



گزارش هفتگی بررسی وضعیت معاملات در بورس کالای ایران

هفته پنجاهم سال ۱۳۹۶

منتهی به تاریخ ۱۳۹۶/۱۲/۱۱

معاملات فیزیکی گروه مواد معدنی و صنعتی :

طی هفته منتهی به ۱۱ اسفند ماه ۲۴۳،۶۷۷ تن از انواع محصولات فلزی و معدنی در تالار صنعتی بورس کالای ایران به ارزش ۶،۸۰۲،۷۰۸ میلیون ریال مورد داد و ستد قرار گرفت، ۹۳ درصد از حجم کل معاملات، به محصولات فولادی اختصاص یافت.

آمار معاملات محصولات صنعتی از ۱۳۹۶/۱۲/۰۵ لغایت ۱۳۹۶/۱۲/۱۱		
نام کالا	حجم معامله (تن)	ارزش معامله (میلیون ریال)
فولاد	۲۲۶،۸۰۵	۵،۶۱۲،۳۵۵
مس	۱۵،۴۹۰	۹۷۱،۷۱۴
آلومینیوم	۱۲۰	۱۳،۱۸۹
سیمان	۱،۰۰۰	۱،۳۱۴
سایر	۲۶۲	۲۰۴،۱۳۶
جمع	۲۴۳،۶۷۷	۶،۸۰۲،۷۰۸

در این هفته شاهد افزایش ۹۱ درصدی در ارزش معاملات و افزایش ۱۳۰ درصدی در حجم معاملات گروه مواد معدنی و صنعتی بودیم که علت اصلی آن را می توان در افزایش قابل توجه عرضه های فولاد مبارکه و ذوب آهن اصفهان جستجو کرد.

در هفته ای که سپری شد شاهد افزایش عرضه های شرکت ذوب آهن اصفهان بودیم، این شرکت ۳۶،۰۰۰ تن از انواع سبد تیرآهن و میلگرد مخلوط را عرضه نمود که حجم تقاضای ۹۲،۰۰۰ تن مواجه شده و با رقابت ۱ تا ۳ درصدی مورد معامله قرار گرفت. شرکت فولاد کرمان نیز مقدار عرضه خود را دو برابر نمود و ۲۲۰ تن میلگرد ۱۰-۳A نمود که با تقاضای ۲ برابر و با رقابت قیمتی ۴ درصد معامله شد. همچنین ۲۲۰ تن سبد میلگرد شرکت فولاد آذربایجان با تقاضای ۲/۵ برابری و با قیمت پایه مورد معامله قرار گرفت. ۵،۰۰۰ تن سبد میلگرد شرکت تولیدی فولاد سپید فراب کویر و ۲۶۴ تن انواع میلگرد گروه صنعتی درپاد تبریز نیز بدون تقاضا از تابلو معاملات حذف شد.

شرکت فولاد مبارکه اصفهان نیز مانند شرکت ذوب آهن افزایش چشمگیری در عرضه محصولات خود داشت و ۱۴۱،۹۴۵ تن از انواع ورق گرم B، ورق گرم C، ورق سرد B را عرضه نمود که ۱۳۵،۳۶۵ تن از آن در تالار و مچینگ مورد معامله قرار گرفت. گفتنی است در این بین ورق گرم C با ۴ درصد رقابت، ورق گالوانیزه با ۴ درصد رقابت و ورق قلع اندود با ۳ درصد رقابت معامله شدند. همچنین این شرکت ۲۰،۰۰۰ تن تختال SM عرضه نمود که ۵۹،۵۰۰ تن تقاضا در پی داشت و با رقابت قیمتی ۷ درصد به فروش رسید.

۲۰،۰۰۰ تن شمش بلوم شرکت فولاد خوزستان نیز با رقابت قیمتی ۴ درصد و ۱۵،۰۰۰ تن شمش بلوم مجتمع فولاد خراسان در قیمت پایه معامله شدند. از ۱۰۰ تن عرضه شمش روی شرکت فرآوری مواد معدنی ایران، ۶۰ تن با تقاضا روبرو و خریداری شد.

شرکت آلومینیوم ایران (ایرالکو) ۶۰۰ تن انواع شمش آلومینیوم و بلیت عرضه نمود که ۱۲۰ تن از آن معامله شده و مابقی بدون تقاضا از تابلو معاملات حذف شدند.

شرکت ملی صنایع مس ایران مقدار ۳۰،۰۰۰ تن مس کاتد، مس مفتول، مس کم عیار G و مس کم عیار R عرضه نمود که ۱۵،۳۸۰ تن از این محصولات در تالار و مچینگ مورد معامله قرار گرفت. همچنین این شرکت ۱۹۰ تن سولفور مولبدین عرضه نمود که با تقاضای برابر و در قیمت پایه به فروش رسید. ۱۲ تن کنسانتره فلزات گرانبها نیز با قیمت پایه در تالار و مچینگ از سوی متقاضیان خریداری شد. همچنین ۱۱۰ تن مس مفتول صنایع تولیدی دنیای مس کاشان و گیل رادشمال با قیمت پایه به فروش رسید.

۲،۰۰۰ تن سیمان تیپ ۱ شرکت سیمان اصفهان عرضه شد که ۱،۰۰۰ تن از آن به فروش رسید. شرکت تولید اتومبیل سایپا باز هم ۵۰ دستگاه از خودرو سراتو را در تالار صنعتی بورس کالای ایران عرضه نمود که هر ۵۰ دستگاه در تالار با قیمت پایه از سوی متقاضیان خریداری شد.

به گزارش کانال کامودیتی موجودی انبارهای LME که هفته منتهی به ۲ مارس اعلام شد، شاهد کاهش موجودی انبار محصولات روی، آلومینیوم، نیکل و مس بودیم و موجودی سرب و قلع نیز دارای افزایش بوده است.

آخرین موجودی انبارهای LME لندن منتهی به ۲۰۱۸/۰۳/۰۲			
ردیف	عنوان	آخرین موجودی (تن)	تغییر
۱	سرب	۱۳۴،۶۲۵	+۷،۵٪
۲	قلع	۱،۷۷۰	+۲،۹۰٪
۳	روی	۱۳۱،۷۷۵	-۱،۳٪
۴	مس	۳۲۴،۹۰۰	-۰،۹٪
۵	آلومینیوم	۱،۳۲۳،۰۵۰	-۰،۱٪
۶	نیکل	۳۳۴،۱۱۶	-۰،۴٪

معاملات فیزیکی محصولات کشاورزی :

در هفته منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۱۱ در مجموع ۱۰۰،۸۷۶ تن انواع محصولات کشاورزی در تالار بورس کالای ایران عرضه شد که از این مقدار ۵۹،۰۰۴ تن محصول به ارزش تقریبی ۵۶۰،۳۹۰ میلیون ریال، مورد داد و ستد قرار گرفت. حجم عرضه محصولات کشاورزی با افزایش ۶ درصدی نسبت به هفته قبل همراه بود. حجم معاملات نیز افزایش ۱۷ درصدی و ارزش معاملات با افزایش ۲۱ درصدی همراه بودند.

در معاملات تالار کشاورزی ۹۳۲،۲۰۲ تن ذرت دانه‌ای با رقابت بین ۲ تا ۱۰ درصد و ۱۷،۶۰۰ تن گندم خوراکی با رقابت کمتر از ۱ تا ۲ درصد مورد معامله قرار گرفتند.

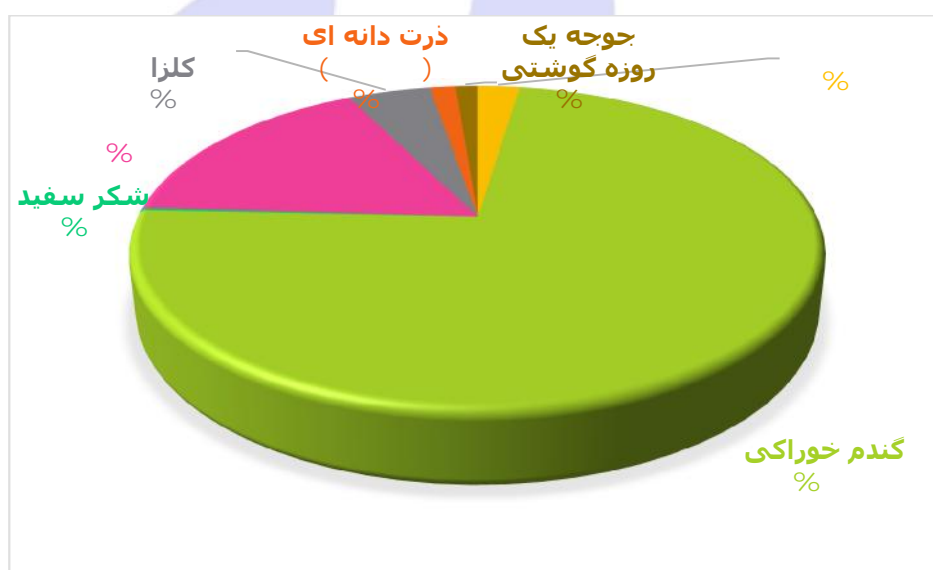
در میان عرضه‌های این هفته، برنج هاشمی، عدس درشت و زعفران رشته ای درجه ۱ (پوشال معمولی) بدون تقاضا بودند.

در معاملات گواهی سپرده کالایی، مقدار ۱۷،۴۱۱ گرم زعفران خراسان رضوی به ارزش ۸۱۴ میلیون ریال، مقدار ۱۰۵ تن ذرت دانه‌ای به ارزش ۹۲۸ میلیون ریال و ۳۰۰ کیلوگرم پسته به ارزش ۱۰۵ میلیون ریال به فروش رسید.

در تالار فرعی بورس کالای ایران، مقدار ۲۲۵ تن گوشت منجمد عرضه شد که ۱۲۵ تن آن با تقاضا همراه بود ولی متقاضیان قیمت را نپذیرفته و معامله‌ای صورت نپذیرفت، همچنین مقدار ۵۰۰ تن کره لاکتیکی عرضه شد که ۳۰۰ تن با تقاضا همراه بود و ۲۰۰ تن آن بدون تقاضا از تابلو معاملات حذف شد.

در تالار کالاهای صادراتی مقدار ۲۰،۷۸۹ تن برنج عرضه شد که بدون تقاضا از تابلو معاملات حذف شد.

ترکیب معاملات محصولات کشاورزی در هفته منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۱۱



معاملات فیزیکی فرآورده‌های نفتی و پتروشیمی :

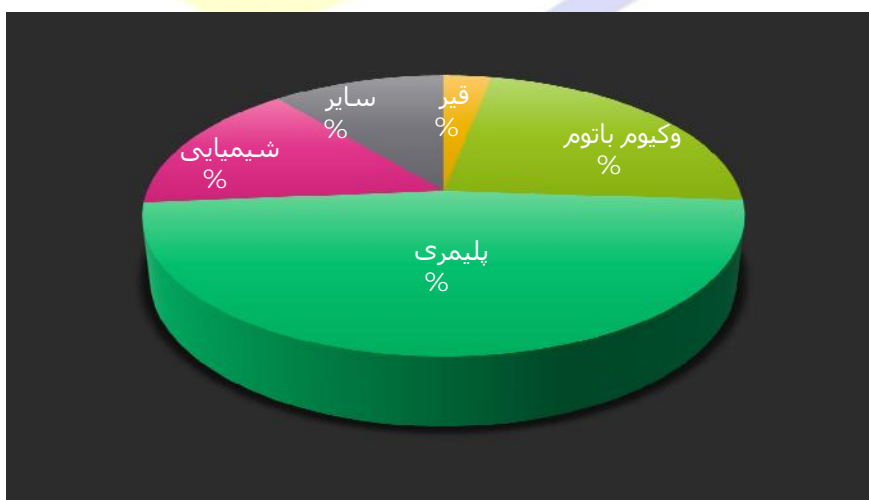
در این دوره به میزان ۴۴۶،۸۸۰ تن از انواع محصولات پتروشیمی و فرآورده‌های نفتی در بورس کالای ایران عرضه شد و حدود ۱۹۵،۸۳۹ تن آنها به ارزش تقریبی ۴،۳۹۴،۴۳۰ میلیون ریال به فروش رسید. میزان عرضه محصولات پتروشیمی و فرآورده‌های نفتی نسبت به هفته قبل رشد خوبی داشت و با ۹۶ درصد افزایش همراه بود، حجم معاملات نیز ۷۶ درصد افزایش و ارزش معاملات نیز برابر با ۴۳ درصد افزایش داشته است. ۴۸ درصد حجم معاملات، به محصولات پلیمری اختصاص یافت.

در دهه اول اسفند ماه ۱۳۹۶، تالار محصولات پلیمری شرکت بورس کالای ایران معاملات آرامی را پشت سر گذاشت ولی در مقایسه با رکود هفته گذشته وضعیت بهتری را تجربه نمود. در مجموع ۵۲ درصد از محصولات عرضه شده پلیمری توسط متقاضیان خریداری شدند و این در حالی بود که در هفته گذشته فقط ۴۱ درصد از محصولات عرضه شده به فروش رسیده بود. حجم عرضه محصولات پلیمری نسبت به هفته گذشته کاهشی برابر با ۱۰،۴۶۴ تن داشت ولی حجم معاملات افزایش ۳،۳۸۰ تنی را تجربه نمود. کاهش عرضه محصولات بیشتر در گریدهای سنگین اکستروژن و لوله، سبک فیلم، سبک خطی، PET بطری و PVC ها انجام شد. در مجموع ۲۲ گرید از محصولات پلیمری این هفته با رقابت قیمتی ۱ درصد تا ۱۰ درصد به فروش رسیدند که ۴ گرید آن با رقابت قیمتی ۱۰ درصد معامله شدند.

با توجه به نوسانات نرخ دلار در این هفته شاهد کاهش قیمت‌های پایه محصولات پلیمری بودیم و همین موضوع باعث شد تا معاملات این هفته نیز مانند هفته گذشته با احتیاط انجام شود و متقاضیان باز هم به امید کاهش قیمت محصولات، از خرید خودداری نموده و منتظر قیمت‌های جدید ماندند.

باز هم بیشترین تقاضای بازار متعلق به گروه پلی‌پروپیلن فیلم با حجم تقاضای ۱۸،۶۰۹ تن بود. همچنین گرید پلی‌پروپیلن فیلم ZH525J نویدزرشیمی با حجم تقاضای ۸،۶۹۴ تن به تنهایی بالاترین حجم تقاضای بازار را به خود اختصاص داد. این بار پلی‌پروپیلن‌های فیلم در صدر جدول رقابت‌ها قرار گرفتند و تمامی عرضه‌های این گروه کالایی با رقابت قیمتی ۱۰ درصد و در سقف قیمت خود انجام شد. به این ترتیب پلی‌پروپیلن فیلم ZH525J نویدزرشیمی و HP525J پتروشیمی جم در دو بسته بندی پالت چوبی و جامبو و گرید پلی‌پروپیلن شیمیایی ZB332C نویدزرشیمی، همگی با رقابت قیمتی ۱۰ درصد به فروش رسیدند. بعد از آن گروه کالایی پلی‌پروپیلن نساجی بود که تمامی عرضه‌های آن با رقابت قیمتی ۲ تا ۸ درصد به فروش رسیدند. در گروه PET بطری گرید ۷۸۱ با ۴ درصد رقابت و گرید ۸۲۱ با ۲ درصد رقابت از سوی متقاضیان خریداری شدند. پلی اتیلن سبک خطی امیرکبیر نیز با ۴ درصد رقابت معامله شد. همچنین دورانی 3840UA تبریز با ۳ درصد رقابت، سنگین اکستروژن EX3 امیرکبیر با ۲ درصد رقابت، پلی استایرن مقاوم ۷۲۴۰ تبریز با ۲ درصد رقابت و گرید شیمیایی ZH515MA نوید زرشیمی با ۱،۵ درصد رقابت به معاملات خود پایان دادند.

ترکیب معاملات محصولات پتروشیمی در هفته منتهی به ۱۳۹۶/۱۲/۱۱



آمار معاملات صندوق‌های کالایی

ردیف	نماد	نام	تاریخ معامله	تعداد معاملات	حجم	ارزش معاملاتی (ریال)
1	طلا	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	1396/12/05	33	138,933	1,710,832,000
2	طلا	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	1396/12/06	37	672,116	8,365,407,744
3	طلا	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	1396/12/07	82	2,042,342	25,509,259,264
4	طلا	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	1396/12/08	58	336,481	4,213,876,992
5	طلا	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	1396/12/09	26	105,004	1,320,118,016
مجموع						
				236	3,294,876	41,119,494,016

آمار معاملات گواهی سپرده کالایی

ردیف	نماد	نام	تاریخ معامله	تعداد معاملات	حجم	ارزش معاملاتی (ریال)
1	سکه ۹۷۱۲-۰۱	سکه تمام بهار تحویل ۱روزه رفاه	1396/12/05	13	1,790	2,711,229,952
2	سکه ۹۷۱۲-۰۱	سکه تمام بهار تحویل ۱روزه رفاه	1396/12/06	15	290	439,604,992
3	سکه ۹۷۱۲-۰۱	سکه تمام بهار تحویل ۱روزه رفاه	1396/12/07	12	3,800	5,846,396,416
4	سکه ۹۷۱۲-۰۱	سکه تمام بهار تحویل ۱روزه رفاه	1396/12/08	4	1,040	1,601,085,952
5	سکه ۹۷۱۲-۰۱	سکه تمام بهار تحویل ۱روزه رفاه	1396/12/09	21	1,490	2,303,171,584
6	سکه ۹۸۱۲-۰۳	سکه تمام بهار تحویل ۱روزه سامان	1396/12/09	1	3,300	5,131,500,032
مجموع						
				66	11,710	18,032,988,928

بررسی تحولات بازار جهانی و داخلی طلا و ارز در هفته منتهی به ۹۶/۱۲/۱۱

بازار روز شنبه با ادامه رشدی که از روز پنج شنبه آغاز شده بود، مواجه شد. سکه مجدداً به سطوح ۱,۵۳۰,۰۰۰ تومان بازگشت و دلار در محدوده ۴۵۰۰ تومان در نوسان بود. طلای جهانی نیز در سطح ۱۳۲۸ دلار متوقف شد. در بازار داخل سکه نقدی تحت تاثیر خبر عدم برگزاری مزایده‌ها در بانک کارگشایی با رشد مواجه شد و در ادامه اعلام این موضوع که عرضه سکه بهار آزادی از طریق برگزاری حراج در بانک کارگشایی توسط بانک مرکزی ادامه خواهد داشت، بازار اندکی از افزایش قیمت خود را تعدیل نمود. بازار روز یکشنبه نیز با نوسان مجدد سکه و دلار روبه‌رو شد، به طوری که سکه در محدوده ۱,۵۲۰,۰۰۰ تومان و دلار همچنان پایین‌تر از سطح ۴۵۰۰ تومان به کار خود پایان داد. روز دوشنبه نیز بازار با رشد طلای جهانی تا سطح ۱۳۴۰ دلاری همراه بود و همین موضوع سکه نقدی را به محدوده ۱,۵۴۰,۰۰۰ تومان نیز رساند. روز سه شنبه بازار آتی با نوسان منفی روبرو شد. ریزش طلا تا سطح ۱۳۱۷ دلاری و رشد تا محدوده بالاتر از ۱,۵۴۰,۰۰۰ تومانی سکه نقدی و نوسانات کم دامنه دلار با نرخ‌های متفاوت از مهم‌ترین رویدادهای بازارها بود. از طرفی بازار آتی نیز با کاهش حدود ۱۲,۰۰۰ تومانی از بیشترین سطوح به سطح ۱,۶۵۴,۰۰۰ تومانی در سررسید آبان نیز رسید. روز چهارشنبه بازار بر خلاف روز قبل، با اندکی نوسان مثبت مواجه شد و سکه نقدی تا سطوح بالاتر از ۱,۵۴۰,۰۰۰ تومانی نیز پیش رفت. طلای جهانی با نوسان اندکی در محدوده ۱۳۲۰-۱۳۱۶ دلاری مواجه شد. در بازار آتی نیز رشد حدود ۱۲,۰۰۰ تومان در سررسید آخر را شاهد بودیم.

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

معاملات آتی:

سررسید	حجم (تعداد قرارداد)	ارزش معاملات (میلیون ریال)
اسفند	۳۳۴۲	۵۰۹,۴۱۹
اردیبهشت	۱۳۷۹	۲۱۴,۲۵۵
تیر	۱۰۸۶	۱۷۱,۷۱۶
شهریور	۸۷۲۳	۱,۴۱۱,۳۶۰
آبان	۱۲۵۸۰۳	۲۰,۸۴۲,۸۸۸
جمع	۱۴۰۳۳۳	۲۳,۱۴۹,۶۴۰