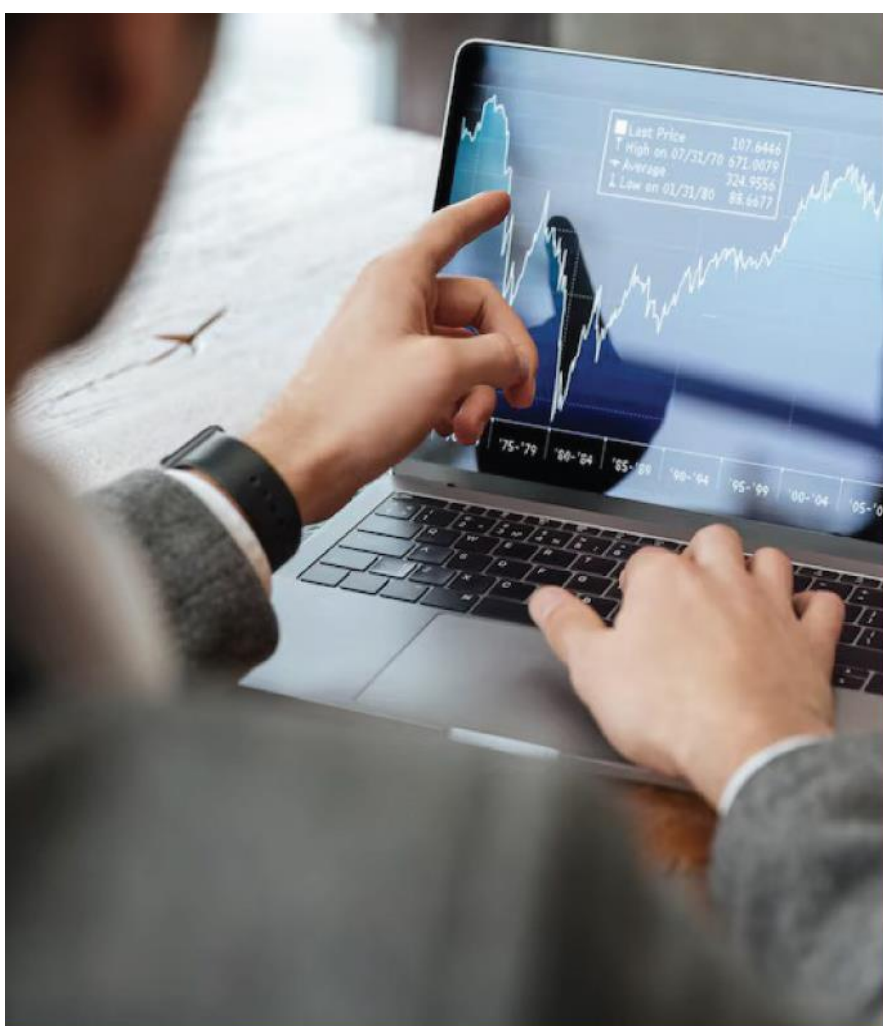




نشریه هفتگی

گزارش تعهد معامله گران

به زبان فارسی به همراه تفسیر

COT - Commitments of Traders

❖ تاریخ انتشار: یکشنبه ۱۳ خرداد ۱۴۰۳

❖ سال دوم / شماره ۳۲

❖ 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: 28 می 24 - 8 خرداد 03

تاریخ انتشار: 31 می 24 - 11 خرداد 03

دلار کانادا (CAD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 090741

[بازگشت به فهرست](#)

ارزش قراردادهای باز: 19,382,390,241 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 264,401				اندازه قراردادهای 100,000 دلار کانادا				
33,169	29,401	231,232	235,000	99,392	189,745	7,956	123,884	37,299
تغییرات در قراردادهای باز: +29,910				تغییرات				
+3,125	+390	+26,785	+29,520	+26,958	+25,454	+2,166	-2,339	+1,900
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
12.5%	11.1%	87.5%	88.9%	37.6%	71.8%	3.0%	46.9%	14.1%
تعداد کل معامله گران: 124				تعداد معامله گران در هر دسته				
		91	62	43	38	13	45	14

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 11٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 86,585 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 4,239 قرارداد افزایش خرید بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.58 و نسبت به کل 0.36 است.
- قراردادهای باز با 29,910 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 2,735 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای دلار کانادا رقم خورده است.

- چکیده این هفته: این هفته هفته تجاری ها بود، آنها با اضافه کردن بیش از 51 هزار قرارداد خرید و فروش که حدود 27 هزار فقره از آن مربوط به قراردادهای فروش بود، باعث تغییرات زیادی شدند. من جمله افزایش 11 درصدی ارزش قراردادهای باز و کاهش چشمگیر سهم غیرتجاری ها از بازار.

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: 13,752,781,218 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 100,381				اندازه قراردادهای 125,000 فرانک سوئیس				
23,123	9,553	77,258	90,828	23,062	80,998	887	53,309	8,943
تغییرات در قراردادهای باز: +6,111				تغییرات				
+746	-2,116	+5,365	+8,227	+504	+7,087	-115	+4,976	+1,255
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
23.0%	9.5%	77.0%	90.5%	23.0%	80.7%	0.9%	53.1%	8.9%
تعداد کل معامله گران: 71				تعداد معامله گران در هر دسته				
		45	37	22	22	4	21	13

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 6٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 44,366 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 3,721 قرارداد افزایش 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 6,111 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 2,862 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای فرانک سوئیس رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها حدود 5 هزار قرارداد فروش و 1,255 قرارداد خرید افزودند و در مقابل تجاری ها بیش از 7 هزار قرارداد خرید جدید افزودند که قابل توجه ترین نکات این هفته بودند. همچنین این تغییرات باعث رشد 6 درصدی ارزش قراردادهای باز شد ولی سهم گروه ها از بازار تغییر قابل توجهی نداشت.

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: 21,430,717,133 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 268,749				اندازه قراردادهای پوند انگلیس 62,500				
26,861	33,632	241,888	235,117	150,282	118,109	23,967	67,639	93,041
تغییرات در قراردادهای باز: +44,773				تغییرات				
-3,021	+4,783	+47,794	+39,990	+38,865	+6,712	+8,775	+154	+24,503
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
10.0%	12.5%	90.0%	87.5%	55.9%	43.9%	8.9%	25.2%	34.6%
تعداد کل معامله گران: 126				تعداد معامله گران در هر دسته				
		89	70	49	34	15	31	29

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 17٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 25,402 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 24,349 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 44,773 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل نیز در این هفته 7,804 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای پوند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها روند جدیدی که از هفته قبل شکل گرفته را با افزایش بیش از 24 هزار قرارداد خرید جدید ادامه دادند و در مقابل نیز تجاری ها با افزایش حدود 39 هزار قرارداد فروش به روند جدید خود مبنی بر کاهش قراردادهای خرید و افزایش قراردادهای فروش ادامه دادند. اما تغییرات بصورتی ایجاد شد که بالانس بازار تغییری نیافت و سهم گروه ها از بازار تقریباً بدون تغییر باقی ماند. نکته با اهمیت این هفته افزایش سرمایه گذاری روی پوند است که باعث افزایش 17 درصدی ارزش قراردادهای باز شد.

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: 25,873,917,250 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 325,231				اندازه قراردادهای ین ژاپن 12,500,000				
52,407	42,324	272,824	282,907	80,789	246,911	7,431	184,604	28,565
تغییرات در قراردادهای باز: +23,916				تغییرات				
+8,918	+985	+14,998	+22,931	+2,882	+22,487	+1,493	+10,623	-1,049
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
16.1%	13.0%	83.9%	87.0%	24.8%	75.9%	2.3%	56.8%	8.8%
تعداد کل معامله گران: 161				تعداد معامله گران در هر دسته				
		108	82	44	52	13	60	21

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 7٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 156,039 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 11,672 قرارداد افزایش فروش بیشتر را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.67 و نسبت به کل 0.39 است.
- قراردادهای باز با 23,916 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 7,933 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای ین رقم خورد.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها برای دومین هفته متوالی از قراردادهای خرید خود کاستند و به قراردادهای فروش خود افزودند. آنها بیش از 10 هزار قرارداد فروش افزودند و در مقابل تجاری ها با افزایش بیش از 22 هزار قرارداد خرید نقطه مقابل تمایل غیرتجاری ها بودند. با این تغییرات سهم غیرتجاری ها به مقدار کمی کاهش یافت و با حجم سرمایه گذاری این هفته به نظر روند کاهش سرمایه گذاری در ین با افزایش حدود 7 درصدی ارزش قراردادهای باز پایان یافت.

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: 90,226,200,200 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 664,864				اندازه قراردادهای 125,000 یورو				
52,769	79,849	612,095	585,015	464,876	380,224	20,135	127,084	184,656
تغییرات در قراردادهای باز: +11,783				تغییرات				
+2,443	+1,545	+9,340	+10,238	+17,305	+2,106	+6,050	-14,015	+2,082
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
7.9%	12.0%	92.1%	88.0%	69.9%	57.2%	3.0%	19.1%	27.8%
تعداد کل معامله گران: 288				تعداد معامله گران در هر دسته				
		165	211	88	118	37	56	77

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 2٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 57,572 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 16,097 قرارداد کاهش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.39 و نسبت به کل 0.27 است.
- قراردادهای باز با 11,783 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 898 قرارداد افزایش 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. تمایل این گروه در ماه اخیر کاملاً معطوف به خرید و کاهش سرمایه گذاری در یورو بوده است و تجاری ها نیز در نقطه مقابل آنها همچنان در حال افزایش قراردادهای فروش خود هستند. با این تغییرات سهم غیرتجاری ها 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

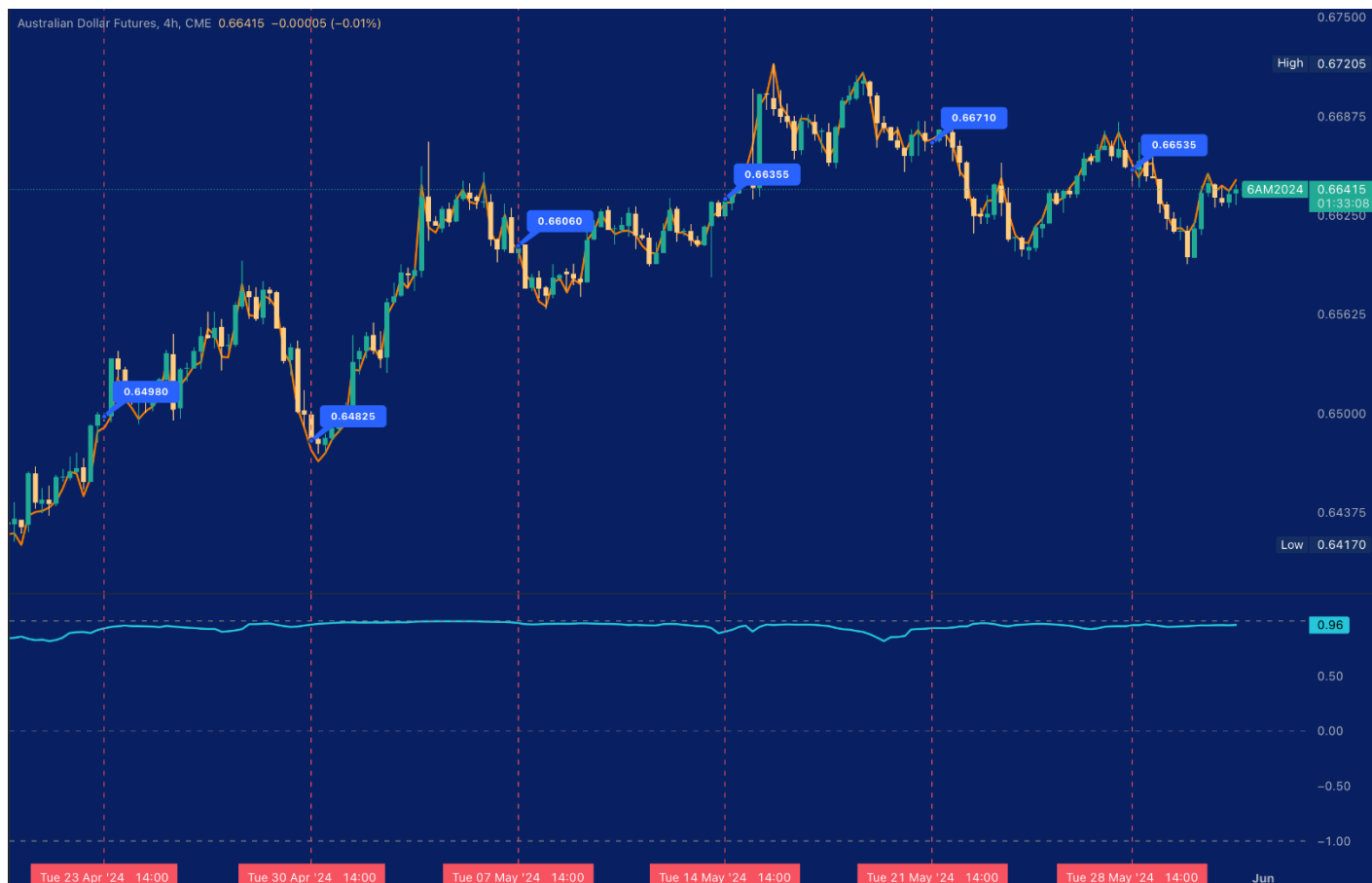
ارزش قراردادهای باز: 12,875,907,118 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 193,678				اندازه قراردادهای 100,000 دلار استرالیا				
23,860	24,416	169,818	169,262	62,849	112,209	3,161	103,808	53,892
تغییرات در قراردادهای باز: -2,931				تغییرات				
+113	-3,971	-3,044	+1,040	-1,021	-3,254	+938	-2,961	+3,356
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
12.3%	12.6%	87.7%	87.4%	32.5%	57.9%	1.6%	53.6%	27.8%
تعداد کل معامله گران: 105				تعداد معامله گران در هر دسته				
		60	72	28	32	12	26	34

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 2٪ کاهش است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 49,916 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری 6,317 قرارداد افزایش خرید بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.92 و نسبت به کل 0.47 است.
- قراردادهای باز با 2,931 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 4,084 قرارداد کاهش فروش 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 3 هزار قرارداد خرید افزودند و حدود 3 هزار قرارداد فروش را تسویه نمودند. تجاری ها هم بیش از 3 هزار قرارداد خرید و هزار قرارداد فروش را تسویه نمودند. 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 مارکتهای
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: 3,530,539,350 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 57,525				اندازه قراردادهای 100,000 دلار نیوزلند				
3,954	3,687	53,571	53,838	26,792	25,013	1,909	24,870	26,916
تغییرات در قراردادهای باز: +8,420				تغییرات				
-678	+429	+9,098	+7,991	+6,475	+1,952	+1,722	+901	+4,317
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
6.9%	6.4%	93.1%	93.6%	46.6%	43.5%	3.3%	43.2%	46.8%
تعداد کل معامله گران: 97				تعداد معامله گران در هر دسته				
		52	60	22	21	9	27	33

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 15٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 2,046 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری 3,416 قرارداد افزایش خرید بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 1.03 و نسبت به کل 0.50 است.
- قراردادهای باز با 8,420 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این 1,107 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای دلار نیوزلند رقم خورده است.
- چکیده این هفته: روال افزایش در قراردادهای خرید توسط غیرتجاری ها در این هفته هم با افزایش بیش از 4 هزار قرارداد ادامه یافت. تجاری ها هم بیش از 8 هزار قرارداد افزودند که سهم قراردادهای فروش بیش از 6 هزار فقره بود. با این تغییرات ارزش قراردادهای باز بیش از 15٪ افزایش داشت و سهم غیرتجاری ها از بازار کمی کاسته 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: 18,890,425,180 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 97,243				اندازه قراردادهای \$5 * شاخص داوجونز				
10,961	15,471	86,282	81,772	71,055	53,401	6,086	9,141	22,285
تغییرات در قراردادهای باز: -6,383				تغییرات				
-2,100	-29	-4,283	-6,354	-5,560	-338	+2,426	-1,150	-8,443
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
11.3%	15.9%	88.7%	84.1%	73.1%	54.9%	6.3%	9.4%	22.9%
تعداد کل معامله گران: 90				تعداد معامله گران در هر دسته				
		54	61	27	31	15	17	25

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 9٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 13,144 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 7,293 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 6,383 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 2,071 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای شاخص داوجونز رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها بیش از 8 هزار قرارداد خرید را تسویه نمودند، و تجاری ها نیز بیش از 6 هزار قرارداد فروش را تسویه نمودند که این موارد تغییرات مهم این هفته را رقم زدند و در مجموع این تغییرات باعث کاهش 10 درصدی ارزش قراردادهای باز و کاهش سهم غیرتجاری ها از بازار شد.

نمودار تغییرات قیمت



راهنما نمودار

نمودار شمعی: شاخص داوجونز - فیوچر
نمودار خطی نارنجی: DJI - سهام
پنجره پایین: میزان همبستگی بین مارکتهای
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

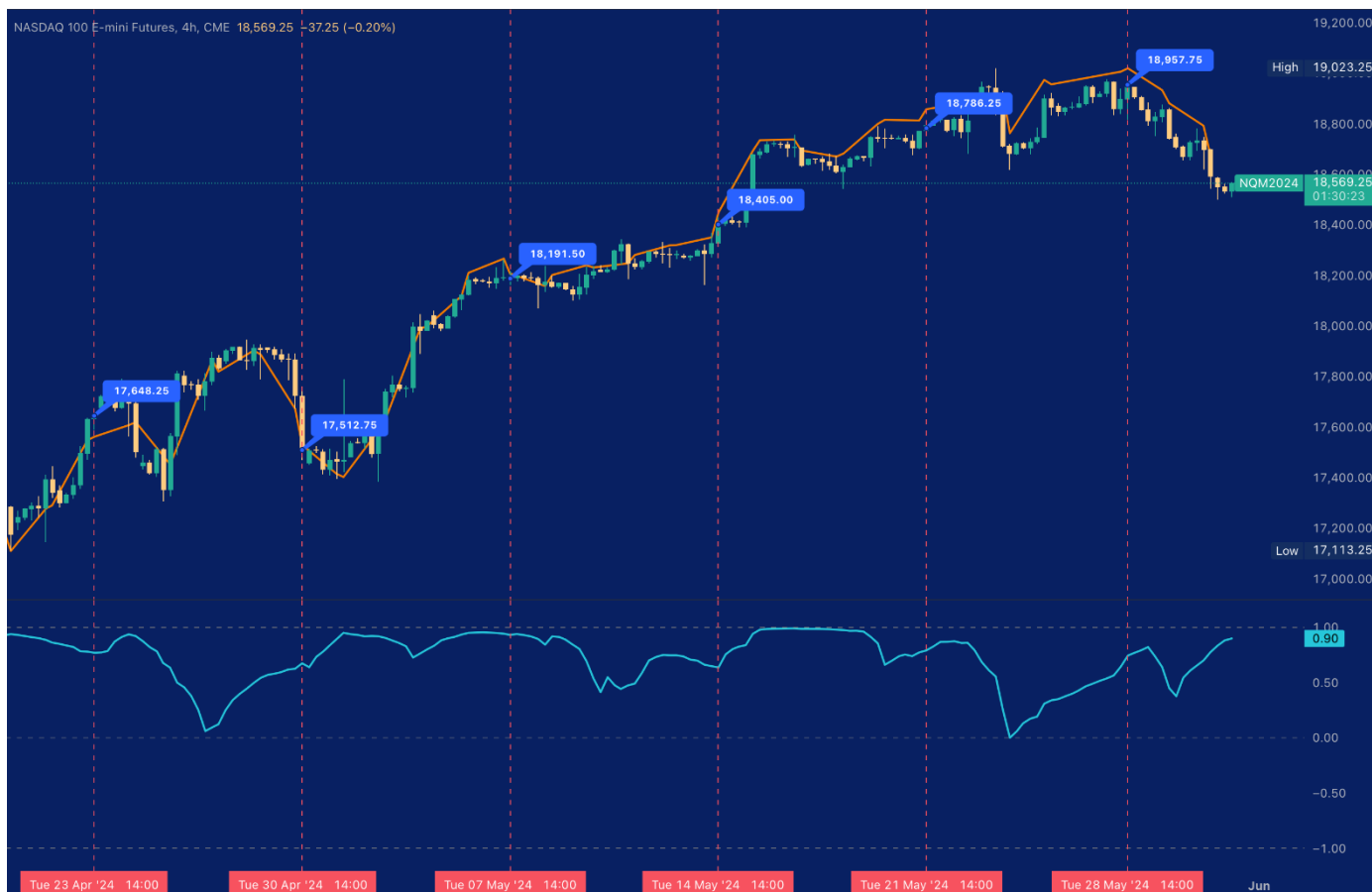
ارزش قراردادهای باز: 90,514,402,400 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 265,906				اندازه قراردادهای \$20 * شاخص نزدک				
40,734	49,207	225,172	216,699	145,704	139,288	8,956	70,512	68,455
تغییرات در قراردادهای باز: +7,662				تغییرات				
+3,926	+1,755	+3,736	+5,906	-3,879	+6,245	-404	+8,019	+65
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
15.3%	18.5%	84.7%	81.5%	54.8%	52.4%	3.4%	26.5%	25.7%
تعداد کل معامله گران: 322				تعداد معامله گران در هر دسته				
		186	222	104	114	43	56	89

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 4٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 2,057 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 7,954 قرارداد کاهش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.52 و نسبت به کل 0.33 است.
- قراردادهای باز با 7,662 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 2,171 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای شاخص نزدک رقم خورده است.
- چکیده این هفته: هفته قبل اشاره کردیم که در رفتار دو ماه اخیر گروه غیرتجاری شاهد تمایل به جهتی نیستیم ولی در این هفته غیرتجاری ها با افزایش 8 هزار قرارداد فروش بالانس قراردادهای خرید و فروش خود را به سمت فروش سوق دادند. البته این تغییر نمی تواند مبنای تصمیم گیری باشد ولی سیگنالی از کنترل هر چه بیشتر رفتار قیمت نزدک می تواند باشد. با تغییرات این هفته سهم غیرتجاری ها از بازار هم کمی افزایش یافت.

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: 490,185,400,000 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 4,901,854				اندازه قراردادهای 100,000 دلار امریکا ارزش اسمی				
450,751	485,757	4,451,103	4,416,097	3,167,241	3,520,410	397,367	886,495	498,320
تغییرات در قراردادهای باز: +341,674				تغییرات				
+52,961	+75,826	+288,713	+265,848	+160,860	+125,198	+135,833	-7,980	+4,817
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
9.2%	9.9%	90.8%	90.1%	64.6%	71.8%	8.1%	18.1%	10.2%
تعداد کل معامله گران: 412				تعداد معامله گران در هر دسته				
		295	311	194	214	59	71	64

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 7٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 388,175 قرارداد به سمت فروش است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری در این هفته 12,797 قرارداد کاهش فروش بیشتر است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.26 و نسبت به کل 0.20 است.
- قراردادهای باز با 341,674 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 22,865 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای این نماد رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها در این هفته 135 هزار قرارداد اسپرد افزودند و تغییرات قراردادهای خرید و فروش شان ناچیز بود. تجاری ها اما بالغ بر 285 هزار قرارداد جدید افزودند که سهم قراردادهای فروش بیش از 160 هزار قرارداد بود. برای دومین هفته متوالی شاهد افزایش سرمایه گذاری در این نماد هستیم که منجر به افزایش 7 درصدی ارزش قراردادهای باز 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 آمریکا (USD INDEX) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 098662

بازگشت به فهرست

ارزش قراردادهای باز: 4,190,082,760 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 40,108				اندازه قراردادهای 1,000 دلار آمریکا * شاخص دلار				
2,359	3,621	37,749	36,487	12,462	7,026	1,136	24,151	28,325
تغییرات در قراردادهای باز: +188				تغییرات				
-200	+495	+388	-307	+988	-363	+23	-623	+33
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
5.9%	9.0%	94.1%	91.0%	31.1%	17.5%	2.8%	60.2%	70.6%
تعداد کل معامله گران: 107				تعداد معامله گران در هر دسته				
		38	77	8	8	6	26	67

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته تقریباً بدون تغییر باقی مانده است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 4,174 قرارداد به سمت خرید است.
- برآیند تغییرات در گروه غیرتجاری 656 قرارداد کاهش فروش بیشتر بوده است.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 2.74 و نسبت به کل 0.72 است.
- قراردادهای باز با 188 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 695 قرارداد افزایش فروش بیشتری برای شاخص دلار رقم خورده است.
- چکیده این هفته: شاخص دلار هفته کم تلاطمی را پشت سر گذاشت و شاهد تغییرات خاصی در این نماد نیستیم. تنها نکته قابل ذکر ادامه دار بودن روند تمایلات گروه ها همچون هفته های قبل تر بود منتها در ابعاد کوچکتر.

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: 10,328,300,625 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 30,255				اندازه قراردادهای 5 بیتکوین				
859	1,763	29,396	28,492	1,362	1,214	4,517	23,517	22,761
تغییرات در قراردادهای باز: -439				تغییرات				
+41	+177	-480	-616	+171	-99	-80	-571	-437
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
2.8%	5.8%	97.2%	94.2%	4.5%	4.0%	14.9%	77.7%	75.2%
تعداد کل معامله گران: 122				تعداد معامله گران در هر دسته				
		77	77	9	4	29	56	54

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 3.5٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 756 قرارداد به سمت فروش است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 134 قرارداد کاهش فروش بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 19.74 و نسبت به کل 0.87 است.
- قراردادهای باز با 439 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 136 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای بیتکوین رقم خورده است.
- چکیده این هفته: بیتکوین هفته بی سر و صدایی را پشت سر گذاشت. در طی این هفته غیرتجاری ها حدود هزار فقره از قراردادهای خود را تسویه نمودند که سهم قراردادهای فروش تسویه شده 571 فقره بود. سایر تغییرات هم همانطور که مشاهده می کنید قابل توجه نیستند.

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: 13,265,276,800 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 165,320				اندازه قراردادهای 1,000 بشکه				
24,978	17,571	140,342	147,749	106,999	79,815	6,403	26,940	61,531
تغییرات در قراردادهای باز: +4,034				تغییرات				
+130	+119	+3,904	+3,915	+3,817	+3,078	+8	+79	+829
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
15.1%	10.6%	84.9%	89.4%	64.7%	48.3%	3.9%	16.3%	37.2%
تعداد کل معامله گران: 51				تعداد معامله گران در هر دسته				
		44	42	33	34	8	7	4

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 5٪ افزایش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 34,591 قرارداد به سمت خرید است.
- برابری تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 750 قرارداد افزایش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.50 و نسبت به کل 0.33 است.
- قراردادهای باز با 4,034 قرارداد بیشتر نسبت به هفته قبل افزایش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 11 قرارداد افزایش خرید بیشتری برای نفت رقم خورده است.
- چکیده این هفته: تجاری ها در سومین هفته متوالی مشغول افزایش در قراردادهای خرید و فروش بودند و میزان بالانس قراردادهای افزود شده نیز تقریباً در تمام سه هفته برابر بوده است. غیرتجاری ها اما 829 قرارداد خرید افزودند که برخلاف رفتار سه هفته گذشته شان بود. با تغییرات انجام شده سهم غیرتجاری ها از بازار کمی کاهش یافت.

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: 114,561,480,000 USD

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 485,430				اندازه قراردادهای 100 اونس تروی				
27,163	51,528	458,267	433,902	370,131	109,181	37,984	50,152	286,737
تغییرات در قراردادهای باز: -45,161				تغییرات				
+756	-3,736	-45,917	-41,425	-7,046	-9,333	-18,100	-20,771	-13,992
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
5.6%	10.6%	94.4%	89.4%	76.2%	22.5%	7.8%	10.3%	59.1%
تعداد کل معامله گران: 316				تعداد معامله گران در هر دسته				
		167	261	56	39	81	63	187

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 12٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 236,585 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 6,779 قرارداد کاهش فروش بیشتری را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.78 و نسبت به کل 0.42 است.
- قراردادهای باز با 45,161 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 4,492 قرارداد کاهش فروش بیشتری برای طلا رقم خورده است.
- چکیده این هفته: در این هفته شاهد تسویه قراردادها در تمام گروه ها بودیم و حجم بالایی از قراردادها تسویه شدند که باعث کاهش 12 درصدی ارزش قراردادهای باز شد. در این میان غیرتجاری ها حدود 52 هزار قرارداد خود را تسویه نمودند که سهم قراردادهای فروش تسویه شده بیش از 20 هزار فقره بود. این حجم تسویه قراردادهای گروه غیرتجاری باعث کاهش سهم آنها از بازار شد.

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: 184,846				اندازه قراردادهای 5,000 اونس تروی				
11,816	35,705	173,030	149,141	127,002	45,930	11,481	34,547	91,730
تغییرات در قراردادهای باز: -2,099				تغییرات				
+355	+794	-2,454	-2,893	-3,515	-1,493	+1,011	+50	-2,411
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
6.4%	19.3%	93.6%	80.7%	68.7%	24.8%	6.2%	18.7%	49.6%
تعداد کل معامله گران: 251				تعداد معامله گران در هر دسته				
		140	197	53	39	61	51	130

تفسیر

- ارزش قراردادهای باز نسبت به هفته گذشته حدود 1٪ کاهش داشته است.
- اختلاف بین قراردادهای خرید و فروش گروه غیرتجاری 57,183 قرارداد به سمت خرید است.
- برابند تغییرات در گروه غیرتجاری نیز 2,461 قرارداد کاهش خرید بیشتری را نشان می دهد.
- نسبت قراردادهای باز گروه غیرتجاری به تجاری 0.79 و نسبت به کل 0.42 است.
- قراردادهای باز با 2,099 قرارداد کمتر نسبت به هفته قبل کاهش داشته است.
- در بخش تغییرات کل در این هفته 439 قرارداد کاهش خرید بیشتری برای نقره رقم خورده است.
- چکیده این هفته: غیرتجاری ها بیش از 2 هزار قرارداد خرید را تسویه نمودند و تجاری ها هم حدود 5 هزار قرارداد تسویه نمودند که حدود 3 و 500 فقره از آن مربوط به قراردادهای فروش بود. در مجموع تغییرات این هفته نقره چشمگیر نبودند.

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 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 دومین 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 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 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 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 فناوری های نوین برای سهولت کار معامله گران هستیم. به همین منظور از تخصص و تجربه هایمان استفاده کردیم تا ایده های جدیدی را برایتان به ارمغان بیاوریم.

ایسن ارائه دهنده جامع ترین خدمات بازارهای مالی

سایت: www.iecen.ir

تقویم اقتصادی: www.forexfactory.live

پل های ارتباطی: <https://bio.site/iecen>