



گزارش هفتگی بررسی وضعیت معاملات در بورس کالای ایران

هفته پانزدهم سال ۱۳۹۷

منتهی به تاریخ ۱۳۹۷/۰۴/۱۵

معاملات فیزیکی گروه مواد معدنی و صنعتی :

طی هفته منتهی به ۱۵ تیر ماه ۵۷۰۰۵۲ تن از انواع محصولات فلزی و معدنی در تالار صنعتی بورس کالای ایران به ارزش ۲,۳۸۳,۹۶۱ میلیون ریال مورد داد و ستد قرار گرفت، ۶۸ درصد از حجم معاملات به محصولات فولادی اختصاص یافت.

آمار معاملات محصولات صنعتی از ۱۳۹۷/۰۴/۰۹ لغایت ۱۳۹۷/۰۴/۱۵		
نام کالا	حجم معامله (تن)	ارزش معامله (میلیون ریال)
فولاد	۳۸,۷۵۵	۱,۰۱۶,۵۵۵
آلومینیوم	۲,۰۰۰	۲۳۳,۸۰۴
مس	۹,۱۴۵	۱,۰۰۰,۲۴۰
سیمان	۲,۰۰۰	۲,۶۲۸
گندله سنگ آهن	۵,۰۰۰	۲۶,۱۵۰
سایر	۱۵۲	۱۰۴,۵۸۵
جمع	۵۷,۰۵۲	۲,۳۸۳,۹۶۱

در این هفته شاهد کاهش ۸۲ درصدی در ارزش معاملات و کاهش ۸۶ درصدی در حجم معاملات گروه مواد معدنی و صنعتی بودیم که علت اصلی آن را می‌توان در عدم عرضه‌ی شرکت ذوب آهن و کاهش زیاد عرضه فولاد مبارکه اصفهان جستجو کرد.

در هفته‌ای که سپری شد شرکت فولاد مبارکه اصفهان اقدام به عرضه ۸,۷۵۵ تن ورق گرم B و ورق گرم C نمود که با قیمت پایه مورد معامله قرار گرفت. و شرکت فولاد خوزستان نیز ۳۰,۰۰۰ تن تختال C عرضه نمود که با رقابت قیمتی ۱۰ درصد معامله شد.

شرکت آلومینیوم ایران (ایرالکو) ۲,۰۰۰ تن شمش آلومینیوم و بلیت عرضه نمود که با ۱۵ درصد رقابت از سوی متقاضیان خریداری شد.

شرکت ملی صنایع مس ایران ۲۳,۰۰۰ تن از انواع مس کم عیار G، مس کم عیار R، مس کاتد و مس مفتول عرضه نمود که ۱۰,۰۰۰ تن مس کم عیار R بدون تقاضا از تابلو معاملات حذف شد. ۱,۰۰۰ تن مس مفتول و ۲,۰۰۰ تن مس کاتد با ۱۰ درصد رقابت و ۱۰,۰۰۰ تن مس کم عیار G نیز در قیمت پایه مورد معامله قرار گرفتند، همچنین این شرکت ۱۴۰ تن سولفور مولیبدن عرضه نمود که ۴۰ تن از آن بین ۲ تا ۳ درصد رقابت و مابقی در قیمت پایه به فروش رسید. صنایع تولیدی دنیای مس کاشان و گیل رادشمال نیز به ترتیب ۸۰ و ۶۵ تن مس مفتول عرضه نمودند که هر یک با ۱۰ درصد رقابت مورد داد و ستد قرار گرفت. ۱۲ تن کنسانتره فلزات گرانبهای این شرکت که طی سه مرحله عرضه شد بین ۷۹ تا ۸۱ درصد مورد رقابت قرار گرفت. ۲,۰۰۰ تن سیمان تیپ ۱ شرکت سیمان سپاهان با قیمت پایه مورد معامله قرار گرفت. ۵,۰۰۰ تن از گندله سنگ آهن ذوب فولاد اردکان نیز با قیمت پایه فروش رسیدند. و ۲ کیلوگرم شمش طلای عرضه شده بدون تقاضا باقی ماند.

معاملات فیزیکی محصولات کشاورزی :

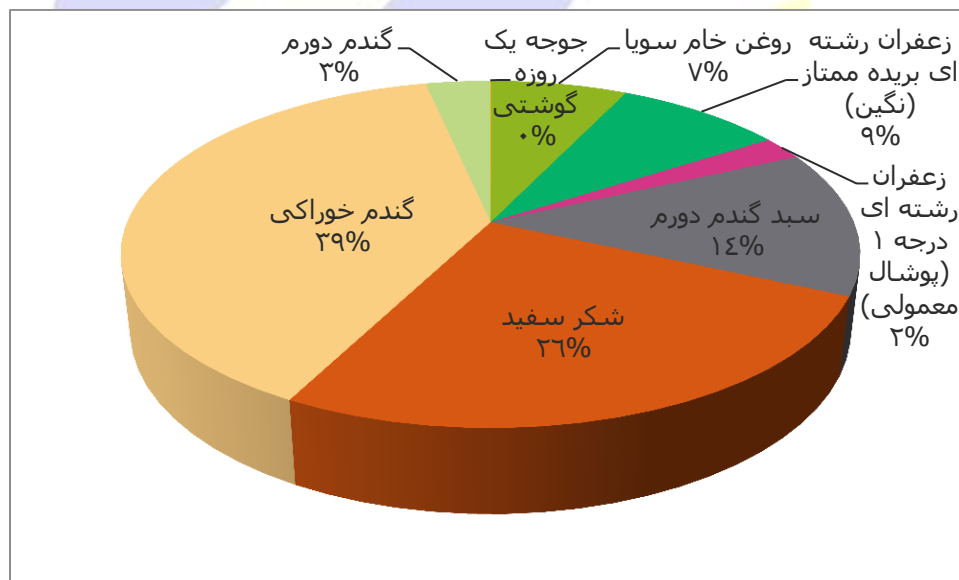
در هفته منتهی به ۱۳۹۷/۰۴/۱۵ در مجموع ۸۰،۸۸۸ تن انواع محصولات کشاورزی در تالار بورس کالای ایران عرضه شد که از این مقدار ۴۰،۱۶۶ تن محصول به ارزش ۵۵۱،۳۱۰ میلیون ریال مورد داد و ستد قرار گرفت. در مقایسه با هفته قبل، میزان عرضه کاهشی برابر با ۲۰ درصد، حجم معاملات نیز کاهش ۱۳ درصدی و ارزش معاملات کاهشی برابر با ۲۱ درصد داشته است.

در میان عرضه های این هفته ۵،۰۰۰ تن گندم خوراکی با اندکی رقابت و ۳،۰۰۰ تن شکر سفید تا ۲ درصد رقابت از سوی متقاضیان خریداری شد. از سوی دیگر کلزا، شکر خام، شکر سفید بسته بندی شده و خرما می مضافتی بدون تقاضا بودند.

در معاملات گواهی سپرده کالایی، مقدار ۶۸۰،۹۶۵ گرم زعفران خراسان رضوی به ارزش ۴۸،۲۲۸ میلیون ریال به فروش رسید.

تالار کالاهای فرعی و صادراتی بورس کالای ایران بدون هیچگونه عرضه ای از محصولات کشاورزی به کار خود پایان دادند.

ترکیب معاملات محصولات کشاورزی در هفته منتهی به ۱۳۹۷/۰۴/۱۵



معاملات فیزیکی فرآورده های نفتی و پتروشیمی :

در این دوره به میزان ۶۱۹،۴۹۵ تن از انواع محصولات پتروشیمی و فرآورده های نفتی در بورس کالای ایران عرضه شد و حدود ۲۷۲،۰۱۵ تن آنها به ارزش تقریبی ۷،۷۵۵،۲۷۱ میلیون ریال به فروش رسید. میزان عرضه محصولات پتروشیمی و فرآورده های نفتی نسبت به هفته قبل افزایش قابل ملاحظه ای را تجربه نمود و دلیل اصلی آن افزایش در عرضه محصول قیر به میزان ۳۵۲،۹۰۰ تن در مقایسه با هفته گذشته بود. به این ترتیب عرضه محصولات ۶۴ درصد رشد داشت، حجم معاملات ۲۳ درصد کاهش و ارزش معاملات نیز ۹ درصد کاهش داشت. ۵۲ درصد حجم معاملات، به محصولات پلیمری اختصاص داشت.

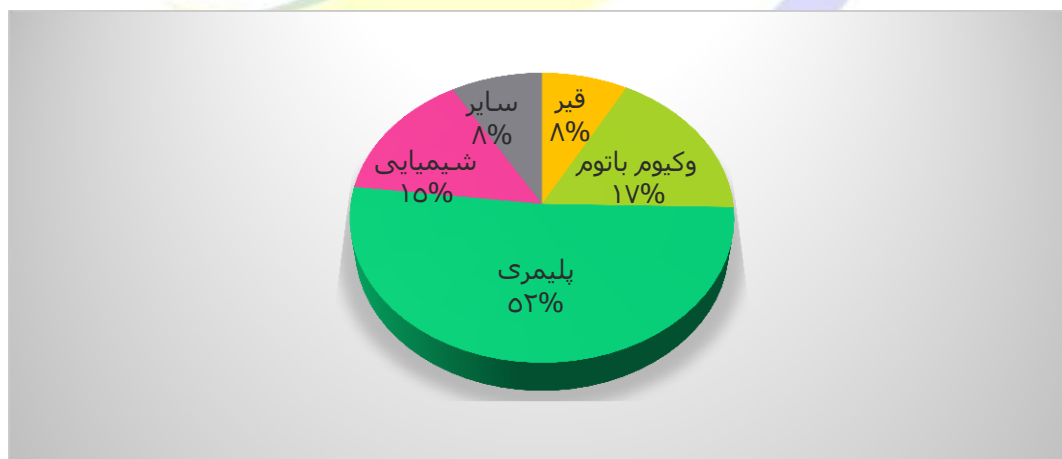
در هفته دوم تیرماه تالار معاملات پتروشیمی شرکت بورس کالای ایران، باز هم همچون هفته‌های گذشته با افزایش بسیار شدید تقاضا مواجه بود و علیرغم افزایش عرضه حدود ۳۰،۰۰۰ تنی محصولات، حجم تقاضا به روند صعودی خود ادامه داده و افزایش ۳۶،۲۰۰ تنی را تجربه نمود. بعد از تک‌نرخ شدن دلار و صادرات محصولات پتروشیمی، شکاف قیمتی ایجاد شده بین بازار آزاد و قیمت های بورس منجر به افزایش تقاضا از سوی متقاضیان و همچنین دلان بازار شده است. حجم تقاضا در دو هفته گذشته نزدیک به ۵۰۰،۰۰۰ تن رسید که در سال‌های اخیر کم سابقه بوده است. شایان ذکر است در دو ماه گذشته متاثر از نوسانات نرخ ارز و همچنین صادرات محصولات پتروشیمی باعث شده تا قیمت این محصولات به بالاترین سطح خود برسد.

در این هفته ۹۶ درصد از محصولات عرضه شده از سوی متقاضیان خریداری شدند. از میان ۷۱ گرید عرضه شده ۶۶ گرید با رقابت قیمتی معامله شدند، رقابت‌های انجام شده بین ۵ تا ۲۰ درصد بود. ۶۳ گرید عرضه شده با رقابت قیمتی ۱۰ درصد و بیشتر معامله شدند و تنها سه گرید از آنها با رقابت‌های ۸ و ۵ درصدی به فروش رسیدند که این میزان رقابت قیمتی در بازار بورس کالای ایران کم سابقه است.

در این هفته همه کالاها با تقاضای کاذب و قیمت‌های بالا معامله شدند و در این راستا گروه کالایی PVC نیز که مدت‌ها بود که با قیمت‌های منطقی و کمتر از ۱۰ درصد معامله می‌شد، با وجود سقف نوسان قیمتی ۲۰ درصدی، باز هم در سقف قیمت معامله شد. بیشترین رقابت قیمتی در این هفته باز هم برای گروه PVC بوده است، که دارای سقف نوسان نرخ ۲۰ درصدی هست و برای دومین هفته متوالی متاسفانه این گروه کالایی با سقف نوسان نرخ ۲۰ درصدی معامله شد. در این هفته بیشترین تقاضا هم برای گرید S65 پالت پتروشیمی ارون و به میزان بیش از ۲۶ هزار تن بود.

بیشترین تقاضای این هفته به گروه پلی‌پروپیلن نساجی با حجم تقاضای ۹۳،۷۴۸ تن تعلق داشت که ۲۱ درصد از کل تقاضای بازار را به خود اختصاص داد، بعد از آن گروه پلی‌اتیلن سنگین اکستروژن و لوله بود که با حجم تقاضای ۷۲،۴۳۲ تن ۱۶ درصد از سهم بازار را از آن خود کرد. گروه پلی‌اتیلن سبک فیلم با تقاضای ۵۶،۸۴۸ تن و PVC با ۵۵،۵۶۸ تن در رده بعدی قرار داشتند.

ترکیب معاملات محصولات پتروشیمی در هفته منتهی به ۱۳۹۷/۰۴/۱۵



آمار معاملات گاهی سپرده کالایی

ردیف	نماد	نام	تاریخ معامله	تعداد معاملات	حجم	ارزش معاملاتی (ریال)
1	سکه ۹۷۱۲-۰۱	سکه تمام بهار تحویل امروزه رفاه	1397/04/09	485	14,890	43,517,546,496
2	سکه ۹۷۱۲-۰۱	سکه تمام بهار تحویل امروزه رفاه	1397/04/10	349	12,830	37,613,248,512
3	سکه ۹۷۱۲-۰۱	سکه تمام بهار تحویل امروزه رفاه	1397/04/11	423	14,490	43,479,080,960
4	سکه ۹۷۱۲-۰۱	سکه تمام بهار تحویل امروزه رفاه	1397/04/12	414	14,870	44,376,084,480
5	سکه ۹۷۱۲-۰۱	سکه تمام بهار تحویل امروزه رفاه	1397/04/13	208	7,130	20,787,869,696
6	سکه ۹۸۱۲-۰۳	سکه تمام بهار تحویل امروزه سامان	1397/04/09	1	10	26,855,440
7	سکه ۹۸۱۲-۰۳	سکه تمام بهار تحویل امروزه سامان	1397/04/11	1	10	28,198,210
8	سکه ۹۸۱۲-۰۳	سکه تمام بهار تحویل امروزه سامان	1397/04/12	2	20	58,908,120
9	سکه ۹۸۱۲-۰۳	سکه تمام بهار تحویل امروزه سامان	1397/04/13	1	10	29,000,000
مجموع				1,884	64,260	189,916,791,914

آمار معاملات صندوق‌های کالایی

ردیف	نماد	نام	تاریخ معامله	تعداد معاملات	حجم	ارزش معاملاتی (ریال)
1	زر	صندوق س.زرافشان امیدایرانیان	1397/04/09	20	9,212	136,050,192
2	زر	صندوق س.زرافشان امیدایرانیان	1397/04/10	12	5,527	82,813,696
3	زر	صندوق س.زرافشان امیدایرانیان	1397/04/11	22	29,600	442,992,800
4	زر	صندوق س.زرافشان امیدایرانیان	1397/04/12	28	69,425	1,072,335,488
5	زر	صندوق س.زرافشان امیدایرانیان	1397/04/13	10	2,474	37,547,336
6	طلا	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	1397/04/09	1,345	11,360,891	263,750,418,432
7	طلا	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	1397/04/10	871	7,187,428	168,576,942,080
8	طلا	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	1397/04/11	1,086	8,204,630	195,372,482,560
9	طلا	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	1397/04/12	566	3,843,354	90,905,853,952
10	طلا	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	1397/04/13	580	1,893,465	44,131,938,304
11	طلا ۲	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	1397/04/13	2	200,000	200,000
12	گوهر	صندوق سکه طلای کیان	1397/04/09	39	189,806	3,178,038,272
13	گوهر	صندوق سکه طلای کیان	1397/04/10	24	53,237	876,121,024
14	گوهر	صندوق سکه طلای کیان	1397/04/11	12	47,782	806,858,176
15	گوهر	صندوق سکه طلای کیان	1397/04/12	38	120,364	2,017,517,312
16	گوهر	صندوق سکه طلای کیان	1397/04/13	10	6,953	114,787,168
17	گوهر ۲	صندوق سکه طلای کیان	1397/04/12	10	100,000	100,000
مجموع				4,675	33,324,148	771,502,996,792

بررسی تحولات بازار جهانی و داخلی طلا و ارز در هفته منتهی به ۱۳۹۷/۰۴/۱۵

در هفته کاری گذشته شاهد نوسانات اندک در محدوده ۱۲۴۰ تا ۱۲۵۷ دلاری بودیم به طوری که این روند نسبتاً خنثی در قیمت ۱۲۵۵ دلار متوقف شد. قیمت نفت بعد از توییت‌های ترامپ با نوسان‌های مثبت همراه شد. علاوه بر این در بازارهای بین‌المللی شاهد بالا گرفتن جنگ تجاری بین آمریکا و چین بودیم به طوری که شاخص دلار شاهد نوسانات هرچند محدود بود. به نظر می‌رسد چین در اقدامی تلافی جویانه علاوه بر اعمال تعرفه بر کالاهای آمریکایی، نسبت به کاهش ارزش پول ملی خود (یوان) نیز اقدام کند. در بازار داخلی اما شاهد نوسانات کاهشی در قیمت سکه طلا و در برخی روزها دلار آمریکا بودیم هرچند تعداد فروشندگان نقدی در بازار افزایش خاصی نیافته است. قیمت سکه از سه میلیون تومان به دو میلیون و هشتصد و پنجاه هزار تومان در کمترین حد رسید. دلار نیز ۷۹۰۰ تومان را لمس کرد. در بازار آتی نیز شاهد صف فروش و منفی شدن معاملات در روزهای متمادی بودیم. اخبارهایی همچون بازگشایی صرافی‌ها و یا امکان معامله گواهی‌های سکه‌های پیش فروش شده در بازار اوراق بهادار به نوسانات اخیر بازار کمک کرد.

در ادامه به صورت مختصر تحولات بازار آتی و آپشن بررسی خواهد شد.

سررسید	حجم (تعداد قرارداد)	ارزش معاملات (میلیون ریال)
تیر	2512	730.716
شهریور	1947	611.551
آبان	11948	3.988.370
دی	144497	49.823.072
جمع	160904	55.153.710