



بازار فرآورده‌های هیدروکربوری

گزارش آماری خردادماه ۱۳۹۸

نگاهی به بازار فرآورده‌های هیدروکربوری

بازار فیزیکی:

طی خردادماه ۱۳۹۸ در بازار فیزیکی بورس انرژی ایران بیش از ۱۹۲،۱۲۳ تن انواع فرآورده‌های هیدروکربوری به ارزش بیش از ۹،۸۶۰ میلیارد و ۷۹۷ میلیون ریال مورد معامله قرار گرفت. بیش از ۱۲۸،۷۸۲ تن از محصولات معامله‌شده در رینگ داخلی و بیش از ۶۳،۳۴۰ تن در رینگ بین‌الملل بازار فیزیکی مورد داد و ستد قرار گرفته‌اند. همچنین ارزش ریالی معاملات در رینگ داخلی بیش از ۶،۲۹۹ میلیارد و ۹۰ میلیون ریال و در رینگ بین‌الملل بیش از ۳،۵۶۱ میلیارد و ۷۰۶ میلیون ریال بوده است. گفتنی است ارزش معاملات رینگ داخلی طی خردادماه ۱۳۹۸ در مقایسه با مدت مشابه در سال ۱۳۹۷ بیش از ۱۱ درصد افزایش یافته، اما کاهش ارزش معاملات در رینگ بین‌الملل به میزان حدوداً ۲۳ درصد طی مدت مشابه، مجموعاً موجب کاهش ۴ درصدی ارزش کل معاملات شده است. در جدول ۱ ارزش ریالی و حجم کل معاملات به تفکیک رینگ داخلی و بین‌المللی نشان داده شده است.

جدول ۱- ارزش ریالی و حجم کل معاملات به تفکیک رینگ (خردادماه ۱۳۹۸)

رینگ معاملات	ارزش معامله شده (ریال)	حجم کل معامله شده (تن)
داخلی	۶،۲۹۹،۰۹۰،۱۷۱،۰۰۰	۱۲۸،۷۸۲/۶
بین‌الملل	۳،۵۶۱،۷۰۶،۹۱۳،۹۹۳	۶۳،۳۴۰/۹
مجموع	۹،۸۶۰،۷۹۷،۰۸۴،۹۹۳	۱۹۲،۱۲۳/۵

شایان ذکر است از کل معاملات انجام‌شده در خردادماه ۱۳۹۸ بیش از ۹۲ درصد ارزش معاملات مربوط به تابلوی سایر حامل‌های انرژی و حدوداً ۷ درصد مربوط به تابلوی نفت و گاز بوده است. جدول ۲ ارزش و حجم معاملات به تفکیک تابلوهای معاملاتی بازار فیزیکی بورس انرژی ایران را نشان می‌دهد.

جدول ۲- ارزش و حجم معاملات به تفکیک تابلو (خردادماه ۱۳۹۸)

تابلو	ارزش معامله شده (ریال)	حجم کل معامله شده (تن)
تابلوی سایر حامل‌های انرژی	۹،۱۲۹،۹۴۴،۸۶۴،۹۹۳	۱۷۷،۲۸۵
تابلو نفت و گاز	۷۳۰،۸۵۲،۲۲۰،۰۰۰	۱۴،۸۳۹
مجموع	۹،۸۶۰،۷۹۷،۰۸۴،۹۹۳	۱۹۲،۱۲۳

عرضه‌کنندگان، کالاها و نوع معامله

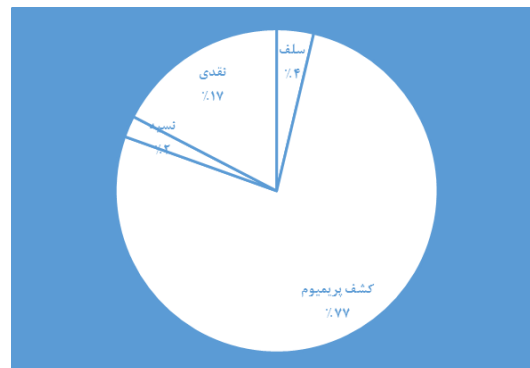
فعالیت عرضه‌کنندگان و میزان عرضه‌های صورت گرفته توسط آنها، نقش مهمی در توسعه معاملات بورس انرژی ایران ایفا می‌نماید. به طوری که پنج عرضه‌کننده بازار فیزیکی فرآورده‌های هیدروکربوری مجموعاً بیش از ۵۳ درصد از حجم معاملات بازار فیزیکی را به خود اختصاص داده‌اند که این عرضه‌کنندگان به ترتیب عبارتند از:

شرکت پالایش نفت لاوان، شرکت نفت ستاره خلیج فارس، شرکت پتروشیمی زاگرس، شرکت پالایش نفت تهران و شرکت پالایش نفت تبریز. همچنین عرضه کنندگانی که مجموعاً بیش از ۵۶ درصد از ارزش معاملات بازار فیزیکی را دربرمی گیرند به ترتیب عبارتند از: شرکت پالایش نفت لاوان، شرکت نفت ستاره خلیج فارس، شرکت پالایش نفت تبریز، شرکت پالایش نفت اصفهان و شرکت پالایش نفت تهران.

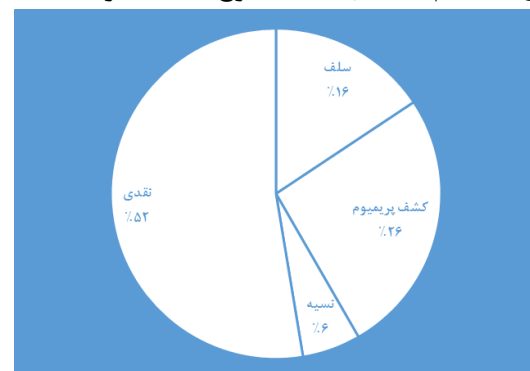
از سوی دیگر اگر بخواهیم نگاهی به میزان معامله کالاهای عرضه شده بیاندازیم، بیشترین حجم معاملات کالاها طی خردادماه ۱۳۹۸ به ترتیب مربوط به کالاهای حلال ۴۰۲، نفتای سنگین، متانول و گاز مایع (مجموعاً بیش از ۵۸ درصد) و بیشترین ارزش معاملات به ترتیب مربوط به حلال ۴۰۲، نفتای سنگین، گاز مایع و آیزوریسایکل (مجموعاً حدود ۵۸ درصد) بوده است.

همچنین مطابق با دستورالعمل معاملات کالا و اوراق بهادار قابل معامله در بورس انرژی ایران، تمامی عرضه‌های بازار فیزیکی براساس چهار نوع قرارداد نقدی، نسیه، سلف و کشف پرمیوم انجام می‌پذیرد. براین اساس حجم عرضه و معامله کالاهای بازار فرآورده‌های هیدروکربوری به تفکیک نوع قرارداد در نمودارهای ۱ و ۲ نشان داده شده است.

نمودار ۱- حجم عرضه به تفکیک نوع معامله (خردادماه ۱۳۹۸)



نمودار ۲- حجم معامله به تفکیک نوع معامله (خردادماه ۱۳۹۸)



همان‌طور که مشاهده می‌شود طی خردادماه ۱۳۹۸، بیشتر عرضه‌های صورت گرفته در قالب قرارداد کشف پرمیوم و بیشترین قراردادهای معاملاتی نیز به صورت نقدی بوده است.

نخستین عرضه و نخستین معامله

طی خردادماه ۱۳۹۸ بازار فیزیکی بورس انرژی ایران میزبان نخستین عرضه کالاهای زیر بوده است:

- بلندینگ نفتا پالایش نفت بندرعباس در رینگ داخلی
- متانول شرکت متانول کاوه در رینگ داخلی
- رافینت شرکت پتروشیمی نوری در رینگ داخلی
- برش سبک شرکت پتروشیمی نوری در رینگ داخلی
- رافینت پتروشیمی بیستون در رینگ بین‌الملل
- نفت سفید شرکت ملی پخش فرآورده های نفتی ایران در رینگ بین الملل از انبار نفت کرمان به مقصد پاکستان
- نفت گاز (گازوئیل) شرکت ملی پخش فرآورده های نفتی ایران در رینگ بین الملل از انبار نفت کرمان به مقصد پاکستان
- نفت سفید شرکت ملی پخش فرآورده های نفتی ایران در رینگ بین الملل از انبار نفت تبریز به مقصد عراق
- برش سنگین حاصل از پالایشگاه نفت و پتروشیمی به جز بنزین و گازوئیل پتروشیمی بیستون در رینگ بین‌الملل

همچنین نخستین معامله طی این ماه مربوط به کالاهای زیر بوده است:

- بلندینگ نفتا پالایش نفت بندرعباس در رینگ داخلی
- متانول شرکت متانول کاوه در رینگ داخلی
- رافینت پتروشیمی بیستون در رینگ بین‌الملل
- برش سنگین حاصل از پالایشگاه نفت و پتروشیمی به جز بنزین و گازوئیل پتروشیمی بیستون در رینگ بین‌الملل

بازار مشتقه:

طی خردادماه ۱۳۹۸ اوراق سلف موازی استاندارد نفت خام (سنفت ۹۸۲، ۹۸۳ و ۹۸۴) به ارزشی بالغ بر ۵۲۹ میلیارد ریال و تعداد ۶۰،۶۳۶ اوراق در تابلوی سلف موازی استاندارد معامله گردید.

جدول ۳- ارزش و حجم قراردادهای سلف موازی استاندارد بازار فرآورده‌های هیدروکربوری (خردادماه ۱۳۹۸)

حجم معامله (تعداد اوراق)	ارزش معامله (ریال)	نام قرارداد
۸۵۱	۵.۷۵۳.۴۱۴.۲۳۰	قراردادهای سلف موازی استاندارد نفت خام سبک داخلی عرضه شده توسط وزارت امور اقتصاد و دارایی به نمایندگی از دولت جمهوری اسلامی ایران (سنفت ۹۸۲)
۵۳.۹۸۰	۴۷۰.۴۴۳.۵۱۰.۶۰۰	قراردادهای سلف موازی استاندارد نفت خام سبک داخلی عرضه شده توسط وزارت امور اقتصاد و دارایی به نمایندگی از دولت جمهوری اسلامی ایران (سنفت ۹۸۳)
۵.۸۰۵	۵۲.۵۰۶.۲۲۵.۰۰۰	قراردادهای سلف موازی استاندارد نفت خام سبک داخلی عرضه شده توسط وزارت امور اقتصاد و دارایی به نمایندگی از دولت جمهوری اسلامی ایران (سنفت ۹۸۴)
۶۰.۶۳۶	۵۲۸.۷۰۳.۱۴۹.۸۳۰	مجموع