



گزارش هفتگی بررسی وضعیت معاملات در بورس کالای ایران

هفته هفتم سال ۱۳۹۷

منتهی به تاریخ ۱۳۹۷/۰۲/۲۱

## معاملات فیزیکی گروه مواد معدنی و صنعتی :

طی هفته منتهی به ۲۱ اردیبهشت ماه ۲۷۳،۶۵۴ تن از انواع محصولات فلزی و معدنی در تالار صنعتی بورس کالای ایران به ارزش ۸،۲۸۵،۲۴۴ میلیون ریال مورد داد و ستد قرار گرفت، ۹۴ درصد از حجم کل معاملات، به محصولات فولادی اختصاص یافت.

آمار معاملات محصولات صنعتی از ۱۳۹۷/۰۲/۱۵ لغایت ۱۳۹۷/۰۲/۲۱		
نام کالا	حجم معامله ( تن )	ارزش معامله ( میلیون ریال )
فولاد	۲۵۷،۸۴۲	۶،۹۱۷،۰۰۸
آلومینیوم	۲،۵۲۰	۲۷۸،۷۸۷
مس	۸،۱۴۰	۹۰۰،۷۱۴
آهن اسفنجی	۵،۰۰۰	۶۰،۰۶۸
سایر	۱۵۲	۱۲۸،۶۶۸
جمع	۲۷۳،۶۵۴	۸،۲۸۵،۲۴۵

در این هفته شاهد افزایش ۲۲۱ درصدی در ارزش معاملات و افزایش ۱۹۵ درصدی در حجم معاملات گروه مواد معدنی و صنعتی بودیم که علت اصلی آن افزایش عرضه شرکت فولاد مبارکه اصفهان و شرکت ذوب آهن اصفهان بوده است.

شرکت ذوب آهن اصفهان ۱۶،۰۰۰ تن سبد میلگرد مخلوط و ۱۶،۰۰۰ سبد تیرآهن از سبد محصولات خود را عرضه نمود که ۱۱،۰۰۰ تن از سبد تیرآهن با ۳ درصد رقابت و مابقی در قیمت پایه معامله شدند. ۳۳۰ تن میلگرد A3-10 شرکت فولاد کرمان با ۵ درصد رقابت و ۱،۵۰۰ تن میلگرد شرکت فولاد آذربایجان با رقابت کمتر از ۱ درصد از سوی متقاضیان خریداری شد.

شرکت فولاد مبارکه اصفهان نیز ۱۶۴،۰۱۲ تن انواع ورق گرم B، ورق گرم C، ورق سرد B، ورق قلع اندود و ورق گالوانیزه G عرضه نمود که ورق گرم B با ۱۲ درصد، ورق گرم گالوانیزه G و ورق گرم C هریک با ۱۰ درصد رقابت و ورق سرد B با ۲ درصد رقابت به فروش رسیدند. عرضه ورق قلع اندود و عرضه مچینگ ورقهای سرد B، گرم B و گرم C با قیمت پایه مورد داد و ستد قرار گرفت.

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 و در مجموع ۷،۰۰۰ تن از عرضه‌های مس کم عیار G مس کاتد در قیمت پایه و ۱،۰۰۰ تن مس مفتول با اندکی رقابت مورد معامله قرار گرفتند، همچنین این شرکت ۱۴۰ تن سولفور مولیبدن عرضه نمود که ۴۰ تن آن بین ۱ تا ۷ درصد رقابت و مابقی با قیمت پایه به فروش رسیدند و ۱۲ تن کنسانتره فلزات گرانبهای این شرکت نیز با ۳۶ درصد رقابت مورد معامله قرار گرفت. صنایع تولیدی دنیای مس کاشان و گیل رادشمال به ترتیب ۱۰۰ و ۴۰ تن مس مفتول عرضه نمودند که با اندکی رقابت خریداری شدند. ۵،۰۰۰ تن آهن اسفنجی شرکت جهان فولاد سیرجان با تقاضای ۳ برابر و با ۹ درصد رقابت به فروش رسید.

۲،۰۰۰ تن سیمان تیپ ۱ اصفهان بدون تقاضا از عرضه معاملات خارج شد.

شرکت آلومینیوم ایران (ایرالکو) ۲،۵۲۰ تن انواع شمش آلومینیوم و بلیت عرضه نمود که شمش آلومینیوم با رقابت ۴ تا ۸ درصد و ۵۰۰ تن بلیت نیز با ۵ درصد رقابت و ۲۰ دیگر با قیمت پایه به معاملات خود پایان دادند.

۳۰،۰۰۰ تن شمش بلوم مجتمع فولاد خوزستان با تقاضایی در حدود ۳ برابر و با ۸ درصد رقابت و ۳۰،۰۰۰ تن تختال C شرکت فولاد هرمزگان جنوب با اندکی رقابت معامله شد.

### معاملات فیزیکی محصولات کشاورزی :

در هفته منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۲۱ در مجموع ۱۹۳،۳۴۸ تن از انواع محصولات کشاورزی در تالار بورس کالای ایران عرضه شد که از این مقدار ۵۷،۳۹۹ تن محصول به ارزش ۶۰۳،۲۹۰ میلیون ریال، مورد داد و ستد قرار گرفت که در مقایسه با هفته گذشته عرضه محصولات با ۱۰ درصد افزایش، حجم معاملات با افزایش زیادی برابر با ۹۱ درصد و ارزش معاملات با کاهش در حدود ۱۴ درصد به کار خود پایان دادند.

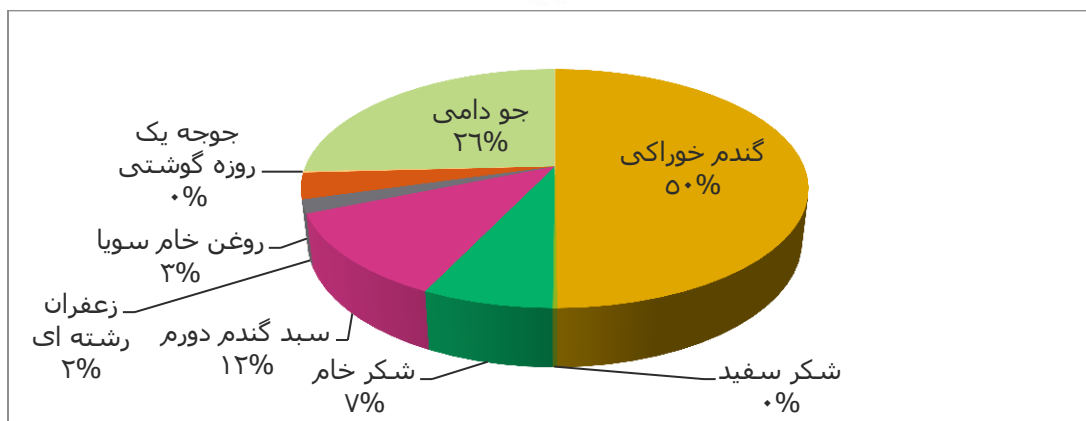
در میان عرضه‌های این هفته، ۱۵،۲۰۰ تن گندم خوراکی با رقابت قیمتی بین ۳ تا ۱۰ درصد به فروش رسیدند و از سوی دیگر عرضه‌های گندوم دورم، کلزا، روغن خام کلزا و خرمای مضافتی بدون تقاضا بودند.

در معاملات گواهی سپرده کالایی، مقدار ۲۰،۴۹۳ گرم زعفران خراسان رضوی به ارزش ۹۷۶،۶۸۱ میلیون ریال به فروش رسید.

در تالار فرعی بورس کالای ایران مقدار ۳۰۰ تن قند خرد شده و قند کله عرضه شد که بدون تقاضا از تابلو معاملات حذف شد و ۱،۵۰۰ تن روغن خام پالم اولتین نیز عرضه شد که به صورت کامل معامله شد.

در تالار کالاهای صادراتی مقدار ۱۶،۰۰۰ گرم زعفران رشته‌ای عرضه شد که بدون انجام معامله از تابلو معاملات حذف شد.

ترکیب معاملات محصولات کشاورزی در هفته منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۲۱



## معاملات فیزیکی فرآورده‌های نفتی و پتروشیمی :

در این دوره به میزان ۶۵۱،۴۶۶ تن از انواع محصولات پتروشیمی و فرآورده‌های نفتی در بورس کالای ایران عرضه شد و حدود ۳۱۷،۹۳۹ تن آنها به ارزش تقریبی ۶،۹۶۸،۲۹۶ میلیون ریال به فروش رسید. میزان عرضه محصولات پتروشیمی و فرآورده‌های نفتی نسبت به هفته قبل حدود ۱۲ درصد افزایش داشت، اما حجم معاملات کاهش ۴۰ درصدی را تجربه نمود و ارزش معاملات نیز کاهش ۶ درصدی را در پی داشت. افزایش عرضه این هفته به دو محصول قیر و وکیوم باتوم تعلق داشت که نسبت به هفته قبل ۸۸،۶۶۰ تن افزایش را نشان می‌دهد. ۴۵ درصد حجم معاملات، به محصولات پلیمری اختصاص یافت.

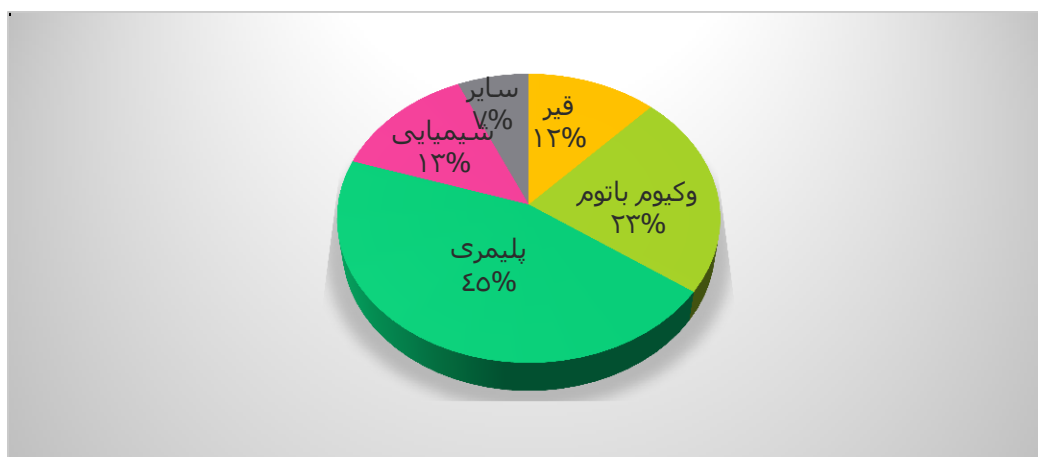
در سومین هفته اردیبهشت ماه، در تالار پتروشیمی شرکت بورس کالای ایران، حجم عرضه محصولات پلیمری ۲۲،۹۳۸ تن کاهش و متعاقب آن حجم معاملات نیز ۱۴،۹۴۰ تن کاهش را به دنبال داشت، پس از اجرایی شدن دستورالعمل بورس کالا در خصوص محدود نمودن ثبت سفارش مشتریان با ظرفیت سقف سهمیه ماهانه در بسیاری از گروه‌های کالایی، تقاضای این محصولات کاهش چشمگیری پیدا کرد و از طرفی، کاهش مجدد عرضه‌های گریدهای حساس و پرتقاضا باعث شد تا علیرغم کاهش حجم تقاضا، بازار پر رونقی را از محصولات پلیمری شاهد بودیم.

این تصمیم بورس کالا از یک سو باعث کاهش تقاضا شده و بهبود روند معاملات را در پی دارد و از سوی دیگر باز هم به ضرر مصرف کنندگان واقعی بوده و دلالتان بازار از آن منتفع خواهند شد. زیرا مصرف کنندگان واقعی با ظرفیت محدود تقاضا، یا امکان ثبت سفارش برایشان وجود ندارد یا سهم بسیار اندکی از این بازار نصیبشان می‌شود و در نهایت مجبور خواهند شد محصول مورد نیاز خود را با قیمت بالاتر از دلالتان بازار تهیه نمایند.

در مجموع ۹۴ درصد از محصولات عرضه شده پلیمری از سوی متقاضیان خریداری شد که ۴۴ گرید از محصولات عرضه شده با رقابت قیمتی ۲ تا ۱۶ درصد به فروش رسیدند. بیشترین درصد رقابت‌ها به دو گرید پلی استایرن مقاوم ۷۲۴۰ پتروشیمی تبریز و PVC-S65 پالت پلاستیکی پتروشیمی اروند با رقابت ۱۶ درصد تعلق داشت. تمامی گریدهای گروه پلی‌پروپیلن نساجی، PET بطری و پلی‌اتیلن سنگین بادی در سقف دامنه قیمت خود و با رقابت قیمتی ۱۰ درصد معامله شدند. همچنین در گروه سبک فیلم گرید ۰۰۷۵ بندرامام، در گروه سبک خطی گرید 209AA سازند و امیرکبیر، در گروه سنگین فیلم دو گرید F7000 مهر و ایلام و EX5 پلیمر کرمانشاه پتروشیمی اروند، ۴ گرید از گروه پلی‌پروپیلن‌های شیمیایی و PVC-S65 جامبو پتروشیمی اروند در بالاترین قیمت خود و با ۱۰ درصد رقابت خریداری شدند. بیشترین حجم تقاضای این هفته، باز هم به گرید BG781 با حجم ۲۰،۰۷۵ تن تقاضا اختصاص داشت.

پلی استایرن انبساطی تبریز با ۱۱ درصد رقابت، دو گرید پلی استایرن انبساطی نسوز بانیا پلیمر گنبد با ۱۴ و ۱۵ درصد رقابت و در گروه پلی اتیلن سنگین اکستروژن و لوله نیز گرید 6366M ایلام با ۱۱ درصد رقابت مورد داد و ستد قرار گرفتند. مابقی محصولات با رقابت‌های منطقی‌تری به معاملات خود پایان دادند.

ترکیب معاملات محصولات پتروشیمی در هفته منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۲۱



آمار معاملات صندوق های کالایی

ردیف	نماد	نام	تاریخ معامله	تعداد معاملات	حجم	ارزش معاملاتی (ریال)
1	زر	صندوق س.زرافشان امیدایرانیان	1397/02/15	13	2,815	33,513,290
2	طلا	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	1397/02/15	1,463	17,135,412	280,503,058,432
3	گوهر	صندوق سکه طلای کیان	1397/02/15	47	73,438	873,859,072
4	زر	صندوق س.زرافشان امیدایرانیان	1397/02/16	25	20,870	257,490,832
5	طلا	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	1397/02/16	2,033	16,274,817	278,990,979,072
6	گوهر	صندوق سکه طلای کیان	1397/02/16	94	263,255	3,229,490,432
7	زر	صندوق س.زرافشان امیدایرانیان	1397/02/17	5	7,171	83,744,096
8	طلا	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	1397/02/17	949	8,179,827	134,437,158,912
9	گوهر	صندوق سکه طلای کیان	1397/02/17	134	1,105,959	13,385,024,512
10	گوهر ۲	صندوق سکه طلای کیان	1397/02/17	65	650,000	650,000
11	زر	صندوق س.زرافشان امیدایرانیان	1397/02/18	21	28,995	335,992,128
12	طلا	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	1397/02/18	1,100	4,812,883	77,372,973,056
13	گوهر	صندوق سکه طلای کیان	1397/02/18	37	83,451	991,520,768
14	زر	صندوق س.زرافشان امیدایرانیان	1397/02/19	45	122,771	1,491,864,064
15	طلا	صندوق س.پشتوانه طلای لوتوس	1397/02/19	1,923	11,041,690	191,787,401,216
16	گوهر	صندوق سکه طلای کیان	1397/02/19	59	85,345	1,068,188,672
17	گوهر ۲	صندوق سکه طلای کیان	1397/02/19	30	300,000	300,000
		مجموع		8043	60,188,699	984,843,208,554

## آمار معاملات گاهی سپرده کالایی

ردیف	نماد	نام	تاریخ معامله	تعداد معاملات	حجم	ارزش معاملاتی (ریال)
1	سکه ۹۷۱۲-۰۱	سکه تمام بهار تحویل ۱ روزه رفاه	1397/02/15	309	26,700	53,128,855,552
2	سکه ۹۷۱۲-۰۱	سکه تمام بهار تحویل ۱ روزه رفاه	1397/02/16	353	11,360	24,031,076,352
3	سکه ۹۷۱۲-۰۱	سکه تمام بهار تحویل ۱ روزه رفاه	1397/02/17	210	6,760	13,318,019,072
4	سکه ۹۷۱۲-۰۱	سکه تمام بهار تحویل ۱ روزه رفاه	1397/02/18	355	7,740	15,044,079,616
5	سکه ۹۷۱۲-۰۱	سکه تمام بهار تحویل ۱ روزه رفاه	1397/02/19	295	11,410	24,108,914,688
<b>مجموع</b>				<b>1,522</b>	<b>63,970</b>	<b>129,630,945,280</b>

### بررسی تحولات بازار جهانی و داخلی طلا و ارز در هفته منتهی به ۱۳۹۷/۰۲/۲۱

در هفته کاری گذشته شاهد ادامه نوسانات در بازار آتی سکه طلا بودیم که البته با توجه به اقدامات صورت گرفته از سمت بورس کالا و تدابیر اتخاذ شده این شرکت برای کاهش ریسک معاملات، کاهش حجم معاملات و خروج موقعیت و سرمایه از بازار نیز اتفاق افتاد. از جمله این تصمیمات می توان به افزایش مجدد وجه تضمین و رسیدن به مرز ۶,۵۰۰,۰۰۰ تومان و به طبع آن کاهش اهرم معاملاتی اشاره کرد. کاهش سقف موقعیت های تعهدی مشتریان نیز سبب خروج موقعیت های بیشتر از سقف اعلامی و کاهش فشار خرید شده بود. هرچند به نظر می رسد هر بار با موج جدیدی از خبرها شاهد ورود سرمایه های تازه به این بازار هستیم. علاوه بر این انجام معاملات خارج از بازار دلار و صورت گرفتن معاملات این ارز به صورت زیرزمینی و خانگی سبب افزایش رشد قیمت این ارز محبوب شده است به طوری که سخن از معاملات در قیمت های بالای ۷,۰۰۰ تومان نیز شنیده می شود. در بازارهای جهانی نیز شاهد افت و خیز قیمت طلا بودیم به گونه ای که نوسانات از محدوده ۱۳۰۴ تا ۱۳۱۸ در بازه هفتگی ادامه داشت. به نظر می رسد در ادامه معاملات طلا بعد از بازگشایی بازار شاهد حرکات نزولی محدودی باشیم.

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

معاملات آتی:

سررسید	حجم (تعداد قرارداد)	ارزش معاملات (میلیون ریال)
اردیبهشت	5068	1.051.385
تیر	3035	631.952
شهریور	2903	611.379
آبان	8968	1.908.785
دی	103649	22.378.493
<b>جمع</b>	<b>123623</b>	<b>26.581.995</b>