



بازار فرآورده‌های هیدروکربوری

گزارش آماری تیرماه ۱۳۹۸

نگاهی به بازار فرآورده‌های هیدروکربوری

بازار فیزیکی:

طی تیرماه ۱۳۹۸ در بازار فیزیکی بورس انرژی ایران بیش از ۲۹۹،۵۳۱ تن انواع فرآورده‌های هیدروکربوری به ارزش بیش از ۱۳،۳۵۷ میلیارد و ۵۶۷ میلیون ریال مورد معامله قرار گرفت. بیش از ۲۰۷،۹۳۲ تن از محصولات معامله‌شده در رینگ داخلی و بیش از ۹۱،۵۹۹ تن در رینگ بین‌الملل بازار فیزیکی مورد داد و ستد قرار گرفته‌اند. همچنین ارزش ریالی معاملات در رینگ داخلی بیش از ۹،۵۷۰ میلیارد و ۱۵۰ میلیون ریال و در رینگ بین‌الملل بیش از ۳،۷۸۷ میلیارد و ۴۱۶ میلیون ریال بوده است. گفتنی است ارزش معاملات طی تیرماه ۱۳۹۸ در مقایسه با مدت مشابه سال قبل، از افزایش ۶۷ درصدی برخوردار بوده است که در آن ارزش معاملات رینگ داخلی با افزایش تقریباً ۵۰ درصدی و ارزش معاملات رینگ بین‌الملل نیز با افزایش بیش از دو برابری مواجه گردیده 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 (تیرماه ۱۳۹۸)

رینگ معاملات	ارزش معامله شده (ریال)	حجم کل معامله شده (تن)
داخلی	۹،۵۷۰،۱۵۰،۸۳۴،۰۰۰	۲۰۷،۹۳۲/۷
بین‌الملل	۳،۷۸۷،۴۱۶،۹۹۸،۹۰۰	۹۱،۵۹۹/۱
مجموع	۱۳،۳۵۷،۵۶۷،۸۳۲،۹۰۰	۲۹۹،۵۳۱/۸

عرضه و تقاضا

همانطور که در جدول ۲ قابل مشاهده است، حجم عرضه، تقاضا و معامله فرآورده‌های هیدروکربوری طی تیرماه ۱۳۹۸ به تفکیک رینگ نشان داده شده است. همچنین نسبت حجم تقاضا به حجم عرضه، نسبت حجم معامله به حجم عرضه و نسبت حجم معامله به حجم تقاضا نیز محاسبه گردیده است. بر این اساس، حجم عرضه در رینگ بین‌الملل بیش از دو برابر حجم عرضه در رینگ داخلی است. اگرچه حجم تقاضا در این دو رینگ تقریباً با یکدیگر مساوی بوده و حجم معامله در رینگ داخلی بیش از دو برابر حجم معامله در رینگ بین‌الملل است. همچنین ۳۲ درصد از عرضه‌های داخلی با تقاضا همراه بوده و ۲۹ درصد نیز منجر به معامله شده است.

جدول ۲- حجم عرضه، تقاضا، معامله و نسبت‌های مربوط به تفکیک رینگ (تیرماه ۱۳۹۸)

رینگ	حجم عرضه (تن)	حجم تقاضا (تن)	حجم معامله (تن)	نسبت تقاضا به عرضه (درصد)	نسبت معامله به عرضه (درصد)	نسبت معامله به تقاضا (درصد)
داخلی	۷۲۸،۱۰۹	۲۳۵،۱۱۱	۲۰۷،۹۳۳	۲۹	۳۲	۸۸
بین‌الملل	۱،۵۷۹،۳۵۲	۲۳۸،۷۲۸	۹۱،۵۹۹	۶	۱۵	۳۸

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 سه عرضه‌کننده بازار فیزیکی فرآورده‌های هیدروکربوری مجموعاً حدود ۵۰ درصد از حجم معاملات بازار فیزیکی را به خود اختصاص داده‌اند که این عرضه‌کنندگان به ترتیب عبارتند از: شرکت پالایش نفت کرمانشاه، شرکت نفت ستاره خلیج فارس و شرکت پالایش نفت لاوان. همچنین عرضه‌کنندگانی که مجموعاً بیش از ۵۵ درصد از ارزش معاملات بازار فیزیکی را دربرمی‌گیرند به ترتیب عبارتند از: شرکت پالایش نفت کرمانشاه، شرکت پالایش نفت لاوان، شرکت نفت ستاره خلیج فارس و شرکت پالایش نفت شیراز.

همچنین طی تیرماه ۱۳۹۸ در رینگ داخلی و بین‌المللی بورس انرژی ایران، ۴۷ کالا عرضه گردیده که اسامی آنها در جدول ۳ نشان داده شده است.

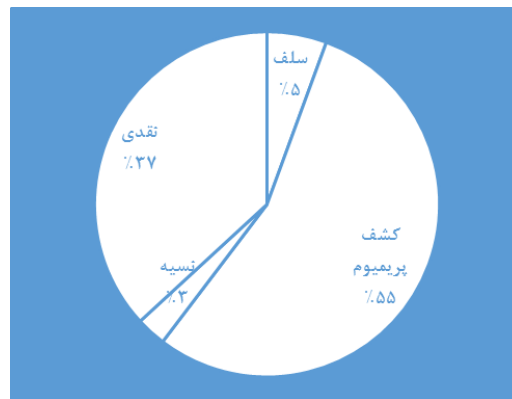
جدول ۳- کالاهای عرضه‌شده به تفکیک رینگ (تیرماه ۱۳۹۸)

برش سنگین	رینگ بین‌المللی	نفتای سبک	حلال ۴۱۰	آیزوریسایکل	رینگ داخلی
حلال ۴۰۲		نفتای سنگین	حلال ۵۰۲	آیزوفید	
حلال ۵۰۳		نیتروژن مایع	حلال ۵۰۳	برش سبک	
رافینت		هگزان	رافینت	برش سنگین	
سوخت هوایی (ATK)		هیدروکربن	ریفورمیت	بلندینگ نفتا حلال ۴۱۰	
گاز مایع			سی اس او	بنزول	
میعانات گازی			سی او	پروپان	
نفت خام سبک			گاز بوتان صنعتی	پروپیلن	
نفت خام سنگین			گاز پروپان صنعتی	پنتان	
نفت سفید			گاز مایع	پنتان پلاس	
نفت گاز			گاز مایع صنعتی	حلال ۴۰۰	
نفتا			متانول	حلال ۴۰۲	
نفتای سنگین			میعانات گازی	حلال ۴۰۴	
هیدروکربن سبک			نفت سفید	حلال ۴۰۶	

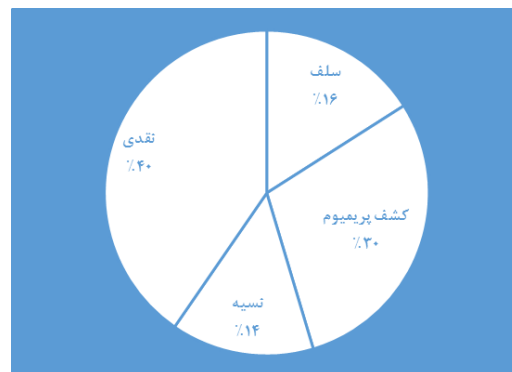
از سوی دیگر اگر بخواهیم نگاهی به میزان معامله کالاهای عرضه‌شده بیاندازیم، بیشترین حجم معاملات طی تیرماه ۱۳۹۸ به ترتیب مربوط به کالاهای گاز مایع، هیدروکربن و نفتای سنگین (مجموعاً بیش از ۵۲ درصد) و بیشترین ارزش معاملات به ترتیب مربوط به هیدروکربن، نفتای سنگین، گاز مایع و آیزوریسایکل (مجموعاً بیش از ۵۵ 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 فرآورده های هیدروکربوری به تفکیک نوع قرارداد در نمودارهای ۱ و ۲ نشان داده شده است.

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



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



همان‌طور که مشاهده می‌شود طی تیرماه 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 تیرماه ۱۳۹۸ بازار فیزیکی بورس انرژی ایران میزبان نخستین عرضه کالاهای زیر بوده است:

- گاز مایع شرکت پتروشیمی پارس در رینگ داخلی
- سی اس او پالایش نفت شازند (عرضه توسط شازند) در رینگ داخلی
- پروپان مایع پتروشیمی آبادان در رینگ داخلی
- هیدروکربن سبک حاصل از بلندینگ کد MT227 معماران تجارت آفتاب در رینگ بین‌الملل

همچنین نخستین معاملات صورت گرفته طی این ماه مربوط به کالاهای زیر بوده است:

- سی اس او پالایش نفت شازند (عرضه توسط شازند) در رینگ داخلی
- بنزول خام ذوب آهن اصفهان در رینگ داخلی

قیمت محصولات پتروشیمی

یکی از بازارهای فعال در بورس انرژی ایران، عرضه محصولات تولیدی توسط شرکت‌های پتروشیمی می‌باشد. یکی از نکات حائز اهمیت در این عرضه‌ها، اعلام قیمت‌های پایه محصولات پتروشیمی به صورت هفتگی و توسط دفتر توسعه صنایع پایین دستی صنایع ملی پتروشیمی می‌باشد که روند قیمت‌های پایه اعلامی طی تیرماه سال جاری در نمودار ۳ نشان داده شده است. همان‌طور که مشاهده می‌شود قیمت کالاهای متانول، گاز مایع صنعتی، گاز بوتان صنعتی، گاز پروپان صنعتی و پروپان پلاس نسبت به ابتدای تیرماه سال جاری روندی نزولی داشته‌اند و قیمت سایر محصولات نسبت به ابتدای تیرماه با یک روند افزایشی روبه‌رو بوده است.

نمودار ۳- روند قیمت پایه محصولات پتروشیمی به ریال (تیرماه ۱۳۹۸)



منبع: شرکت ملی صنایع پتروشیمی (pdid.nipc.ir)

بازار مشتقه:

طی تیرماه ۱۳۹۸ اوراق سلف موازی استاندارد نفت کوره ۳۸۰ سانتی استوک (سمانک ۹۸۱، ۹۸۲ و ۹۹۱) و اوراق سلف موازی استاندارد نفت خام سبک داخلی (سنفت ۹۸۲، ۹۸۳ و ۹۸۴) به ارزشی بیش از ۴،۱۸۱ میلیارد ریال و تعداد ۱۶۸،۸۱۲ اوراق در تابلوی سلف موازی استاندارد معامله گردید.

جدول ۴- ارزش و حجم قراردادهای سلف موازی استاندارد بازار فرآورده‌های هیدروکربوری (تیرماه ۱۳۹۸)

نام قرارداد	ارزش معامله (ریال)	حجم معامله (تعداد اوراق)
قرارداد سلف موازی استاندارد نفت کوره ۳۸۰ سانتی استوک- سمانک ۹۸۱	۶۴۳،۳۸۸،۷۲۶،۶۹۰	۱۳،۷۵۹
قرارداد سلف موازی استاندارد نفت کوره ۳۸۰ سانتی استوک- سمانک ۹۸۲	۱،۱۰۶،۵۳۰،۸۳۸،۶۷۰	۲۱،۴۱۸
قرارداد سلف موازی استاندارد نفت کوره ۳۸۰ سانتی استوک- سمانک ۹۹۱	۱،۴۸۲،۶۷۶،۷۸۷،۲۰۰	۲۵،۱۶۰
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)	۷۱،۲۶۰،۷۶۲،۹۰۰	۹،۲۷۵
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)	۸۵۰،۲۷۷،۴۳۶،۰۰۰	۹۶،۲۰۰
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)	۲۷،۱۳۵،۰۰۰،۰۰۰	۳،۰۰۰
مجموع	۴،۱۸۱،۲۶۹،۵۵۱،۴۶۰	۱۶۸،۸۱۲