



بازار فرآورده‌های هیدروکربوری

گزارش آماری فروردین‌ماه ۱۳۹۸

نگاهی به بازار فرآورده‌های هیدروکربوری

بازار فیزیکی:

طی فروردین ماه ۱۳۹۸ در بازار فیزیکی بورس انرژی ایران بیش از ۱۱۵،۱۰۷ تن انواع فرآورده‌های هیدروکربوری به ارزش بیش از ۵،۴۸۴ میلیارد و ۷۷۹ میلیون ریال مورد معامله قرار گرفت. بیش از ۱۰۷،۷۳۲ تن از محصولات معامله‌شده به رینگ داخلی و ۷،۳۷۵ تن به رینگ بین‌الملل بازار فیزیکی اختصاص دارد. همچنین ارزش ریالی معاملات در رینگ داخلی بیش از ۴،۹۶۹ میلیارد و ۷۹۹ میلیون ریال و در رینگ بین‌الملل بیش از ۵۱۴ میلیارد و ۹۷۹ میلیون ریال بوده است. یکی از نکات قابل توجه افزایش ۹۰ درصدی ارزش کل معاملات طی فروردین‌ماه سال ۱۳۹۸ در مقایسه با مدت مشابه در سال ۱۳۹۷ می‌باشد که به ترتیب در رینگ داخلی افزایش بیش از دو برابری و در رینگ بین‌الملل افزایش حدود ۱۸ درصدی را تجربه کرده است. از سوی دیگر، حجم کل معاملات نسبت به فروردین ماه سال ۹۷ با کاهش تقریبی ۱۶ درصدی مواجه گردیده است.

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

رینگ معاملات	ارزش معامله شده (ریال)	حجم کل معامله شده (تن)
داخلی	۴،۹۶۹،۷۹۹،۶۵۷،۰۰۰	۱۰۷،۷۳۲/۲
بین‌الملل	۵۱۴،۹۷۹،۸۶۸،۸۱۱	۷،۳۷۴/۹
مجموع	۵،۴۸۴،۷۷۹،۵۲۵،۸۱۱	۱۱۵،۱۰۷/۱

شایان ذکر است از کل معاملات انجام‌شده در فروردین‌ماه ۱۳۹۸ حدود ۸۴ درصد ارزش معاملات (بیش از ۴،۵۹۲ میلیارد و ۳۲۸ میلیون ریال) مربوط به تابلوی سایر حامل‌های انرژی و حدوداً ۱۶ درصد (بیش از ۸۹۲ میلیارد و ۴۵۱ میلیون ریال) مربوط به تابلوی نفت و گاز بوده است.

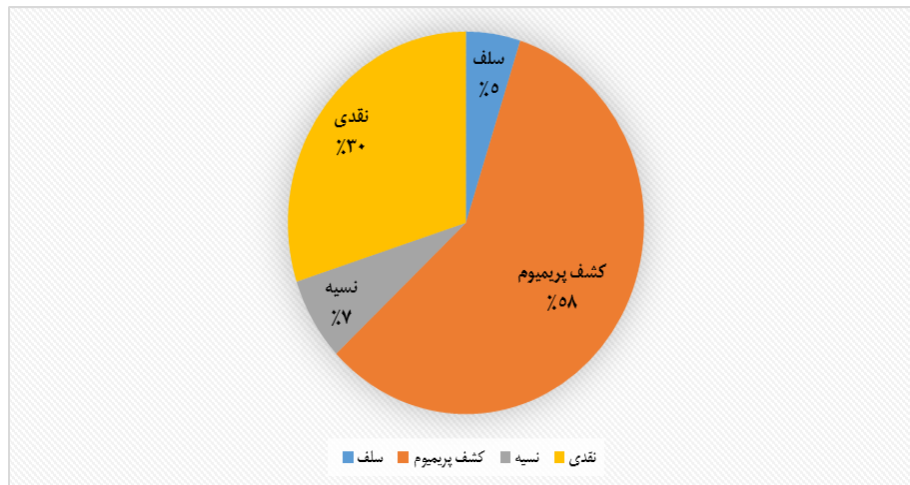
جدول ۲- ارزش و حجم معاملات به تفکیک تابلو (فروردین‌ماه ۱۳۹۸)

تابلو	ارزش معامله شده (ریال)	حجم کل معامله شده (تن)
تابلو سایر حامل‌های انرژی	۴،۵۹۲،۳۲۸،۱۴۱،۸۱۱	۹۲،۷۹۹/۱
تابلو نفت و گاز	۸۹۲،۴۵۱،۳۸۴،۰۰۰	۲۲،۳۰۸
مجموع	۵،۴۸۴،۷۷۹،۵۲۵،۸۱۱	۱۱۵،۱۰۷/۱

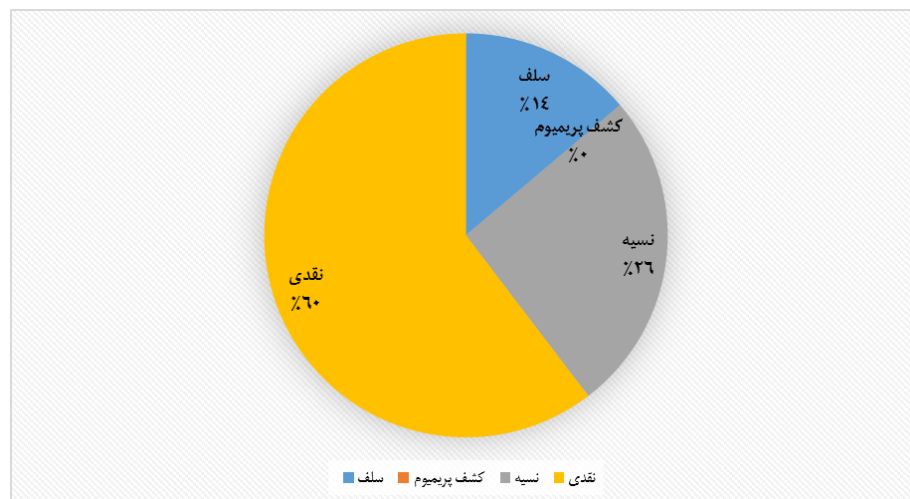
فعالیت عرضه‌کنندگان و میزان عرضه‌های صورت گرفته توسط آنها، نقش مهمی در توسعه معاملات بورس انرژی ایران ایفا می‌نماید، به طوری که چهار عرضه‌کننده با بیشترین حجم و ارزش معاملات در بازار فیزیکی عبارتند از: شرکت پالایش نفت تهران، شرکت پالایش گاز ایلام، شرکت پالایش نفت اصفهان و شرکت پالایش نفت شیراز. همچنین چهار کالای حلال ۴۰۲، میعانات گازی، نفتای سنگین و متانول نیز دارای بیشترین میزان معاملات در بازار فیزیکی (از نظر حجم و ارزش) بوده‌اند.

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 (فروردین ماه ۱۳۹۸)



نمودار ۲- حجم معامله به تفکیک نوع معامله (فروردین ماه ۱۳۹۸)



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

بازار مشتقه:

پس از تامین مالی فعالیت‌های دولت و شرکت ملی نفت ایران با استفاده از انتشار اوراق سلف موازی استاندارد نفت خام (سنفت ۹۸۱، ۹۸۲، ۹۸۳، ۹۸۴، ۹۸۵ و ۹۸۶) در تابلوی سلف موازی استاندارد بازار مشتقه بورس انرژی ایران در اسفندماه ۱۳۹۷، بازار ثانویه این اوراق نیز در فروردین ماه به معاملات خود ادامه داد. به طوری که شرکت ملی نفت ایران با انتشار اوراق سلف موازی استاندارد به ارزش ۱۱،۰۰۰ میلیارد ریال و وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت جمهوری اسلامی ایران با انتشار اوراق به ارزش ۳۰،۰۰۰ میلیارد ریال در اواخر سال ۱۳۹۷ اقدام به تامین مالی فعالیت‌های خود نمودند. در طول فروردین ماه امسال ۱۳۹۰،۳۶۴ اوراق سلف موازی استاندارد نفت خام سبک داخلی وزارت امور اقتصادی و دارایی به نمایندگی از دولت در نمادهای سنفت ۹۸۱، ۹۸۲، ۹۸۳ و ۹۸۴ به ارزش بیش از ۱،۲۱۵ میلیارد و ۵۲۳ میلیون ریال در بازار مشتقه فرآورده‌های هیدروکربوری بورس انرژی ایران مورد معامله قرار گرفت.

نام قرارداد	ارزش معامله (ریال)	حجم معامله (تعداد اوراق)
قراردادهای سلف موازی استاندارد نفت خام سبک داخلی عرضه شده توسط وزارت امور اقتصاد و دارایی به نمایندگی از دولت جمهوری اسلامی ایران (سنفت ۹۸۱)	۱،۲۱۲،۶۸۲،۹۱۸،۰۰۰	۱۳۹،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 ۹۸۲)	۲،۳۸۴،۹۱۳،۵۳۰	۳۰۹
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)	۴۱۳،۰۰۰،۰۰۰	۵۰
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)	۴۲،۷۳۲،۸۰۰	۵
مجموع	۱،۲۱۵،۵۲۳،۵۶۴،۳۳۰	۱۳۹،۳۶۴