



گزارش هفتگی بررسی وضعیت معاملات در بورس کالای ایران

هفته منتهی به ۱۳۹۵/۱۰/۰۳

معاملات فیزیکی گروه مواد معدنی و صنعتی :

طی هفته منتهی به ۳ دی ماه، حدود ۱۱۶،۲۷۳ تن انواع محصولات فلزی به ارزش بیش از ۲،۵۶۷ میلیارد ریال در بورس کالای ایران مورد معامله قرار گرفت که عمده معاملات مربوط به گروه فولاد می باشد.

نام کالا	حجم معامله (تن)	ارزش معامله(میلیون ریال)
فولاد	۱۱۱،۵۱۰	۲،۳۴۴،۳۱۰
مس	۲،۰۰۰	۱،۱۰۲
آلومینیوم	۲،۲۸۰	۱۷۷،۲۴۷
سایر	۴۸۳	۴۴،۴۴۹
جمع	۱۱۶،۲۷۳	۲،۵۶۷،۱۰۸

بررسی بازار در این هفته نشان می دهد معاملات فولاد با کاهش ۵۶ درصدی روبرو است.

به گزارش کانال کامودیتی در بازارهای بین المللی با نزدیک شدن به پایان سال ۲۰۱۶ و تعطیلات سال نو شاهد کاهش تقاضا و در نتیجه کاهش قیمت‌های کامودیتی ها بودیم، همچنین با اتمام معاملات هفتگی، موجودی سنگ آهن در بنادر چین با کاهش ۵۰۰ هزارتنی نسبت به هفته قبل به ۱۰،۸۳۱ میلیون تن رسید که ناشی از تعطیلی بندر Qingdao بدلیل آلودگی است.

برترین محصولات کامودیتی در سال ۲۰۱۶ از نظر رشد قیمت عبارتند از :

۱-سنگ منگنز (رشد:۴۳۹درصد)، ۲-سنگ کروم (رشد:۳۱۰درصد) ۳-زغال سنگ کوک شو (رشد:۲۱۴ درصد)

۴-فرومنگنز (رشد: ۱۳۳درصد) ۵-سیلیکومنگنز (رشد:۱۱۴درصد)

محصولاتی طی سال ۲۰۱۶ بیشترین کاهش را داشته اند عبارتند از :

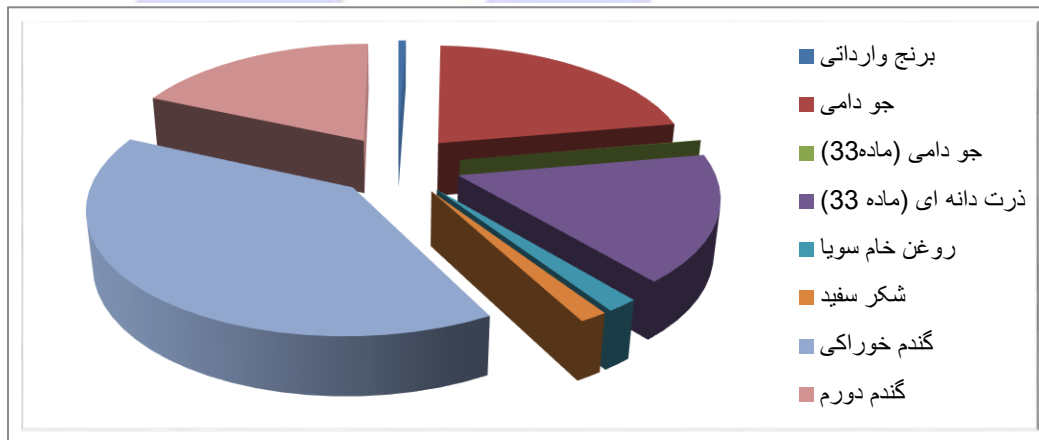
۱-ژرمانیم(۲۱درصد) ۲-هافنیم(۱۹،۲درصد) ۳-فروتیتانیم(۱۸درصد)

معاملات فیزیکی محصولات کشاورزی :

در هفته منتهی به سوم دی ماه ، در مجموع ۷۳،۷۱۵ تن انواع محصولات کشاورزی به ارزش ۶۹۲ میلیارد ریال مورد داد و ستد قرارگرفت که نسبت به هفته گذشته حدود ۷۲ درصد افزایش داشت . در این هفته عرضه جو دامی (ماده ۳۳)، تقاضایی نداشت و معامله نشد.

همچنین در این هفته در حدود ۴۱،۶۰۸ تن ذرت در قالب معاملات گواهی سپرده کالایی به ارزش تقریبی ۲۹۷ میلیارد ریال مورد معامله قرارگرفت.

ترکیب معاملات محصولات کشاورزی در هفته گذشته



به گزارش پایگاه خبری بورس کالای ایران، با هدف توسعه و تسهیل معاملات نقدی در بورس کالای ایران و استفاده از ابزارهای مالی و اوراق بهادار مبتنی بر کالا برای تحقق این هدف، چهارشنبه در نخستین روز معاملات مستمر گواهی سپرده، یک هزار تن ذرت برزیلی معامله شد.

با توجه به تأمین بیش از دو سوم ذرت مصرفی کشور از طریق واردات، معاملات گواهی سپرده کالایی ذرت برزیلی، روند معامله این محصول و کشف قیمت آن را تسهیل می کند.

قرار است افزون بر استفاده از گواهی سپرده کالایی در بازار داخل کشور، به صورت بین المللی نیز معاملات گواهی سپرده کالایی اجرایی شود.

خریداران پس از خرید به طور مستمر در زمان معاملاتی این نماد (ساعت ۹ تا ۱۲:۳۰ هر روز) روی اوراق گواهی ذرت برزیلی امکان معاملات ثانویه را دارند.

معاملات فیزیکی فرآورده های نفتی و پتروشیمی :

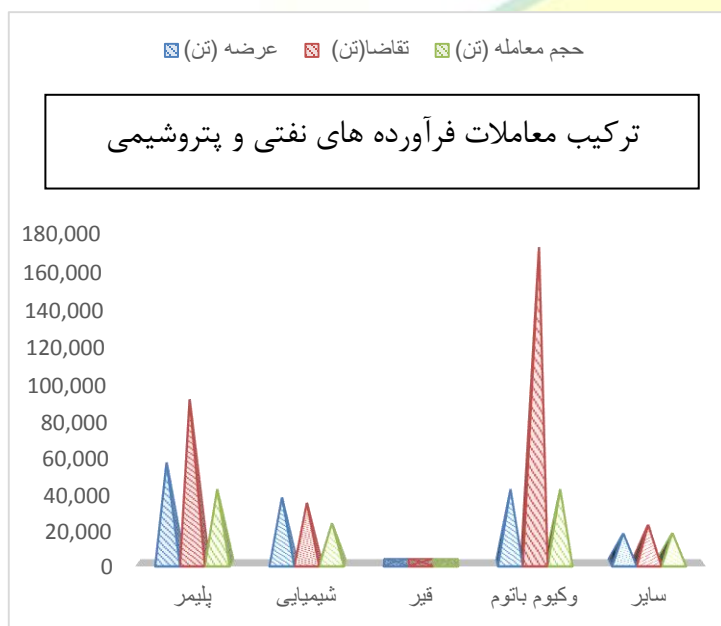
بر اساس آمار به دست آمده از بورس کالای ایران در این دوره به میزان ۱۵۱،۸۲۴ تن محصول در زیرگروه های محصولات پتروشیمی و فرآورده های نفتی ارائه شده است و در حدود ۱۲۲،۵۱۱ تن آنها داد و ستد شده است که به نسبت هفته گذشته کاهش تقریبی ۶۶ درصدی را در میزان عرضه داشته است.

میزان تقاضا ثبت شده در رینگ پتروشیمی و فرآورده های نفتی در این دوره به میزان ۳۱۸،۶۶۴ تن بوده است و به نسبت دوره ی مشابه، کاهش تقریبی ۵۹ درصدی را داشته است.

در محصولات پلیمری، پلی اتیلن سبک خطی ۲۰۹ امیرکبیر، پلی اتیلن سنگین اکستروژن EX۳ امیرکبیر و پلی اتیلن سنگین تزریقی ۵۲۵۱۸ پتروشیمی جم، بیشترین حجم معاملات را داشته اند.

بر اساس نامه واحد عملیات بورس کالای ایران از تاریخ ۳۰ آذر ماه، خرید از مازاد عرضه محصولات پتروشیمی صرفاً "برای سهمیه های مرتبط در سامانه بهین یاب امکان پذیر شد که همین امر سبب شد تا محصولاتی که در مچینگ مانده بر خلاف هفته های قبل با تقاضای چشمگیری نداشته باشد.

از تغییرات دیگر در روند خرید رینگ پتروشیمی بورس کالا، می توان به امکان خرید سهمیه به صورت سه ماهه برای کلیه گروه ها به استثناء پلی پروپیلن ها و تمامی گرید های پلی اتیلن ترفتالات بطری اشاره نمود که خرید این دو گروه نیز به صورت ماهیانه به قوت خود باقی مانده است.



از تغییرات این هفته در عرضه های پلیمری به نسبت مدت مشابه قبل می توان به موارد زیر اشاره نمود:

۱-عدم عرضه پلی اتیلن سنگین EX۵ پتروشیمی جم

۲-عرضه سبک خطی ۲۰۹ امیرکبیر فقط به صورت بسته بندی جامبو

۳-عرضه سلف پلی پروپیلن شیمیایی RP۳۴۰ توسط پتروشیمی جم با تناژ قابل توجه

معاملات آتی سکه در بورس کالا :

بازار طلای جهانی، در هفته قبل تحول چندانی را پشت سر نگذاشت که عمدتاً به خاطر عدم انتشار آمار تاثیر گذار از اقتصادهای بزرگ جهان بود. طلا در محدوده ۱،۱۴۰-۱،۱۲۷ دلار نوسان داشت و جهت خاصی را در پیش نگرفت. در بازار داخل دلار سطوح قیمتی بالای ۴،۰۰۰ تومان را برای اولین بار تجربه نمود تا ارزش پول ملی کاهش بی سابقه ای را تجربه نماید. تقاضای تعطیلات پایان سال میلادی، رشد شاخص دلار، عدم عرضه کافی در مقطع کنونی و تحولات منطقه ای تا حدود زیادی بر قیمت این ارز تاثیر گذار بودند. سکه نقدی نیز با اهرم دلار، عمده رشد قیمت ناشی از افزایش طلای جهانی را حفظ نموده و متناسب با کاهش این پارامتر تاثیر گذار، تعدیل نشده است که همین امر حساب مثبت قابل توجهی را به وجود آورده است در آخرین روز معاملاتی سکه نقدی به قیمت ۱،۱۴۹،۰۰۰ تومان نیز معامله شد.

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

معاملات آتی :

درصد	ارزش معاملات (میلیون ریال)	حجم (تعداد قرارداد)	سررسید
۴	۱۰۵،۳۹۵	۹۲۱	دی ۹۵
۲	۴۴،۵۱۷	۳۸۴	اسفند ۹۵
۳	۷۶،۹۲۸	۶۵۵	اردیبهشت ۹۶
۱۳	۳۱۴،۰۰۹	۲،۶۳۹	تیر ۹۶
۷۸	۲۰۳۱،۱۷۴	۱۶،۸۱۲	شهریور ۹۶
۱۰۰	۲،۵۷۲،۰۲۳	۲۱،۴۱۱	جمع

معاملات اختیار معامله مورخ ۹۵/۹/۲۹ :

درصد	ارزش معاملات (هزار ریال)	حجم (تعداد قرارداد)	سررسید و قیمت اعمال
۲۴	۳۱،۷۲۵	۶۶	دی ماه ۹۵ ۱۱۰۰
۱	۵۸۰،۰۰۰	۲	دی ماه ۹۵ ۱۱۲۵
۷۵	۲۶،۶۲۸	۲۰۴	دی ماه ۹۵ ۱۱۵۰
۱۰۰	۶۳۸،۳۵۳	۲۷۲	جمع