



گزارش هفتگی بررسی وضعیت معاملات در بورس کالای ایران

هفته منتهی به ۱۳۹۵/۱۰/۱۰

معاملات فیزیکی گروه مواد معدنی و صنعتی :

طی هفته منتهی به ۱۰ دی ماه، حدود ۸۱،۲۴۶ تن انواع محصولات فلزی به ارزش بیش از دو هزار و پانصد 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 | ۶۷,۰۳۰ | ۱,۱۹۳,۳۷۸ |
| مس | ۷,۸۵۰ | ۸۴۱,۴۶۷ |
| آلومینیوم | ۶,۲۴۰ | ۴۷۹,۹۰۱ |
| سایر | ۱۲۶ | ۴۶,۵۲۸ |
| جمع | ۸۱,۲۴۶ | ۲,۵۶۱,۲۷۴ |

بررسی بازار در این هفته نشان می دهد با توجه به تعطیلی بخش عمده ای از بازار کامودیتی های دنیا، معاملات گروه فولادی با کاهش ۴۹ درصدی روبرو بوده است.

به گزارش کانال کامودیتی با وجود تعطیلی بخش عمده ای از بازار سرمایه و کالای دنیا طی هفته گذشته، برخی شاخصها تحت تاثیر تحولات کشور چین شاهد افزایش و کاهش بودند که روی، کنسانتره آهن و گندله به ترتیب با ۴.۷، ۴.۲ و ۱.۲ درصد افزایش، بیشترین افزایش و ورق سرد وارداتی ایران، زغال سنگ کک شو استرالیا، نیکل و فولاد صادراتی چین به ترتیب با ۷، ۶.۱، ۵.۳ و ۴.۸ درصد کاهش، بیشترین کاهش را طی هفته گذشته داشته اند.

معاملات فیزیکی محصولات کشاورزی :

در هفته منتهی به دهم دی ماه در مجموع ۳۷،۷۹۲ تن انواع محصولات کشاورزی به ارزش تقریبی ۳۸۲،۱۷۰ میلیون ریال، مورد داد و ستد قرار گرفت که نسبت به هفته گذشته کاهش چشمگیری داشت . در این هفته عرضه ذرت دامی و گندم دورم هیچ گونه تقاضایی نداشت و معامله نشد.

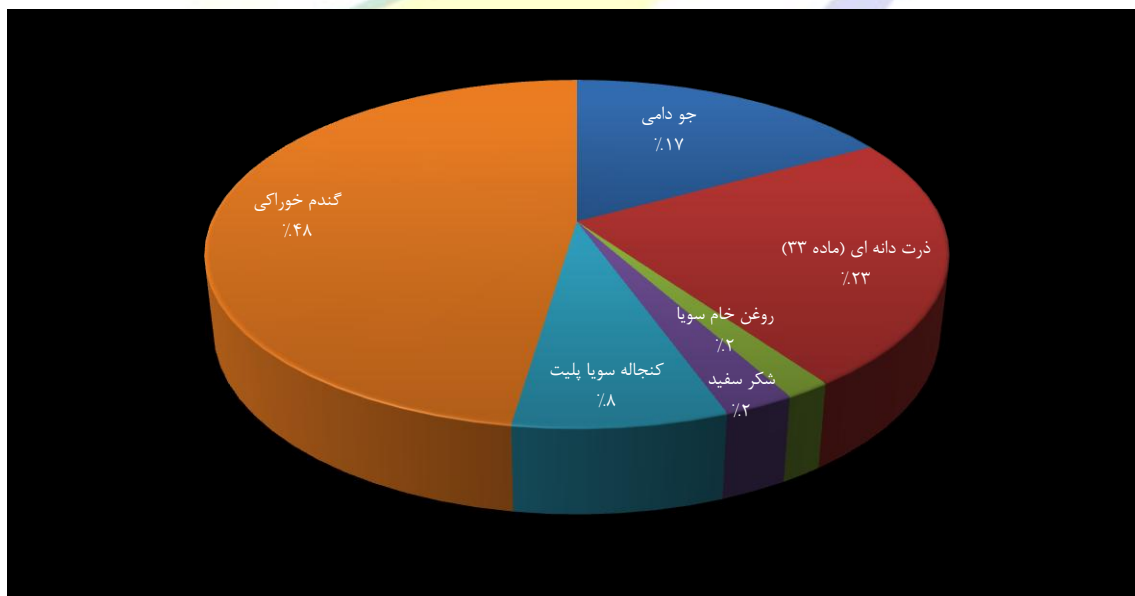
تالارصادراتی بورس کالای ایران روز چهارشنبه ۸ دی ماه میزبان عرضه ۲۰ هزارتن گندم دورم استان خوزستان بود لکن تقاضایی برای آن ثبت نگردید.

در این بازه زمانی در حدود ۶۳،۷۴۶ تن ذرت در قالب معاملات گواهی سپرده کالایی مورد معامله قرار گرفت که در مقایسه با معاملات هفته گذشته در حدود ۵۳ درصد افزایش داشته است.

به گزارش ایانا از روابط عمومی سازمان جهاد کشاورزی جنوب کرمان، سید یعقوب موسوی رئیس سازمان جهاد کشاورزی جنوب کرمان از تولید ۷۰ هزار تن محصول ذرت دانه ای از مزارع این منطقه خبر داد

وی بیان داشت: مطابق دستور العمل خرید تضمینی ذرت دانه ای سال ۱۳۹۵ قیمت هر کیلو گرم ذرت دانه ای با رطوبت ۱۴ درصد یک هزار و ۳۶ تومان تعیین شده است که نسبت به سال قبل هشت درصد رشد داشته است. موسوی تصریح کرد: شرکت پشتیبانی امور دام به عنوان مباشر خرید، برنامه ریزی لازم برای راه اندازی ۱۰ مرکز خرید در سطح منطقه را به عهده گرفته است.

ترکیب معاملات محصولات کشاورزی در هفته گذشته



معاملات فیزیکی فرآورده های نفتی و پتروشیمی :

بر اساس آمار به دست آمده از بورس کالای ایران در این دوره به میزان ۴۵۵،۱۱۹ تن محصول در زیرگروه های محصولات پتروشیمی و فرآورده های نفتی ارائه شده است و در حدود ۲۸۱،۱۵۵ تن آنها داد و ستد شده است که به نسبت هفته گذشته عرضه و تقاضا به ترتیب رشد ۲ و ۱/۳ برابری داشته اند.

بیشترین تاثیر در این افزایش ها را دو زیر گروه قیر و وکیوم باقیم به خود اختصاص داده اند.

در محصولات پلیمری، پلی پروپیلن نساجی Z۳۰S، C۳۰S و پلی اتیلن سبک خطی ۲۰۹ امیرکبیر، بیشترین حجم معاملات را داشته اند.

در این دوره قیمت های پایه جدید محصولات پلیمری و شیمیایی اعلام شده است و در کل افزایشی بوده است که علت این روند صعودی را در افزایش ۲ درصدی نرخ دلار محاسباتی قیمت های پایه و رشد قیمت جهانی محصولات می توان دانست.

در گروه پلیمری بیشترین افزایش نرخ ها مربوط به محصولات ABS، پلی اتیلن ترفتالات و پلی استایرن انبساطی بوده است.

متانول، منو اتیلن گلیکول و محلول آمونیاک نیز به ترتیب بیشترین رشد قیمت در بین شیمیایی ها را به خود اختصاص داده اند.

به گزارش پتروتحلیل، اکثر کارشناسان بازار شیمیایی معتقدند؛ افزایش قیمت برخی از محصولات شیمیایی منطقی به نظر نمی رسد و با میزان افزایش و کاهش نرخ های جهانی همخوانی ندارد.

به اعتقاد این گروه؛ دلیل آن به قیمت های پایه تاریخ ۲۱ آذر ماه برمی گردد؛ چرا که در این تاریخ دلار با افزایش نسبتا زیادی روبه رو شد و برخی از محصولات شیمیایی هم افزایش قیمت شدید را داشتند، مثلا استایرن مونومر، منواتیلن گلیکول و متانول با افزایش شدید قیمت در بازارهای جهانی روبه رو شدند.

به همین دلیل در آن زمان پیش بینی می شد که استایرن مونومر و منواتیلن گلیکول حدودا ۵۵۰ تومان و متانول ۲۰۰ تومان گران شد، اما این اتفاق رخ نداد و استایرن مونومر و MEG در حدود ۳۳۰ تومان و متانول نیز ۱۳۰ تومان افزایش یافت.

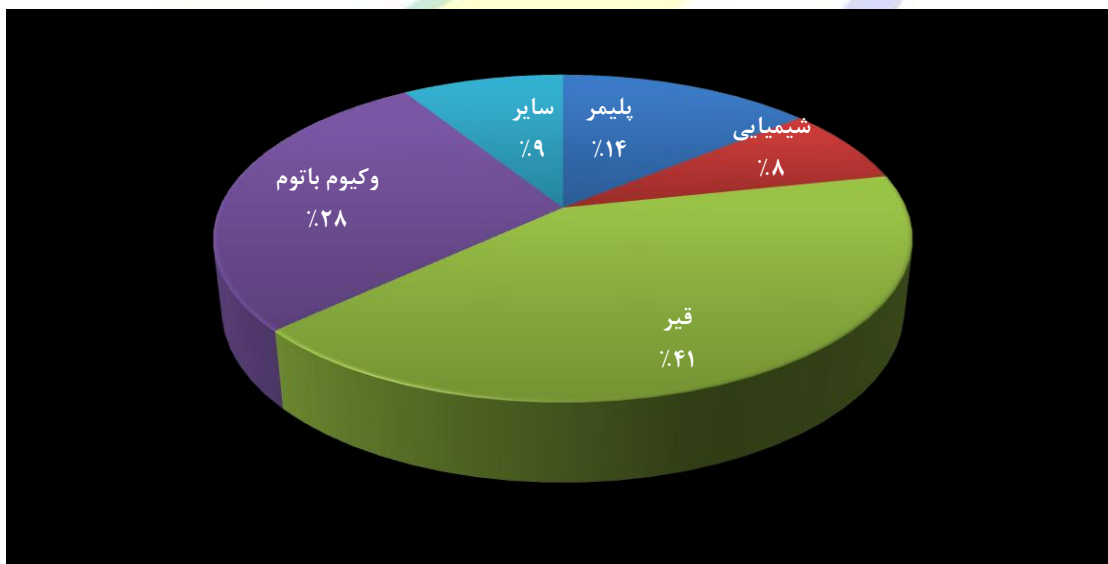
به همین دلیل در آن زمان پیش بینی می شد که استایرن مونومر و منواتیلن گلایکول حدوداً ۵۵۰ تومان و متانول ۲۰۰ تومان گران شود، اما این اتفاق رخ نداد و استایرن مونومر و MEG در حدود ۳۳۰ تومان و متانول نیز ۱۳۰ تومان افزایش یافت.

در هفته جاری قیمت های جهانی محصولات شیمیایی و دلار با تغییرات کمتری روبه رو بود، از این رو به نظر می رسد قیمت استایرن مونومر، منواتیلن گلایکول و متانول با قیمت های جهانی همخوانی ندارد.

به گزارش همین خبرگزاری، در بازار چین در هفته جاری، افت قیمت آتی پلی اتیلن سبک خطی به بازار فیزیکی این کالا هم منتقل شد. قیمت پلی اتیلن وارداتی ۱۳۳۰ تا ۱۳۹۰ دلار در هر تن برای فیلم و ۱۱۲۳ تا ۱۲۹۰ دلار در هر تن برای پلی اتیلن سبک خطی و ۱۱۱۰ تا ۱۲۰۰ دلار در هر تن برای پلی اتیلن سنگین فیلم به صورت سی آی اف و نقدی اعلام شده است که ۱۰ تا ۳۰ دلار کاهش را نسبت به هفته قبل نشان می دهد.

این در حالی است که نزدیکی به سال نو و بسته شدن حساب های مالی از دلایل مقاومت خریداران به پیشنهادات فروشندگان بوده است، از این رو بازار پلی اتیلن در هفته جاری کاهشی بود.

ترکیب معاملات محصولات پتروشیمی و فرآورده های نفتی در هفته گذشته



معاملات آتی سکه در بورس کالا :

بازار طلای جهانی، هفته پایانی سال ۲۰۱۶ را با نوسان مثبت پشت سر گذاشت . طلا که اندکی شیب مسیر کاهشی را کم کرده بود در واپسین روزهای سال ۲۰۱۶ توانست با رشد حدود ۴۰ دلاری، جان تازه ای بگیرد. در بازار داخل ولی وضعیت بسیار متفاوت بود. رشد عجیب دلار تا سطوح تاریخی ۴۱۵۰ تومانی علاوه بر از بین بردن تابوی دلار ۴۰۰۰ تومانی، توانست بازار سکه را نیز وارد فاز جدیدی نماید به طوری که با اوج گیری سکه نقدی تا قیمت ۱،۲۲۴،۰۰۰ تومان، رکورد ۴ ساله بازار طلا را شکست و به تبع آن بازار آتی نیز سطوح تازه ای را لمس کرد و دو روز متوالی به صف خرید رسید . هرچند در اواخر هفته با کاهش قیمت ها، حباب حدود ۱۰۰ هزار تومانی سکه کاهش یافت . رشد بیشتر دلار نسبت به سایر ارزها با توجه به نرخ های برابری اندک ی حباب مثبت در این ارز را نشان می دهد که می تواند حاکی از هیجان بازار و نیاز به اصلاح باشد. ارقام سنگین بازدهی در معاملات option، نشان دهنده جذابیت زیاد این ابزار مالی است که گرچه هنوز نتوانسته حجم نقدینگی زیادی را جذب نماید ولی پتانسیل زیادی را در بدو ورود به نمایش گذاشت.

در ادامه به صورت مختصر تحولات بازار آتی و اختیار معامله بررسی خواهد شد

معاملات آتی:

| درصد | ارزش معاملات (میلیون ریال) | حجم (تعداد قرارداد) | سررسید |
|------|----------------------------|---------------------|-------------|
| ۸ | ۱,۷۵۷,۲۷۱ | ۱۴,۴۱۵ | دی ۹۵ |
| ۲ | ۵۹۸,۲۲۴ | ۴,۸۳۴ | اسفند ۹۵ |
| ۳ | ۸۰۰,۰۸۸ | ۶,۳۵۶ | اردیبهشت ۹۶ |
| ۲ | ۲,۶۱۹,۳۷۷ | ۲,۶۰۲ | تیر ۹۶ |
| ۸۵ | ۲۱,۳۱۸,۰۰۵ | ۱۶۵۹۴۷ | شهریور ۹۶ |
| ۱۰۰ | ۲۷,۰۹۲,۹۶۵ | ۱۹۴,۱۵۴ | جمع |

معاملات اختیار معامله مورخ ۹۵/۱۰/۰۶

| درصد | ارزش معاملات (میلیون ریال) | حجم (تعداد قرارداد) | سررسید و قیمت |
|------|----------------------------|---------------------|----------------|
| ۲۴ | ۱۵۲ | ۱۹۸ | دی ماه ۹۵ ۱۱۰۰ |
| ۶ | ۴۰ | ۷۱ | دی ماه ۹۵ ۱۱۲۵ |
| ۶۳ | ۴۲۳ | ۱۳,۴۶ | دی ماه ۹۵ ۱۱۵۰ |
| ۷ | ۵۱ | ۳۲۹ | دی ماه ۹۵ ۱۱۷۵ |
| ۱۰۰ | ۶۶۶ | ۲۷۲ | جمع |