایل به افزایش قراردادهای خرید شاخص دلار بود. و در مقابل نیز تجاری ها مشغول تسویه قراردادهای خرید و فروش خود بودند که سهم قراردادهای خرید تسویه شده بیشتر بود و در نتیجه این تغییرات باز هم شاهد افزایش سهم غیرتجاری ها از بازار بودیم.

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: 8,333,759,060 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 27,077				اندازه قراردادهای 5 بیتکوین				
921	1,519	26,156	25,558	1,520	1,099	3,381	21,255	21,078
تغییرات در قراردادهای باز: +922				تغییرات				
-18	-69	+940	+991	+473	-82	+765	-298	+308
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
3.4%	5.6%	96.6%	94.4%	5.6%	4.1%	12.5%	78.5%	77.8%
تعداد کل معامله گران: 123				تعداد معامله گران در هر دسته				
		83	76	8	3	35	63	49

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 1٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 177 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 606 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 17.40 و نسبت به کل 0.88 است.
- قراردادهای باز با 922 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 51 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای بیتکوین رقم خورده است.
- چکیده این هفته: بیتکوین هفته کم تلاطمی را در فیوچر شیکاگو پشت سر گذاشت و شاهد تغییرات چشمگیری از سمت بازیگران بازار نبودیم. تنها نکته قابل ذکر کاهش مقداری از سهم غیرتجاری ها از بازار بود.

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: 12,206,220,000 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 156,490				اندازه قراردادهای 1,000 بشکه				
24,609	17,088	131,881	139,402	99,832	73,011	5,014	27,035	61,377
تغییرات در قراردادهای باز: +5,745				تغییرات				
-1,374	-564	+7,119	+6,309	+5,758	+5,689	+1,161	+200	-541
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
15.7%	10.9%	84.3%	89.1%	63.8%	46.7%	3.2%	17.3%	39.2%
تعداد کل معامله گران: 51				تعداد معامله گران در هر دسته				
		44	41	33	34	7	7	4

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 34,342 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 741 قرارداد افزایش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.54 و نسبت به کل 0.34 است.
- قراردادهای باز با 5,745 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 810 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای نفت رقم خورده است.
- چکیده این هفته: در این هفته آرامش بعد از طوفان را برای نفت می بینیم. بطوری که تغییرات غیرتجاری ها کمتر از هزار قرارداد بود و تجاری ها هم بیش از 10 هزار قرارداد افزودند ولی این افزایش تقریباً برای قراردادهای خرید و فروش برابر بود و باعث کاهش کمی از 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 صرفا مربوط به معاملات آتی است

کد - 088691

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 123,285,934,000 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 522,952				اندازه قراردادهای 100 اونس تروی				
25,019	52,633	497,933	470,319	365,693	133,583	59,094	73,146	277,642
تغییرات در قراردادهای باز: -6,883				تغییرات				
-1,983	-2,068	-4,900	-4,815	+13,528	+8,684	-18,997	+569	+5,498
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
4.8%	10.1%	95.2%	89.9%	69.9%	25.5%	11.3%	14.0%	53.1%
تعداد کل معامله گران: 338				تعداد معامله گران در هر دسته				
		180	279	55	46	88	71	194

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته تقریبا بدون تغییر باقی مانده است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 204,496 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 4,929 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.82 و نسبت به کل 0.42 است.
- قراردادهای باز با 6,883 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 85 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای طلا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: در این هفته در تمام گروه ها شاهد افزایش سرمایه گذاری بودیم. غیرتجاری ها بیشتر به افزایش قراردادها خرید گرایش داشتند و تجاری ها بیشتر به افزایش قراردادهای فروش اما از آنجا که حدود 19 هزار قرارداد هیچ غیرتجاری ها در این هفته تسویه شد شاهد کاهش تعداد قراردادهای باز بودیم و همچنین کاهش در سهم گروه غیرتجاری از بازار.

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: 24,514,621,550 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 171,371				اندازه قراردادهای 5,000 اونس تروی				
10,774	32,735	160,597	138,636	122,954	41,532	9,168	28,475	87,936
تغییرات در قراردادهای باز: +9,503				تغییرات				
-904	+294	+10,407	+9,209	+9,314	+2,307	+616	+477	+6,286
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
6.3%	19.1%	93.7%	80.9%	71.7%	24.2%	5.3%	16.6%	51.3%
تعداد کل معامله گران: 239				تعداد معامله گران در هر دسته				
		134	176	54	34	49	51	120

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 10٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 59,461 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 5,809 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.76 و نسبت به کل 0.42 است.
- قراردادهای باز با 9,503 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,198 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای نقره رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها به روند هفته های قبل تر خود بازگشتند و حدود 6 هزار قرارداد خرید افزودند و غیرتجاری ها هم بالغ بر 11 هزار قرارداد افزودند که بیش از 9 هزار فقره آن قرارداد فروش بود. بعد از سه هفته سکون با این تغییرات شاهد افزایش سرمایه گذاری در نقره بودیم که منجر به افزایش 10 درصدی ارزش قراردادهای باز آن شد.

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 معامله گران در دام برداشت‌های غلط از این گزارش و اندیکاتورهای آن می‌افتند و موجب ضرر و زیان خود می‌شوند. این گزارش را به عنوان یک راهنما در کنار تحلیل‌های میان‌مدت و بلندمدت خود قرار دهید و برای معاملات کوتاه مدت خود به دنبال توجیه نگردید. مواردی که در بخش تفسیر هم عنوان شد، تحلیل نیستند و تفسیر به این معنی است که صرفاً اطلاعات موجود در اعداد گزارش شده برای تفهیم بیشتر و راحت‌تر به نگارش فارسی درآمده است.

شما سی‌امین نسخه آموزشی - تحلیلی گزارش تعهد معامله گران به زبان فارسی را مطالعه کردید. امیدواریم که محتوا تهیه شده باعث بهتر شدن نتایج تحلیل‌های شما شود.

پیشنهادات و انتقادات شما راهگشای ما خواهد بود، پس ما را از این موهبت بی‌بهره نسازید و از طریق راه‌های ارتباطی که در انتهای نشریه آورده شده با ما در ارتباط باشید.

با سپاس فراوان

راهنما

- COT چیست؟ گزارش تعهد معامله گران (COT) یک گزارش هفتگی است که مجموع دارایی‌های بازیگران مختلف در بازار آتی ایالات متحده را نشان می‌دهد.
- این گزارش تغییرات ایجاد شده در موقعیت‌های معاملاتی باز معامله گران بازار فیوچرز یا آتی از جمله معامله گران بزرگ، سفته‌بازهای کوچک و سفته‌بازهای بزرگ را نشان می‌دهد.
- داده‌های گزارش COT توسط کمیسیون معاملات آتی کالای ایالات متحده آمریکا (CFTC) گردآوری و منتشر می‌شود.
- این گزارش منبع بسیار مفیدی برای ارزیابی احساسات بازار است و اساساً یکی از استفاده‌های آن در تحلیل سنتیمنتال و پیدا کردن رد پول هوشمند است. در نگارش تفسیر این گزارش تمرکز بر تمایلات گروه غیرتجاری است، زیرا این گروه از معامله گران صرفاً به قصد انتفاع مالی از نوسانات قیمت وارد معامله می‌شوند.
- گزارش COT هر جمعه در ساعت ET 3:30 منتشر می‌شود و بیانگر تعهدات معامله گران تا سه‌شنبه قبل است.

- گزارش COT کل موقعیت‌های باز شده توسط سه نوع معامله گر مختلف زیر را به تفکیک نشان می‌دهد:
 - معامله گران تجاری یا Commercial traders در فارکس، معمولاً هیچ فاند‌ها
 - معامله گران غیرتجاری یا Non-commercial traders معمولاً سفته‌بازان بزرگ
 - غیر قابل گزارش (معمولاً معامله گران خرد)
- قراردادهای باز یا به بیان دیگر، بهره باز به معنی مجموع تمامی قراردادهای آتی و اختیار معامله است که منعقد شده‌اند اما هنوز با انواع روش‌های تراکنش، تحویل، اجرا و غیره آفست نشده‌اند. این ارقام خالص نیستند، بلکه حجم کلی (یعنی بهره) را نشان می‌دهند.
- نمودار تغییرات قیمت: نمودار تغییرات قیمت نشان دهنده انعکاس رفتار معامله گران در قیمت کالا بوده است.
- درصد قراردادهای باز: درصد قراردادهای باز نشان می‌دهد که چه مقدار از کل قراردادهای آتی در حال حاضر باز است. درصد بالاتر نشان می‌دهد که بازار نسبتاً فعال است، در حالی که درصد کمتر نشان می‌دهد که بازار نسبتاً غیرفعال است.
- تغییرات در پوزیشن‌های خرید و فروش: تغییرات در پوزیشن‌های خرید و فروش می‌تواند نشان دهنده تغییر در تمایلات بازار باشد. افزایش پوزیشن‌های خرید نشان می‌دهد که خریداران نسبت به بازار خوشبین‌تر شده‌اند، در حالی که افزایش پوزیشن‌های فروش نشان می‌دهد که فروشندگان نسبت به بازار بدبین‌تر شده‌اند.

درباره ما

ما در صدد گرد هم آوری خدمات مطلوب با استفاده از فناوری‌های نوین برای سهولت کار معامله گران هستیم. به همین منظور از تخصص و تجربه‌هایمان استفاده کردیم تا ایده‌های جدیدی را برایتان به ارمغان بیاوریم.

ایسن ارائه دهنده جامع‌ترین خدمات بازارهای مالی

سایت: www.iecen.ir

تقویم اقتصادی: www.forexfactory.live

پل‌های ارتباطی: <https://bio.site/iecen>