



نشریه هفتگی

گزارش تعهد معامله گران

به زبان فارسی به همراه تفسیر

COT - Commitments of Traders

❖ تاریخ انتشار: یکشنبه ۶ خرداد ۱۴۰۳

❖ سال دوم / شماره ۳۱

❖ 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: 21 می 24 - ۱ خرداد ۰۳

تاریخ انتشار: 24 می 24 - ۴ خرداد ۰۳

دلار کانادا (CAD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 090741

[بازگشت به فهرست](#)

ارزش قراردادهای باز: 17,177,443,576 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 234,491				اندازه قراردادهای 100,000 دلار کانادا				
30,044	29,011	204,447	205,480	72,434	164,291	5,790	126,223	35,399
تغییرات در قراردادهای باز: +13,651				تغییرات				
-365	-3,481	+14,016	+17,132	+3,028	+16,665	-646	+11,634	+1,113
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
12.8%	12.4%	87.2%	87.6%	30.9%	70.1%	2.5%	53.8%	15.1%
تعداد کل معامله گران: 128				تعداد معامله گران در هر دسته				
		92	62	41	40	11	47	15

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 5.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 90,824 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 10,521 قرارداد افزایش فروش بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.70 و نسبت به کل 0.41 است.
- قراردادهای باز با 13,651 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 3,116 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای دلار کانادا رقم خورده است.

- چکیده این هفته: روند غیرتجاری ها همچون هفته قبل بود و حدود 11 هزار قرارداد فروش را افزایش دادند اما از آنجایی که تجاری ها حدود 20 هزار قرارداد جدید افزودند که بیش از 16 هزار فقره از آن مربوط به فروش بود، سهم غیرتجاری ها از بازار کمی کاهش پیدا کرد.

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: 12,940,927,760 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 94,270				اندازه قراردادهای 125,000 فرانک سوئیس				
22,377	11,669	71,893	82,601	22,558	73,911	1,002	48,333	7,688
تغییرات در قراردادهای باز: +3,569				تغییرات				
+594	+548	+2,975	+3,021	+2,582	+2,166	-187	+580	+1,042
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
23.7%	12.4%	76.3%	87.6%	23.9%	78.4%	1.1%	51.3%	8.2%
تعداد کل معامله گران: 64				تعداد معامله گران در هر دسته				
		43	30	22	19	2	20	10

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 40,645 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 462 قرارداد افزایش خرید بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.60 و نسبت به کل 0.37 است .
- قراردادهای باز با 3,569 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 46 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای فرانک سوئیس رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها بیش از 1500 قرارداد جدید افزودند که هزار فقره از آن مربوط به قرارداد خرید بود، تجاری ها نیز بیش از 4 هزار قرارداد جدید داشتند که تقریباً بصورت برابر به قراردادهای خرید و فروش افزودند. با توجه به اینکه حجم سرمایه گذاری های تجاری ها بیشتر بود سهم غیرتجاری ها از بازار کمی 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: 17,786,774,070 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 223,976				اندازه قراردادهای پوند انگلیس 62,500				
29,882	28,849	194,094	195,127	111,417	111,397	15,192	67,485	68,538
تغییرات در قراردادهای باز: +734				تغییرات				
-2,707	+2,980	+3,441	-2,246	+295	-26,520	+4,410	-1,264	+19,864
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
13.3%	12.9%	86.7%	87.1%	49.7%	49.7%	6.8%	30.1%	30.6%
تعداد کل معامله گران: 118				تعداد معامله گران در هر دسته				
		91	56	51	27	13	34	21

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 1٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 1,053 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 21,128 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.68 و نسبت به کل 0.39 است.
- قراردادهای باز با 734 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل نیز در این هفته 5,687 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای پوند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها حدود 20 هزار قرارداد خرید جدید افزودند. این تغییر برخلاف روند ماه قبل آنها بوده، در حالیکه در خلال ماه گذشته تمایل آنها به افزایش قراردادهای فروش و کاهش قراردادهای خرید بوده است. با توجه به این تغییر و کاهش 26 هزار فقره ای قراردادهای خرید گروه تجاری سهم غیرتجاری ها از بازار افزایش قابل توجهی داشت.

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: 24,129,909,027 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 301,315				اندازه قراردادهای ین ژاپن 12,500,000				
43,489	41,339	257,826	259,976	77,907	224,424	5,938	173,981	29,614
تغییرات در قراردادهای باز: +3,709				تغییرات				
-3,069	+1,893	+6,778	+1,816	-5,241	+7,982	-477	+12,496	-5,689
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
14.4%	13.7%	85.6%	86.3%	25.9%	74.5%	2.0%	57.7%	9.8%
تعداد کل معامله گران: 155				تعداد معامله گران در هر دسته				
		104	82	44	53	13	56	20

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 1.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 144,367 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 18,185 قرارداد افزایش فروش بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.69 و نسبت به کل 0.40 است.
- قراردادهای باز با 3,709 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 4,962 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای ین رقم خورد.
- چکیده این هفته: این هفته هم برای ین تغییر چشمگیری را مشاهده نمی کنیم ولی همین تغییرات بر خلاف روند هفته های گذشته بوده بطوریکه غیرتجاری ها بیش از 12 هزار قرارداد فروش افزودند و بیش از 5 هزار قرارداد خرید را تسویه نمودند، تجاری ها نیز حدود 8 هزار قرارداد خرید افزودند و بیش از 5 هزار قرارداد فروش تسویه نمودند.
- نکته مهم قابل توجه در ماه اخیر روند کاهش سرمایه گذاری در ین نماد بوده است.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: ین 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: 88,581,457,786 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 653,081				اندازه قراردادهای 125,000 یورو				
50,326	78,304	602,755	574,777	447,571	378,118	14,085	141,099	182,574
تغییرات در قراردادهای باز: -3,721				تغییرات				
-5,019	+1,832	+1,298	-5,553	+21,477	-9,694	-35	-20,144	+4,176
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
7.7%	12.0%	92.3%	88.0%	68.5%	57.9%	2.2%	21.6%	28.0%
تعداد کل معامله گران: 293				تعداد معامله گران در هر دسته				
		169	211	88	117	36	61	78

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته کمتر از 1٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 41,475 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 24,320 قرارداد کاهش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.41 و نسبت به کل 0.28 است.
- قراردادهای باز با 3,721 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 6,851 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای یورو رقم خورده است.
- چکیده این هفته: برابند 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. از آنجایی که سهم سرمایه گذاری تجاری ها در این هفته افزایش داشت و غیرتجاری ها نیز مشغول تسویه بیش از 20 هزار قرارداد فروش خود بودند، سهم شان از بازار کمی کاهش یافت.

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: 13,093,766,182 USD

غیر تجاری		تجاری		کل		غیر قابل گزارش	
خرید	فروش	اسپرد	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید
اندازه قراردادهای 100,000 دلار استرالیا				قراردادهای باز: 196,609			
50,536	106,769	2,223	115,463	63,870	168,222	28,387	23,747
تغییرات				تغییرات در قراردادهای باز: -5,189			
+10,477	-10,461	-2,039	-16,133	+9,416	-7,695	+2,506	-2,105
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران							
25.7%	54.3%	1.1%	58.7%	32.5%	85.6%	14.4%	12.1%
تعداد معامله گران در هر دسته				تعداد کل معامله گران: 108			
32	26	9	34	29	72	58	

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 2٪ کاهش است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 56,233 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 20,938 قرارداد افزایش خرید بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.89 و نسبت به کل 0.46 است.
- قراردادهای باز با 5,189 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 4,611 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای دلار استرالیا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: تمایل غیرتجاری ها در ماه اخیر منعطف به افزایش قراردادهای خرید و کاهش قراردادهای فروش است که این روند در این هفته هم ادامه یافت و آنها بیش از 10 هزار قرارداد خرید افزودند و بیش از 10 هزار قرارداد فروش را تسویه نمودند. تجاری ها هم حدود 16 هزار قرارداد خرید تسویه نمودند و بیش از 9 هزار قرارداد فروش افزودند. در نتیجه این تغییرات سهم غیرتجاری ها از بازار کمی افزایش یافت. نکته قابل توجه دیگر روند کاهشی قراردادهای باز در ماه اخیر است.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

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

دلار نیوزلند (NZD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 112741

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 2,987,548,200 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 49,105				اندازه قراردادهای 100,000 دلار نیوزلند				
4,632	3,258	44,473	45,847	20,317	23,061	187	23,969	22,599
تغییرات در قراردادهای باز: -6,535				تغییرات				
-13	-425	-6,522	-6,110	+28	-9,390	-35	-6,515	+3,315
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
9.4%	6.6%	90.6%	93.4%	41.4%	47.0%	0.4%	48.8%	46.0%
تعداد کل معامله گران: 92				تعداد معامله گران در هر دسته				
		55	51	23	21	8	29	25

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 12٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 1,370 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 9,830 قرارداد افزایش خرید بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 1.07 و نسبت به کل 0.51 است.
- قراردادهای باز با 6,535 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این 412 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای دلار نیوزلند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: بر خلاف هفته گذشته، در این هفته شاهد تغییراتی هستیم که موجب شد ارزش قراردادهای باز 12 درصد کاهش بیابد. تمایل غیرتجاری ها در ماه های اخیر معطوف به کاهش قراردادهای فروش و افزایش قراردادهای خرید بوده است و در این هفته نیز بیش از 6 هزار قرارداد فروش تسویه شد و بیش از 3 هزار قرارداد خرید نیز افزوده شد. تجاری ها نیز در این هفته بیش از 9 هزار قرارداد خرید خود را تسویه نمودند. در مجموع حاصل این تغییرات موجب افزایش سهم تجاری 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: 20,659,397,490 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 103,626				اندازه قراردادهای \$5 * شاخص داوجونز				
13,061	15,500	90,565	88,126	76,615	53,739	3,660	10,291	30,728
تغییرات در قراردادهای باز: +4,419				تغییرات				
+1,663	+698	+2,756	+3,721	+432	-3,267	+1,000	+1,325	+5,989
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
12.6%	15.0%	87.4%	85.0%	73.9%	51.9%	3.5%	9.9%	29.7%
تعداد کل معامله گران: 110				تعداد معامله گران در هر دسته				
		58	76	27	33	15	20	39

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 20,437 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 4,664 قرارداد افزایش خرید بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.34 و نسبت به کل 0.25 است.
- قراردادهای باز با 4,419 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 965 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای شاخص داوجونز رقم خورده است.
- چکیده این هفته: روند افزایش در قراردادهای خرید گروه غیرتجاری با حدود 6 هزار قرارداد جدید برای سومین هفته متوالی ادامه یافت، همچنین آنها بیش از 2 هزار فقره قرارداد فروش و اسپرد نیز افزودند و در مقابل تجاری ها حدود 3 هزار قرارداد خرید را تسویه نمودند. ماحصل این تغییرات منجر به افزایش سهم غیرتجاری ها از بازار شد.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: شاخص داو جونز - فیوچر
 نمودار خطی نارنجی: DJI - سهام
 پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتی
 خطوط عمودی: زمان انتشار گزارش
 لبیل قیمت: آخرین قیمت در زمان انتشار گزارش
 تایم فریم 4 ساعته

شاخص نزدک (NASDAQ-100) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 20974+

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 86,935,260,160 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 258,244				اندازه قراردادهای \$20 * شاخص نزدک				
36,808	47,452	221,436	210,792	149,583	133,043	9,360	62,493	68,390
تغییرات در قراردادهای باز: +1,497				تغییرات				
-761	+3,415	+2,257	-1,918	+4,371	-1,403	-337	-1,776	-178
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
14.3%	18.4%	85.7%	81.6%	57.9%	51.5%	3.6%	24.2%	26.5%
تعداد کل معامله گران: 308				تعداد معامله گران در هر دسته				
		181	208	100	111	41	57	79

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 2.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 5,897 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 1,598 قرارداد کاهش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.49 و نسبت به کل 0.32 است.
- قراردادهای باز با 1,496 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 4,175 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای شاخص نزدک رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در این هفته مشغول تسویه قراردادهای خود بالاخص قراردادهای فروش خود به میزان 1,776 قرارداد بودند و در مقابل تجاری ها بیش از 4 هزار قرارداد فروش افزودند و بیش از هزار قرارداد خرید خود را تسویه نمودند و در نتیجه سهم غیرتجاری ها به میزان کمی از بازار کاهش داشت. نکته مهم قابل اشاره در بلند مدت (دو ماه اخیر) برای این نماد این است که شاهد تغییر جهت داری در تمایلات گروه ها بالاخص غیرتجاری ها نیستیم.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: شاخص نزدک - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: NDX - سهام
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتهای
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: 456,018,000,000 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 4,560,180				اندازه قراردادهای 100,000 دلار امریکا ارزش اسمی				
397,790	409,931	4,162,390	4,150,249	3,006,381	3,395,212	261,534	894,475	493,503
تغییرات در قراردادهای باز: +117,950				تغییرات				
-15,102	+869	+133,052	+117,081	-20,679	+16,511	+129,418	+24,313	-28,848
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
8.7%	9.0%	91.3%	91.0%	65.9%	74.5%	5.7%	19.6%	10.8%
تعداد کل معامله گران: 416				تعداد معامله گران در هر دسته				
		297	296	203	213	45	74	58

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 2.5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 400,972 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 53,161 قرارداد افزایش فروش بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.25 و نسبت به کل 0.20 است.
- قراردادهای باز با 117,950 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 15,971 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای این نماد رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در این هفته افزایش در قراردادهای فروش و اسپرد داشتند که تعداد قراردادهای اسپرد اضافه شده بالغ بر 129 هزار فقره است و میزان قابل توجهی است. آنها همچنین حدود 29 هزار قرارداد خرید خود را تسویه نمودند. تجاری ها هم با کاهش در قراردادهای فروش و افزایش قراردادهای خرید با برابری حدود 37 هزار قرارداد افزایش خرید به کار خود پایان دادند. این تغییرات موجب مثبت شدن روند سرمایه گذاری در این نماد در طی دو ماه اخیر شد و سهم غیرتجاری ها نیز از بازار افزایش پیدا کرد.

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 آمریکا (USD INDEX) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 098662

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 4,170,841,600 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 39,920				اندازه قراردادهای 1,000 دلار آمریکا * شاخص دلار				
2,559	3,126	37,361	36,794	11,474	7,389	1,113	24,774	28,292
تغییرات در قراردادهای باز: -2,897				تغییرات				
+379	-409	-3,276	-2,488	-788	-1,083	-15	-2,473	-1,390
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
6.4%	7.8%	93.6%	92.2%	28.7%	18.5%	2.8%	62.1%	70.9%
تعداد کل معامله گران: 108				تعداد معامله گران در هر دسته				
		37	80	6	7	7	27	70

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 7.5٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 3,518 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 1,083 قرارداد کاهش فروش بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 2.87 و نسبت به کل 0.73 است.
- قراردادهای باز با 2,897 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 788 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای شاخص دلار رقم خورده است.
- چکیده این هفته: در این هفته تمام گروه ها مشغول تسویه قراردادهای خرید و فروش خود بودند که سهم قراردادهای فروش تسویه شده توسط غیرتجاری ها بیشتر از فروش بود و در مقابل هم سهم قراردادهای تسویه شده خرید برای تجاری ها بیشتر بود. با این تغییرات برای سومین هفته متوالی شاهد کاهش سرمایه گذاری در شاخص دلار هستیم و همچنین افزایش اندکی در سهم غیرتجاری ها از بازار.

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: 10,693,329,190 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 30,694				اندازه قراردادهای 5 بیتکوین				
818	1,586	29,876	29,108	1,191	1,313	4,597	24,088	23,198
تغییرات در قراردادهای باز: +3,617				تغییرات				
-103	+67	+3,720	+3,550	-329	+214	+1,216	+2,833	+2,120
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
2.7%	5.2%	97.3%	94.8%	3.9%	4.3%	15.0%	78.5%	75.6%
تعداد کل معامله گران: 131				تعداد معامله گران در هر دسته				
		84	85	8	4	36	65	55

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 22٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 890 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 713 قرارداد افزایش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 20.62 و نسبت به کل 0.88 است.
- قراردادهای باز با 3,617 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 170 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای بیتکوین رقم خورده است.
- چکیده این هفته: افزایش قابل توجه 22 درصدی ارزش قراردادهای باز در این هفته هم مربوط به افزایش نرخ بیتکوین بود هم افزایش سرمایه گذاری در گروه غیرتجاری با افزودن حدود 6 هزار قرارداد که حدود 3 هزار فقره از آن مربوط به قراردادهای فروش، 2 هزار فقره قرارداد خرید و هزار فقره قرارداد اسپرد بود. این تغییرات باعث افزایش سهم غیرتجاری ها نسبت تجاری ها نیز شد.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: بیتکوین - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: BTC - کریپتوکارنسی
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتهای
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: 12,606,113,760 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 161,286				اندازه قراردادهای 1,000 بشکه				
24,848	17,452	136,438	143,834	103,182	76,737	6,395	26,861	60,702
تغییرات در قراردادهای باز: +4,796				تغییرات				
+239	+364	+4,557	+4,432	+3,350	+3,726	+1,381	-174	-675
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
15.4%	10.8%	84.6%	89.2%	64.0%	47.6%	4.0%	16.7%	37.6%
تعداد کل معامله گران: 51				تعداد معامله گران در هر دسته				
		44	41	33	33	8	7	4

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 33,841 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 501 قرارداد کاهش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.52 و نسبت به کل 0.33 است.
- قراردادهای باز با 4,796 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 125 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای نفت رقم خورده است.
- چکیده این هفته: رفتار این هفته بازیگران نفت شبیه به هفته گذشته بود با این تفاوت که مقدار تغییرات نسبت به هفته قبل کمتر بود و برای دومین هفته متوالی باعث کاهش سهم غیرتجاری ها از بازار شد. همچنین روند کاهشی در سرمایه گذاری در نفت که تا دو هفته قبل ادامه داشت در این دو هفته پایان یافته و برابند افزایش 10 هزار قرارداد باز را برای این دو هفته شاهد هستیم.

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: 128,440,163,370 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 530,591				اندازه قراردادهای 100 اونس تروی				
26,407	55,264	504,184	475,327	377,177	118,514	56,084	70,923	300,729
تغییرات در قراردادهای باز: +7,639				تغییرات				
+1,388	+2,631	+6,251	+5,008	+11,484	-15,069	-3,010	-2,223	+23,087
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
5.0%	10.4%	95.0%	89.6%	71.1%	22.3%	10.6%	13.4%	56.7%
تعداد کل معامله گران: 333				تعداد معامله گران در هر دسته				
		174	283	61	44	89	64	193

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 4٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 229,806 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 25,310 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.86 و نسبت به کل 0.43 است.
- قراردادهای باز با 7,639 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,243 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای طلا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها با افزایش 23 هزار فقره قرارداد خرید و تسویه بیش از 2 هزار قرارداد فروش قدم به افزایش تمایل خود نسبت به طلا گذاشتند و در مقابل آنها تجاری ها بیش از 15 هزار قرارداد خرید را تسویه و بیش از 11 هزار قرارداد فروش افزودند. با این تغییرات سهم غیرتجاری ها از بازار 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: 29,898,113,850 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 186,945				اندازه قراردادهای 5,000 اونس تروی				
11,461	34,911	175,484	152,034	130,517	47,423	10,470	34,497	94,141
تغییرات در قراردادهای باز: +15,574				تغییرات				
+687	+2,176	+14,887	+13,398	+7,563	+5,891	+1,302	+6,022	+6,205
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
6.1%	18.7%	93.9%	81.3%	69.8%	25.4%	5.6%	18.5%	50.4%
تعداد کل معامله گران: 263				تعداد معامله گران در هر دسته				
		146	202	54	38	61	53	140

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 18٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 59,644 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 183 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.78 و نسبت به کل 0.42 است.
- قراردادهای باز با 15,574 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 1,489 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای نقره رقم خورده است.
- چکیده این هفته: افزایش 18 درصدی در ارزش قراردادهای باز نشان از افزایش سرمایه گذاری در نقره برای دومین هفته متوالی است. غیرتجاری ها با افزایش حدود 12 هزار قرارداد بصورت تقریباً برابر برای قراردادهای خرید فروش و تجاری ها با افزایش بیش از 13 هزار قرارداد که 7,563 قرارداد آن مربوط به قراردادهای فروش بود تغییرات این هفته را رقم زدند. این تغییرات موجب افزایش سهم غیرتجاری ها از بازار 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 سی و یکمین 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.

پیشنهادهای 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 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 3:30 ET منتشر می‌شود و بیانگر تعهدات معامله گران تا سه‌شنبه قبل است.

- گزارش COT کل موقعیت‌های باز شده توسط سه نوع معامله‌گر 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 معامله‌گران 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 نشان‌دهنده 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>