

~~۳۰,۰۰۰ تومان~~

رایگان

گزارش فارسی تعهد معامله گران به همراه تفسیر – تهیه شده در تحریریه ایسن

تاریخ انتشار: یکشنبه ۲۸ آبان ۱۴۰۲

سال اول / شماره ۴

صاحب امتیاز: انتشارات ایسن

مدیر مسئول: مرتضی خلیج عبادی

قیمت: ۳۰,۰۰۰ تومان (۱\$)



فهرست

- دلار کانادا – CAD ۲
- فرانک سوئیس – CHF ۳
- پوند انگلیس – GBP ۴
- ین ژاپن – JPY ۵
- یورو – EUR ۶
- دلار استرالیا – AUD ۸
- دلار نیوزلند – NZD ۹
- شاخص داو جونز – DJIX ۱۰
- شاخص نزدک – NASDAQ-100 ۱۱
- اوراق قرضه ۱۰ ساله امریکا – UST 10Y NOTE ۱۲
- شاخص دلار امریکا – USD INDEX ۱۳
- بیتکوین – BITCOIN ۱۵
- نفت وست تگزاس – WTI ۱۶
- طلا – GOLD ۱۷
- نقره – SILVER ۱۸
- راهنما ۲۰
- درباره ما ۲۱

گزارش تعهد معامله گران (COT)

تاریخ ایجاد: 14 نوامبر 23

تاریخ انتشار: 17 نوامبر 23

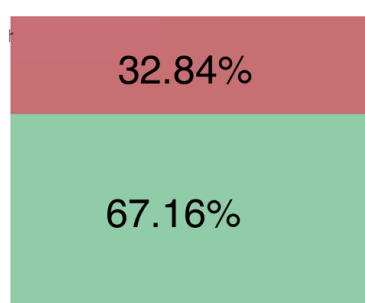
دلار کانادا (CAD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

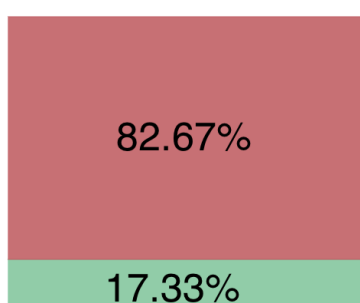
کد - 090741

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 206,046				اندازه قراردادهای 100,000 دلار کانادا				
36,499	29,204	169,547	176,842	74,345	152,043	6,121	89,081	18,678
تغییرات در قراردادهای باز: +5,682				تغییرات				
+67	-2,381	+5,615	+8,063	+1,641	+6,771	-215	+4,189	+1,507
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران				تعداد معامله گران در هر دسته				
17.7%	14.2%	82.3%	85.8%	36.1%	73.8%	3.0%	43.2%	9.1%
تعداد کل معامله گران: 121				تعداد معامله گران در هر دسته				
		81	64	32	40	12	42	19

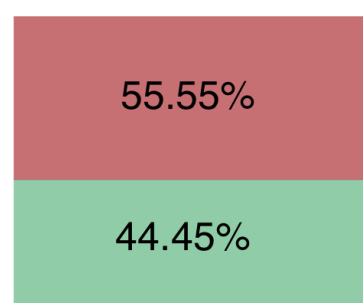
خرید در مقابل فروش



تجاری



غیرتجاری



غیرقابل گزارش

تفسیر

- تعداد قراردادهای باز روند افزایشی ملایمی داشته است

- در گروه تجاری، حجم خرید و فروش طی چند هفته اخیر نوسانات ملایمی داشته ولی تغییرات چشمگیری مشاهده نمی‌شود.
- در گروه غیرتجاری، حجم خرید در هفته آخر اندکی افزایش یافته است که البته تغییر قابل توجهی نیست.
- در مجموع، تغییرات عمده‌ای در جهت‌گیری بازار مشاهده نمی‌شود و به نظر تمایلات خرید و فروش طی چند هفته اخیر تقریباً ثابت مانده است.
- تغییرات حجم معاملات نسبت به دوره‌های قبل ملایم بوده و نوسانات قابل توجهی مشاهده نشده است.

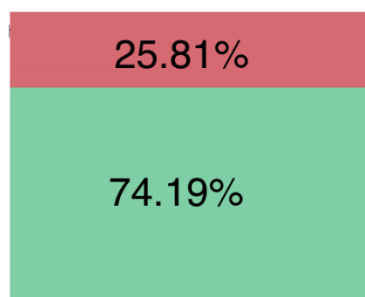
فرانک سوئیس (CHF) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

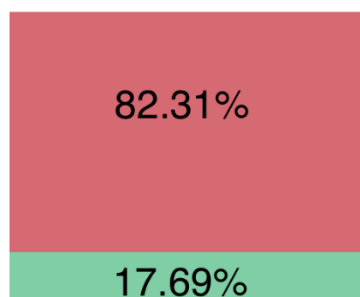
کد - 092741

غیر تجاری		تجاری		کل		غیر قابل گزارش	
خرید	فروش	اسپرد	خرید	فروش	خرید	خرید	فروش
اندازه قراردادهای 125,000 فرانک سوئیس				قراردادهای باز: 59,464			
5,515	25,666	97	42,240	14,697	47,852	11,612	19,004
تغییرات				تغییرات در قراردادهای باز: +2,708			
-2539	+50	+14	+3,012	+3,361	+487	+2,221	-717
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران							
9.3%	43.2%	0.2%	71.0%	24.7%	80.5%	19.5%	32.0%
تعداد معامله گران در هر دسته				تعداد کل معامله گران: 55			
7	19	3	18	15	27	35	

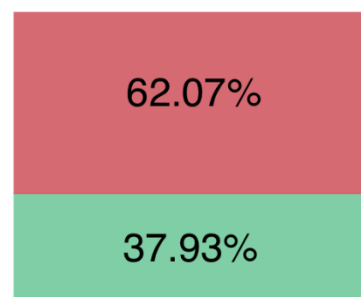
خرید در مقابل فروش



تجاری



غیرتجاری



غیرقابل گزارش

تفسیر

- تعداد کل قراردادهای باز نسبت به هفته قبل 2708 عدد افزایش یافته است که نشان از افزایش حجم معاملات بر روی فرانک است.
- معامله گران غیرتجاری نسبت به هفته قبل تمایل کمتری به خرید داشته اند و موقعیت خرید خود را 2539 قرارداد کاهش داده اند.
- معامله گران تجاری تمایل بیشتری به فروش داشته اند و موقعیت فروش خود را 3361 قرارداد افزایش داده اند.
- معامله گران غیرقابل گزارش نیز تمایل بیشتری به خرید داشته اند و موقعیت خرید خود را 2221 قرارداد افزایش داده اند.
- به نظر می رسد در این هفته انتظار افزایش ارزش فرانک سوئیس افزایش یافته است.

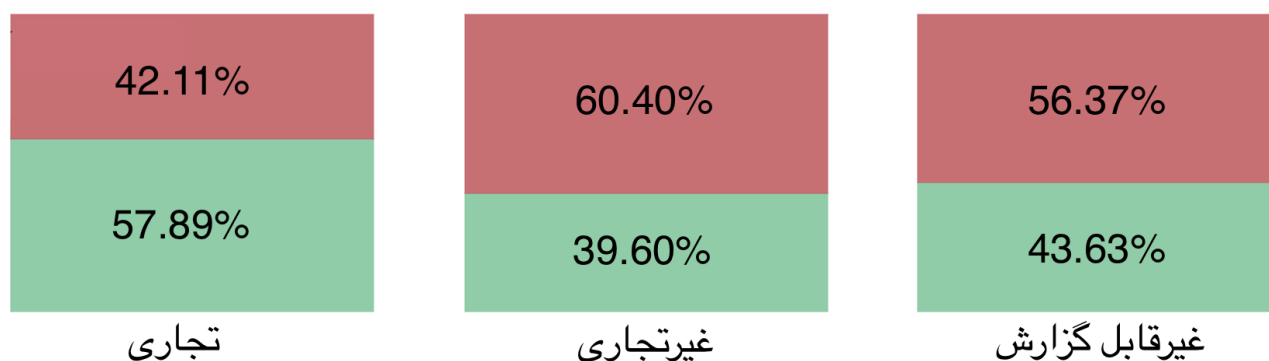
پوند انگلیس (GBP) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 096742

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 216,411				اندازه قراردادهای پوند انگلیس 62,500				
34,112	26,403	182,299	190,008	94,565	130,004	7,207	80,527	52,797
تغییرات در قراردادهای باز: +3,681				تغییرات				
-822	+4,383	+4,503	-702	-2,050	+4,223	-190	+6,743	-4,735
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
15.8%	12.2%	84.2%	87.8%	43.7%	60.1%	3.3%	37.2%	24.4%
تعداد کل معامله گران: 118				تعداد معامله گران در هر دسته				
		90	53	52	25	13	33	19

خرید در مقابل فروش



تفسیر

- در گروه غیرتجاری، تعداد قراردادهای فروش (80,527) بیشتر از قراردادهای خرید (52,797) بوده است. پس تمایل به فروش در این گروه بیشتر بوده است.
- در بخش تغییرات گروه غیرتجاری، در مجموع 11,478 قرارداد به سمت فروش تغییر کرده است. پس نسبت به دوره قبل تمایل به فروش در این گروه افزایش یافته است.
- با مقایسه تعداد کل قراردادهای خرید و فروش نسبت به دو هفته گذشته، مشاهده می شود که تمایل به فروش در گروه غیرتجاری رو به افزایش بوده است.
- قراردادهای باز در این دوره 3,681 افزایش یافته است که نشان دهنده افزایش سرمایه گذاری در این بازار است.
- با مقایسه تعداد قراردادهای باز نسبت به دو هفته گذشته، روند افزایشی سرمایه گذاری مشاهده می شود.
- در مجموع 3,801 قرارداد به سمت فروش افزایش یافته است. این نشان می دهد نسبت به دوره قبل تمایل به فروش در کل افزایش پیدا کرده است

ین ژاپن (JPY) - بورس کالای شیکاگو

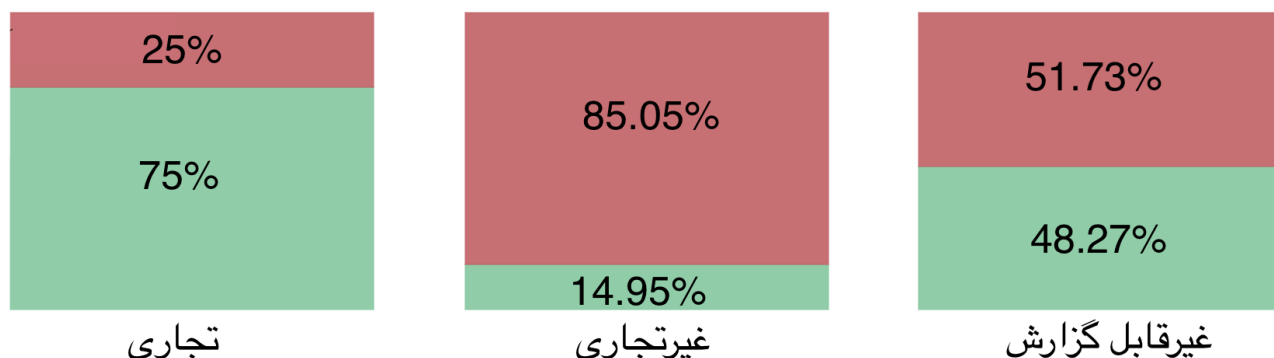
اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 097741

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 273,763				اندازه قراردادهای 12,500,000 ین ژاپن				
45,097	42,074	228,666	231,689	66,618	199,890	4,027	158,021	27,772
تغییرات در قراردادهای باز: +14,065				تغییرات				
-1,380	+3,514	+15,445	+10551	-11376	+9,939	+78	+26,743	+534
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								

16.5%	15.4%	83.5%	84.6%	24.3%	73.0%	1.5%	57.7%	10.1%
تعداد کل معامله گران: 153				تعداد معامله گران در هر دسته				
		97	84	43	52	9	53	24

خرید در مقابل فروش



تفسیر

در بخش غیرتجاری:

- تعداد قراردادهای خرید 27772 و فروش 158021 است که نشان می دهد تمایل به فروش بیشتر بوده است.
 - در بخش تغییرات، در مجموع 26209 واحد افزایش در فروش وجود داشته که نشان دهنده تمایل بیشتر به فروش است.
 - با مقایسه با دوره های قبل، روند افزایشی در تعداد قراردادهای فروش نسبت به خرید در این گروه مشاهده می شود.
- در بخش تغییرات قراردادهای باز:

- تغییرات در قراردادهای باز 14065 واحد افزایش یافته است که نشان دهنده تمایل بیشتر سرمایه گذاران به این ابزار است.
 - با مقایسه با دوره های قبل، رشد تدریجی در تعداد قراردادهای باز مشاهده می شود.
- در بخش تغییرات کل:

- در تغییرات، 4894 واحد افزایش در فروش وجود داشته که نشان دهنده تمایل بیشتر به فروش است.
- در مجموع، در این دوره تمایل بیشتری به **فروش** در بازار آتی شیکاگو دیده می شود.

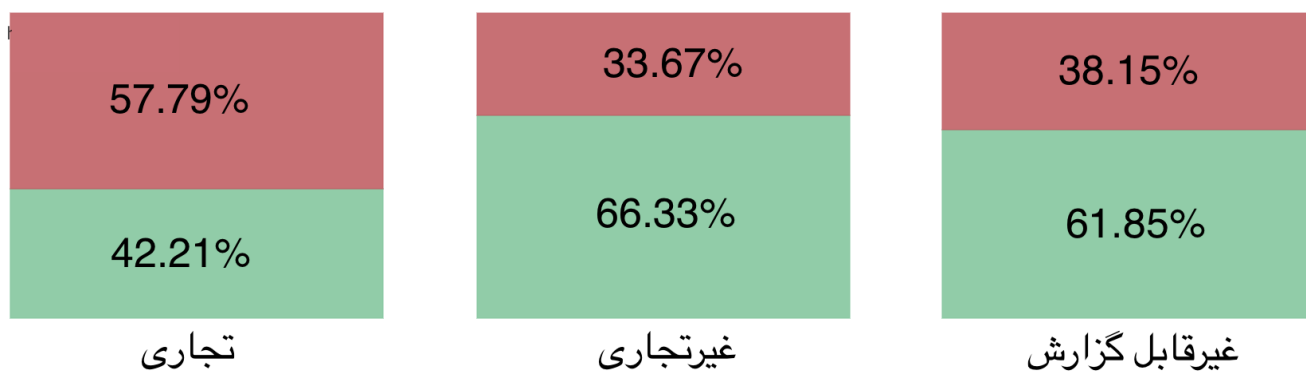
یورو (EUR) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 099741

غیر تجاری		تجاری		کل		غیر قابل گزارش	
خرید	فروش	اسپرد	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید
اندازه قراردادهای 125,000 یورو				قراردادهای باز: 702,463			
221,190	112,283	15,794	381,765	522,752	618,749	83,714	51,634
تغییرات				تغییرات در قراردادهای باز: +4,839			
+8,707	-11,144	+3,283	-8,571	+14,901	+3,419	+7,040	+1,420
-2201							
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران							
31.5%	16.0%	2.2%	54.3%	74.4%	88.1%	92.6%	11.9%
7.4%							
تعداد معامله گران در هر دسته				تعداد کل معامله گران: 295			
85	51	36	121	84	218	159	

خرید در مقابل فروش



تفسیر

در بخش غیرتجاری:

- تعداد قراردادهای خرید 221,190 و فروش 112,283 بوده است. پس تمایل به خرید بیشتر بوده است.
- در بخش تغییرات، تمایل به خرید 19,931 قرارداد افزایش داشته است.
- در طول 3 هفته گذشته، تعداد قراردادهای خرید غیرتجاری روند افزایشی و فروش روند کاهشی داشته است.
- تعداد قراردادهای باز 4839 افزایش داشته است که نشان دهنده افزایش سرمایه گذاری است.

- در 3 هفته گذشته، تعداد قراردادهای باز روند نوسانی داشته است.
- در بخش تغییرات کل، تمایل به فروش 3621 قرارداد بیشتر بوده است.

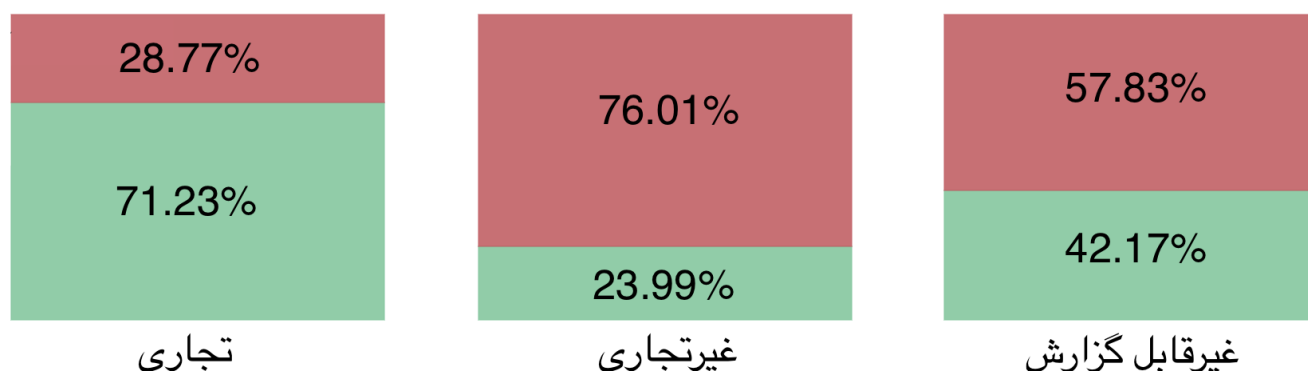
دلار استرالیا (AUD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 232741

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 197,469				اندازه قراردادهای 100,000 دلار استرالیا				
29,919	21,818	167,550	175,651	53,582	132,639	10,284	103,684	32,728
تغییرات در قراردادهای باز: +4,973				تغییرات				
+446	+49	+4,527	+4,924	-20	+5,770	+475	+4,072	-1,321
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
15.2%	11.0%	84.8%	89.0%	27.1%	67.2%	5.2%	52.5%	16.6%
تعداد کل معامله گران: 107				تعداد معامله گران در هر دسته				
		68	61	26	27	12	37	27

خرید در مقابل فروش



تفسیر

با توجه به گزارش مربوط به هفته آخر نوامبر:

در گروه غیرتجاری، تعداد قراردادهای فروش (103,684) بیشتر از خرید (32,728) بوده است، بنابراین تمایل به فروش در این گروه وجود داشته است. همچنین در بخش تغییرات، قراردادهای فروش 4,072 افزایش و خرید 1,321 کاهش

داشته است. با مقایسه با گزارش‌های دو هفته قبل مشخص می‌شود که در بلندمدت نیز تمایل بیشتر به سمت فروش در این گروه وجود داشته است.

تعداد کل قراردادهای باز نسبت به هفته قبل 4,973 عدد افزایش یافته است که نشان‌دهنده جذب سرمایه بیشتر در این بازار است. با مقایسه با دوره‌های قبل نیز مشخص است که روند افزایشی در تعداد قراردادهای باز وجود داشته است.

در مجموع، در بخش تغییرات قراردادهای خرید کل 4,924 افزایش و فروش 4,527 افزایش داشته است. این نشان می‌دهد تمایل کمی بیشتر به سمت خرید در کل بازار وجود داشته است.

به طور کلی می‌توان گفت علی‌رغم تمایل به فروش در گروه غیرتجاری، در مجموع جذب سرمایه در این بازار افزایش یافته و تمایل به خرید نیز بیشتر شده است.

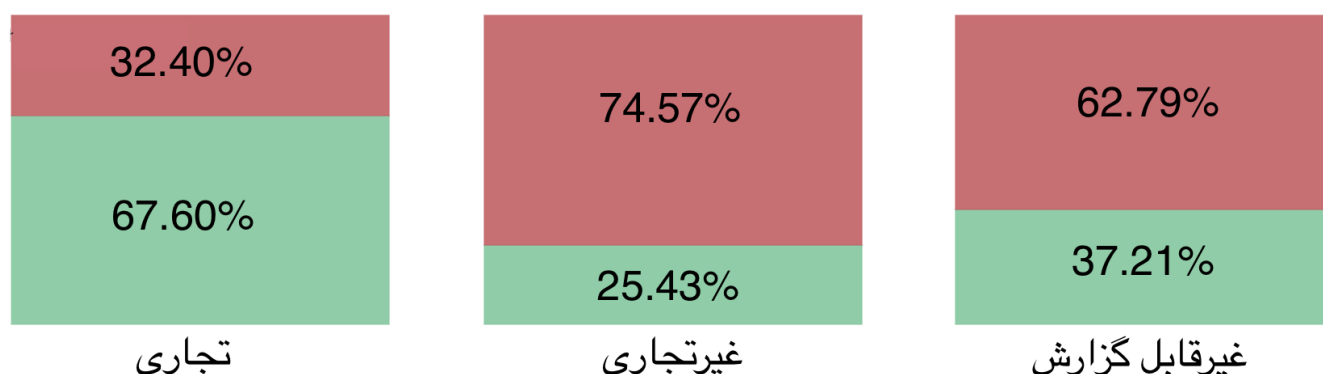
دلار نیوزلند (NZD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 112741

غیر تجاری		تجاری		کل		غیر قابل گزارش	
خرید	فروش	اسپرد	خرید	فروش	خرید	فروش	فروش
اندازه قراردادهای 100,000 دلار نیوزلند				قراردادهای باز: 49,906			
8,818	25,852	1,164	36,817	14,647	46,799	3,107	5,243
تغییرات				تغییرات در قراردادهای باز: -1,095			
-581	+1,513	+41	-615	-2,412	-1,155	+60	-237
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران							
17.7%	51.8%	2.3%	73.8%	35.4%	93.8%	6.2%	10.5%
تعداد معامله گران در هر دسته				تعداد کل معامله گران: 90			
18	35	7	19	25	42	62	

خرید در مقابل فروش



تفسیر

در بخش غیرتجاری:

- تعداد قراردادهای خرید 8,818 و فروش 25,852 بوده است. بنابراین تمایلات به سمت فروش بیشتر بوده است.
- در بخش تغییرات، در مجموع 1932 قرارداد به سمت فروش تغییر کرده است که نشان دهنده تمایل بیشتر به فروش نسبت به دوره قبل است.
- با مقایسه با دو هفته گذشته، تمایلات این گروه بیشتر به سمت فروش بوده است.

در بخش قراردادهای باز:

- تعداد قراردادهای باز نسبت به دوره قبل 1095 عدد کاهش داشته است که نشان دهنده خروج سرمایه از این ابزار است. همچنین در طی دو هفته گذشته تعداد قراردادهای باز کاهشی بوده است.

در مجموع:

- در بخش تغییرات کل، در مجموع 297 قرارداد به سمت خرید تغییر کرده است.

شاخص داوجونز (DJIA) - بورس کالای شیکاگو

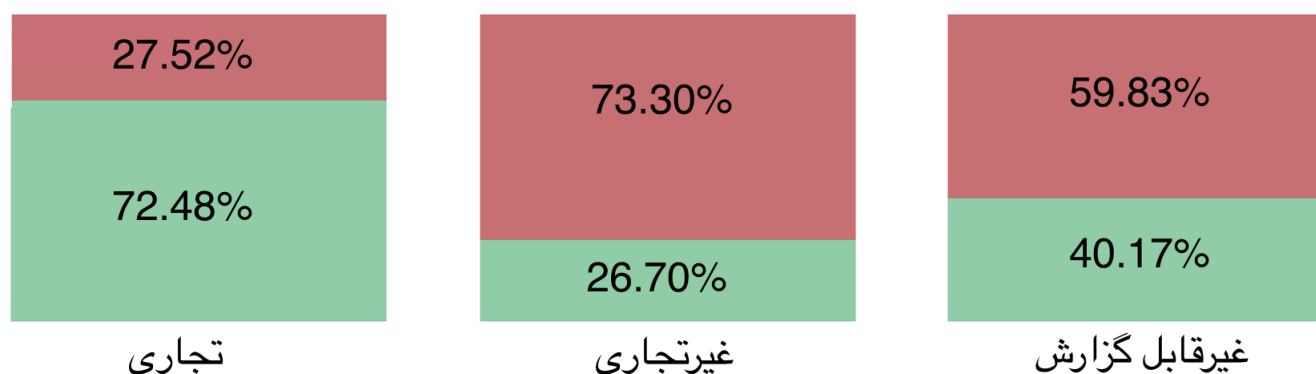
اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 12460+

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 101,030				اندازه قراردادهای 5\$ * شاخص داوجونز				
16,078	10,795	84,952	90,235	25,585	67,381	1,940	57,427	20,914
تغییرات در قراردادهای باز: -2,276				تغییرات				

-166	+34	-2,110	-2,310	-595	-1,358	+864	-2,379	-1,816
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
15.9%	10.7%	84.1%	89.3%	25.3%	66.7%	1.9%	56.8%	20.7%
تعداد کل معامله گران: 103				تعداد معامله گران در هر دسته				
		65	59	27	31	12	34	20

خرید در مقابل فروش



تفسیر

در گروه غیرتجاری:

- تعداد قراردادهای خرید 20,914 و فروش 57,427 است. پس تمایل به فروش بیشتر بوده است.
- در بخش تغییرات، در مجموع 563 قرارداد به فروش اضافه شده است. پس تمایل به فروش نسبت به هفته قبل افزایش یافته است.

در قراردادهای باز:

- تعداد قراردادهای باز 2276 کاهش داشته است که نشانه خروج سرمایه گذاران است. همچنین این روند کاهشی در دو هفته قبل هم مشاهده شده است.

در کل:

- در بخش تغییرات، در مجموع 200 قرارداد به خرید اضافه شده است. پس تمایل به خرید اندکی افزایش یافته است.

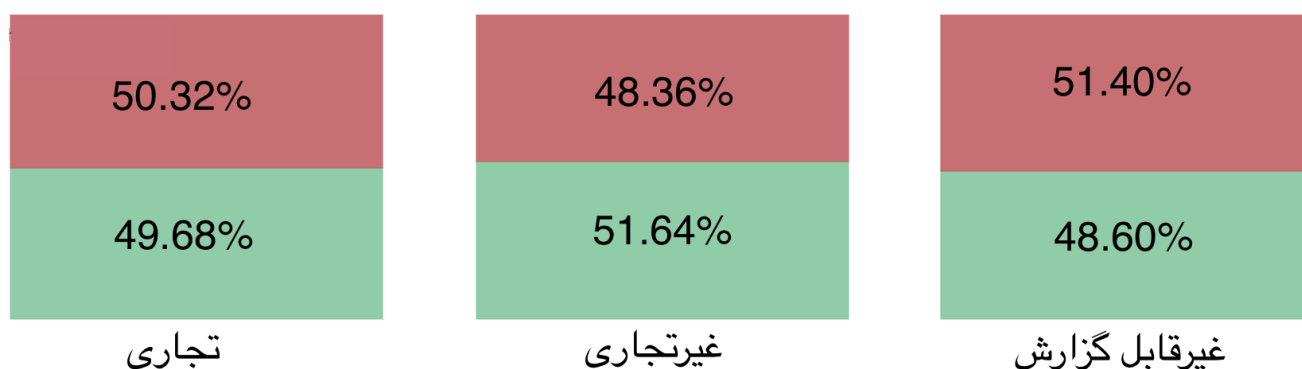
شاخص نزدک (NASDAQ-100) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 20974+

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 284,718				اندازه قراردادهای 20 \$ * شاخص نزدک				
44,427	42,007	240,291	242,711	160,832	158,806	13,848	65,611	70,058
تغییرات در قراردادهای باز: +5,495				تغییرات				
-4,486	+3,915	+9,981	+1,580	+5,133	+11,710	+2,677	+2,171	-12807
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
15.6%	14.8%	84.4%	85.2%	56.5%	55.8%	4.9%	23.0%	24.6%
تعداد کل معامله گران: 333				تعداد معامله گران در هر دسته				
		198	221	111	123	37	66	80

خرید در مقابل فروش



تفسیر

گروه غیرتجاری:

- میزان خرید 70,058 قرارداد و میزان فروش 65,611 قرارداد بوده است. پس تمایلات بیشتر به سمت خرید بوده است.
- در بخش تغییرات، در مجموع 15,578 قرارداد کاهش در خریدهای این گروه نسبت به هفته قبل مشاهده می شود.
- با مرور تغییرات در طی دو هفته گذشته، روند افزایشی در تعداد خریدها وجود دارد اما در این هفته کاهش قابل توجهی مشاهده می شود.

قراردادهای باز:

- تعداد قراردادهای باز 5,495 واحد افزایش یافته است که نشان دهنده جذب سرمایه بیشتر در این ابزار است.
- با بررسی تغییرات در طی دو هفته گذشته، رشد پیوسته ای در تعداد قراردادهای باز مشاهده می شود.

- در بخش تغییرات کل 8,401 قرارداد افزایش فروش نسبت به خرید مشاهده می شود.
- به طور کلی در این هفته تمایل به فروش در بین معامله گران افزایش یافته است.

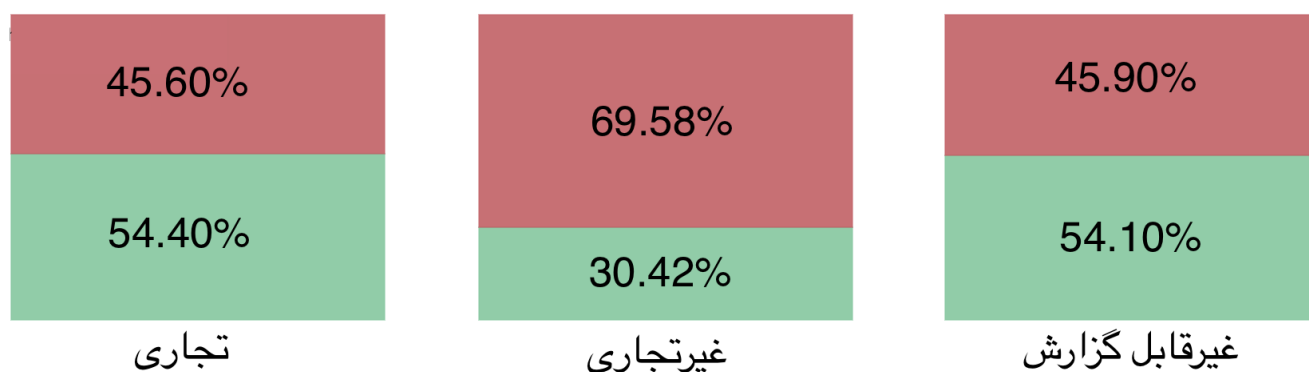
اوراق قرضه 10 ساله امریکا (UST 10Y NOTE) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 043602

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 4,743,217				اندازه قراردادهای 100,000 دلار امریکا ارزش اسمی				
369,673	435,784	4,373,544	4,307,433	3,088,727	3,684,382	108,942	1,175,875	514,109
تغییرات در قراردادهای باز: +116,981				تغییرات				
+9,777	-13,082	+107,204	+130,063	+24,020	+104,146	+13,244	+69,940	+12673
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
7.8%	9.2%	92.2%	90.8%	65.1%	77.7%	2.3%	24.8%	10.8%
تعداد کل معامله گران: 435				تعداد معامله گران در هر دسته				
		290	324	195	224	51	75	69

خرید در مقابل فروش



تفسیر

گروه غیرتجاری:

- تعداد قراردادهای خرید 514,109 و تعداد قراردادهای فروش 1,175,875 عدد بوده است که تمایل به سمت فروش است.
- در بخش تغییرات، در مجموع 57,267 قرارداد بیشتر به سمت فروش جابجایی صورت گرفته است.

- با مقایسه با دو دوره قبل، روند افزایشی تمایل به خرید در این گروه مشاهده می‌شود.

قراردادهای باز:

- تعداد قراردادهای باز 116,981 عدد افزایش یافته است که نشان‌دهنده جذب سرمایه بیشتر سرمایه‌گذاران در این بازار است.
 - با مقایسه با دو دوره قبل، رشد قابل توجهی در تعداد قراردادهای باز مشاهده می‌شود.
 - در بخش تغییرات، در مجموع 22,859 عدد بیشتر به سمت خرید جابجایی صورت گرفته است.
- نتیجه‌گیری کلی: تمایل به سمت خرید اوراق قرضه دولت امریکا در همه گروه‌های معامله‌گران افزایش یافته و جذب سرمایه نیز روند رو به رشدی داشته است.

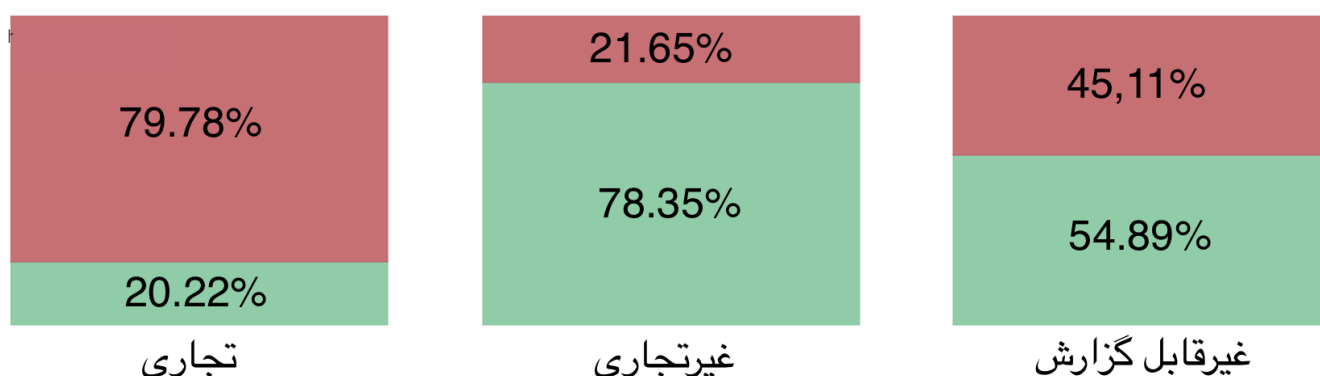
شاخص دلار امریکا (USD INDEX) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 098662

غیر تجاری		تجاری		کل		غیر قابل گزارش	
خرید	فروش	اسپرد	خرید	فروش	خرید	فروش	فروش
اندازه قراردادهای 1,000 دلار امریکا * شاخص دلار				قراردادهای باز: 38,842			
27,271	7,537	1,039	6,917	27,295	35,227	3,615	2,971
تغییرات				تغییرات در قراردادهای باز: -2,382			
-595	-858	-416	-1,083	-866	-2,094	-288	-242
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران				تعداد کل معامله گران: 100			
70.2%	19.4%	2.7%	17.8%	70.3%	90.7%	9.3%	7.6%
تعداد معامله گران در هر دسته				تعداد کل معامله گران: 100			
55	34	5	5	8	63	44	

خرید در مقابل فروش



تفسیر

در بخش غیرتجاری:

- تعداد قراردادهای خرید 27271 و فروش 7537 است. پس تمایل به خرید بیشتر بوده است.
- در بخش تغییرات، همچنان 263 قرارداد نسبت به دور قبل سمت خرید است.
- با مقایسه با دوره‌های قبلی، تعداد کل قراردادهای خرید و فروش در حال کاهش است. یعنی تمایل به معامله کمتر شده است.

در قراردادهای باز:

- تعداد قراردادهای باز 2382 عدد کاهش یافته است. پس سرمایه‌گذاران در حال خروج سرمایه هستند.
 - با مقایسه با دو دوره قبل نیز روند کاهشی در تعداد قراردادهای باز ادامه دارد.
 - در بخش تغییرات کل، در مجموع 46 قرارداد در سمت خرید بیشتر است.
- نتیجه‌گیری کلی: در این دوره نسبت به دوره قبل، تمایل به فروش بیشتر بوده و تعداد قراردادهای باز نیز کاهش یافته است که نشان‌دهنده خروج سرمایه سرمایه‌گذاران از این ابزار است. روند کاهشی نیز نسبت به دوره‌های گذشته ادامه دارد.

بیتکوین (BITCOIN) - بورس کالای شیکاگو

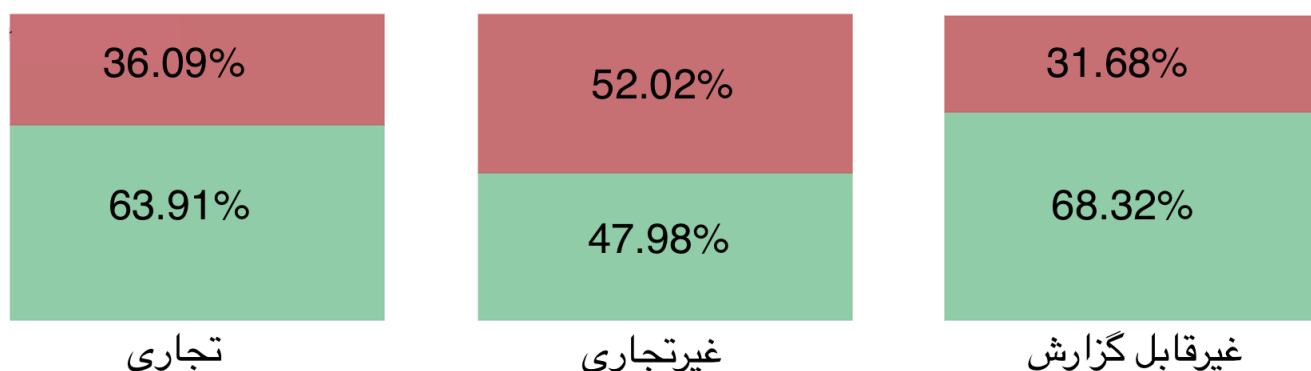
اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 133741

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 21,203				اندازه قراردادهای 5 بیتکوین				
746	1,609	20,457	19,594	624	1,105	2,550	17,283	15,939
تغییرات در قراردادهای باز: -546				تغییرات				

+49	+29	-595	-575	-13	-326	+1,065	-1,647	-1,314
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
3.5%	7.6%	96.5%	92.4%	2.9%	5.2%	12.0%	81.5%	75.2%
تعداد کل معامله گران: 131				تعداد معامله گران در هر دسته				
		74	86	8	4	28	48	69

خرید در مقابل فروش



تفسیر

در گروه غیرتجاری:

- تعداد قراردادهای فروش (17,283) بیشتر از خرید (15,939) بوده است، پس تمایل به سمت فروش بیشتر بوده است.
- در بخش تغییرات، 333 قرارداد بیشتر در فروش کاهش داشتیم که نشان می‌دهد تمایل به فروش بیشتر شده است.
- با مقایسه با دو دوره قبل، روند کاهشی تعداد قراردادهای خرید و فروش وجود داشته و تمایل به فروش بیشتر بوده است.

در قراردادهای باز:

- تعداد قراردادهای باز 546 کاهش یافته است که نشان دهنده خروج سرمایه‌گذاران است.
- در مجموع:
- 20 قرارداد بیشتر در بخش فروش کاهش داشتیم، پس تمایل به سمت فروش بیشتر شده است.
- در مجموع، تمایل به فروش در این دوره نسبت به دوره قبل افزایش یافته است.

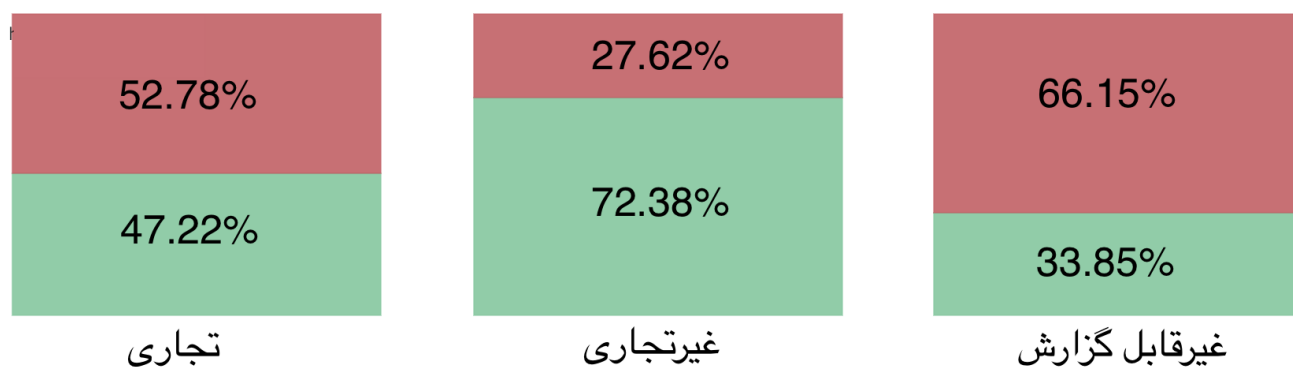
نفت وست تگزاس (WTI) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 06765A

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 154,774				اندازه قراردادهای 1,000 بارلر				
39,250	20,084	115,524	134,690	82,167	73,515	16,197	17,160	44,978
تغییرات در قراردادهای باز: +7,241				تغییرات				
-3,128	-278	+10,369	+7,519	+6,108	+4,181	+3,637	+624	-299
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
25.4%	13.0%	74.6%	87.0%	53.1%	47.5%	10.5%	11.1%	29.1%
تعداد کل معامله گران: 43				تعداد معامله گران در هر دسته				
		35	32	26	24	6	6	5

خرید در مقابل فروش



تفسیر

گروه غیرتجاری:

- تعداد قراردادهای خرید: ۴۴,۹۷۸ و تعداد قراردادهای فروش: ۱۷,۱۶۰. تعداد بیشتری قرارداد خرید وجود دارد پس تمایل به خرید بیشتر است
- در بخش تغییرات، در مجموع ۹۲۳ قرارداد افزایش فروش داریم که نشان از تمایل بیشتر به فروش نسبت به هفته قبل است
- با مقایسه با دو هفته قبل، تعداد قراردادهای خرید و فروش در نوسان است و الگوی مشخصی مشاهده نمی شود

قراردادهای باز:

- تغییرات قراردادهای باز افزایش ۷,۲۴۱ داشت که نشان از افزایش سرمایه‌گذاری در قراردادهای آتی نفت است.
- با مقایسه با دو هفته قبل، قراردادهای باز همچنان در حال افزایش است.
- در بخش تغییرات کل، در مجموع ۲,۸۵۰ قرارداد کاهش خرید داریم. تمایل کلی به فروش نسبت به هفته قبل بیشتر شده است

نتیجه‌گیری: در هفته آخر، تمایل به فروش نفت در گروه غیرتجاری و به طور کلی افزایش یافته است. همچنین سرمایه‌گذاری در قراردادهای آتی نفت در حال افزایش می‌باشد.

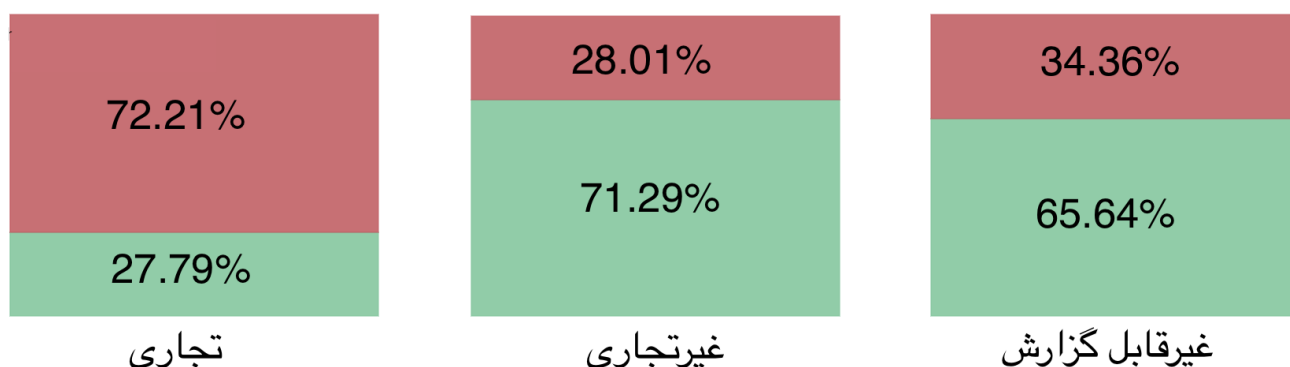
طلا (GOLD) - بورس کالای شیکاگو

اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 088691

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 486,634				اندازه قراردادهای 100 اونس تروی				
23,766	45,409	462,68	441,225	287,747	110,728	76,145	98,976	254,352
تغییرات در قراردادهای باز: +2,287				تغییرات				
-1,843	-75	+4,130	+2,362	-8,995	+77	+9,586	+3,539	-7,301
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
4.9%	9.3%	95.1%	90.7%	59.1%	22.8%	15.6%	20.3%	52.3%
تعداد کل معامله گران: 317				تعداد معامله گران در هر دسته				
		181	260	60	45	90	57	182

خرید در مقابل فروش



تفسیر

در گروه غیرتجاری، تعداد قراردادهای خرید 254,352 و فروش 98,976 بوده است. پس تمایل به سمت خرید بیشتر بوده است. همچنین در بخش تغییرات، خرید 7,301 کاهش و فروش 3,539 افزایش داشته است. یعنی در مجموع 10,840 قرارداد به سمت فروش متمایل شده است.

با مقایسه با ادوار گذشته، روند تغییرات تعداد قراردادهای خرید و فروش نوسانی بوده و تمایل خاصی به یک سمت مشاهده نمی‌شود.

تعداد کل قراردادهای باز 2,287 عدد افزایش یافته که نشانه جذب بیشتر سرمایه‌گذاری است، هرچند این افزایش ناچیز بوده است. با مقایسه با دوره‌های گذشته، روند افزایشی تعداد قراردادها مشهود است.

در بخش تغییرات کل، خرید 2,362 افزایش و فروش 4,130 افزایش داشته است. یعنی در مجموع 1,768 قرارداد بیشتر به سمت فروش متمایل شده‌اند.

به طور کلی، در این دوره تمایلات بیشتر به سمت فروش بوده، هرچند تغییرات چشمگیری مشاهده نمی‌شود.

نقره (SILVER) - بورس کالای شیکاگو

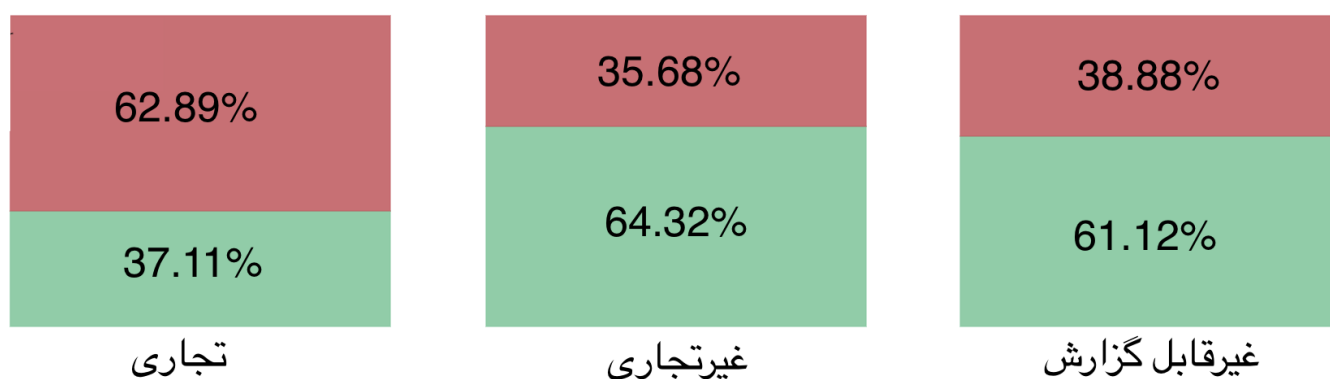
اطلاعات صرفاً مربوط به معاملات آتی است

کد - 084691

غیر قابل گزارش		کل		تجاری		غیر تجاری		
فروش	خرید	فروش	خرید	فروش	خرید	اسپرد	فروش	خرید
قراردادهای باز: 134,826				اندازه قراردادهای 5,000 اونس تروی				
16,143	25,379	118,683	109,447	77,185	45,551	13,605	27,893	50,291
تغییرات در قراردادهای باز: +3,753				تغییرات				
+2,278	-955	+1,475	+4,708	+4,214	+3,302	-1,689	-1,050	+3,095
درصد قراردادهای باز برای هر دسته از معامله گران								
12.0%	18.8%	88.0%	81.2%	57.2%	33.8%	10.1%	20.7%	37.3%

تعداد کل معامله گران: 213				تعداد معامله گران در هر دسته				
		118	165	43	44	46	45	100

خرید در مقابل فروش



تفسیر

گروه غیرتجاری:

- تعداد قراردادهای خرید 50,291 و فروش 27,893 است. پس تمایل به خرید بیشتر بوده است.
- در بخش تغییرات، در مجموع 4,145 قرارداد به سمت خرید تمایل پیدا کرده است.
- در مقایسه با دو هفته قبل، خرید روند نزولی و فروش روند صعودی داشته است.

قراردادهای باز:

- 3,753 قرارداد افزایش یافته که نشان دهنده جذب سرمایه بیشتر است و این روند افزایشی از دو هفته قبل ادامه داشته است.
- در تغییرات کل، خرید 4,708 افزایش و فروش 1,475 افزایش داشته است. در مجموع 3,233 قرارداد به سمت خرید تمایل پیدا کرده است.

نتیجه گیری: تمایل به خرید نقره در اکثر بخش ها افزایش یافته است. سرمایه گذاری رو به رشد بوده و انتظار می رود قیمت نقره صعودی باشد.

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!

شما چهارمین 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. با توجه به اولین انتشارهای این گزارش احتمالاً کاستی‌هایی وجود داشته باشد که خوشحال میشویم از طریق راه‌های ارتباطی که در انتهای نشریه آورده شده این کاستی‌ها و یا پیشنهادات خود را به ما منعکس نمایید.

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 است.
- 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 غیر تجاری (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.
- نسبت خرید به فروش: نسبت خرید به فروش یک شاخص مهم برای ارزیابی تمایلات خریداران و فروشندگان است. نسبت بالاتر از 1 نشان می‌دهد که خریداران نسبت به فروشندگان برتری دارند، در حالی که نسبت کمتر از 1 نشان می‌دهد که فروشندگان نسبت به خریداران برتری دارند.
- 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>