

آسیب‌شناسی سازکار تأمین محصولات پتروشیمیایی از بورس کالا



انديشکده اقتصاد مقاومتی

گروه انرژی

مرداد ماه ۱۴۰۴

بسم الله الرحمن الرحيم

رهبر معظم انقلاب: علاج برون رفت از مشکلات کشور «اقتصاد مقاومتی» است.

اندیشکده اقتصاد مقاومتی: تصمیم بهتر، آینده روشن‌تر

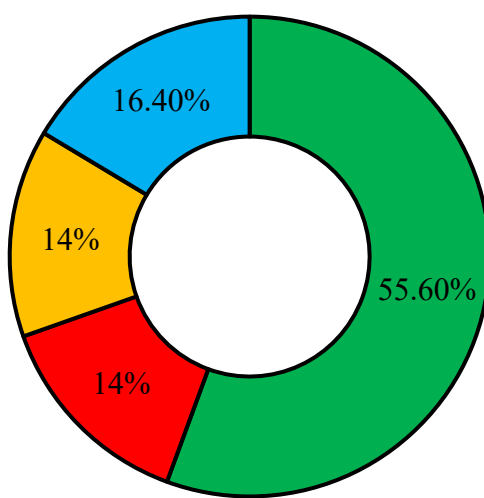
اندیشکده اقتصاد مقاومتی یک «کانون تفکر و تصمیم‌سازی» است که از سال ۱۳۹۵ فعالیت رسمی خود را آغاز کرد. اندیشکده به مسئولین و دستگاه‌ها کمک می‌کند تا تصمیمات بهتری اتخاذ نمایند. طبق تعریف اندیشکده، اقتصاد مقاومتی یک «الگوی حکمرانی اقتصادی» است، به این معنا که سیاست‌ها، قوانین، قواعد و اقدامات طوری طراحی شود که کشور با کمترین اثرپذیری از تکان‌های داخلی و خارجی، رشد و پیشرفت پایدار داشته باشد. «شناسایی مسائل از طریق بررسی‌های میدانی و عملیاتی» در گام اول، «تولید راهکار و تصمیم برای حل مسائل با بهره‌گیری از آرای خبرگان و تجربیات جهانی و با در نظر گرفتن ملاحظات و پیچیدگی‌های تصمیم‌گیری» در گام دوم، «ترویج مباحث جهت اقناع و همراه‌سازی عموم با تصمیم مدنظر» در گام سوم و «پیگیری اتخاذ تصمیم و اجرای آن» در گام چهارم، از جمله فعالیت‌هایی است که با هدف «مقاوم‌سازی اقتصاد» در اندیشکده انجام می‌شود. علاقه‌مندان می‌توانند از طریق سایت Mett.ir با اندیشکده اقتصاد مقاومتی در ارتباط باشند و نظرات، انتقادات و پیشنهادهای خود را در خصوص این گزارش و سایر فعالیت‌های اندیشکده مطرح نمایند؛ همچنین با حمایت معنوی و مادی از اندیشکده، در تصمیم‌گیری بهتر ارکان کشور و ساخت آینده روشن‌تر سهیم شوند.

آسیب‌شناسی سازکار تأمین محصولات پتروشیمیایی از بورس کالا

انرژی	گروه موضوعی:
پژوهشی	نوع گزارش:
۱۴۰۴۰۵۱۳۸	شناسه:
۱۴۰۴/۰۵/۱۰	تاریخ انتشار:
علیرضا علی‌اکبری	تهیه و تدوین:
سعید نوری کرم	مدیر مطالعه:
محمد قائدامینی	ناظر علمی:
افشین غلامعلی پور	اظهار نظر کننده:

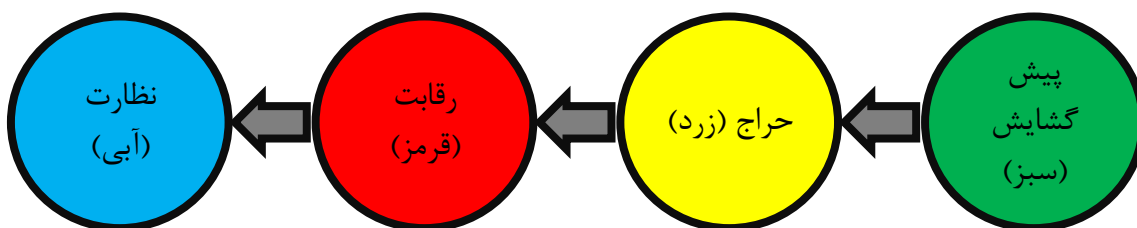
خلاصه مدیریتی

سازکار کارآمد و موثر برای عرضه محصولات پتروشیمیایی مورد نیاز صنایع پایین‌دستی، از الزامات اساسی در مسیر توسعه این صنایع و تحقق رشد اقتصادی به شمار می‌رود. بررسی سهم هر یک از مسیرهای عرضه در فروش داخلی محصولات پتروشیمیایی در سال ۱۴۰۲، بر پایه داده‌های ارائه شده در نمودار زیر، نشان‌دهنده اهمیت و نقش کلیدی این سازکار در نظام توزیع محصولات پتروشیمیایی کشور است.



سایر ■ جهاد کشاورزی ■ شرکت ملی پالایش و پخش و شرکت ملی گاز ■ بورس کالا و انرژی

مطابق نمودار فوق، ۵۶ درصد از عرضه محصولات پتروشیمیایی به صنایع پایین‌دستی که معادل حدود ۷ میلیون تن فروش داخلی این محصولات است، از مسیر بورس کالا و انرژی صورت می‌گیرد. اساساً هرگونه بازتعریف سازکار تأمین محصولات پتروشیمیایی کشور، در ابتدا نیازمند بررسی فرایند عرضه بورسی و سپس آسیب‌شناسی این سازکار است. در همین راستا، شناخت دقیق مراحل اجرایی فرایند حراج در بازار معاملات کالای فیزیکی بورس کالا، به‌عنوان بخش محوری این سازکار ضرورت دارد. این فرایند از چهار مرحله اصلی تشکیل شده که در شکل زیر نمایش داده شده است:



در مرحله نخست، موسوم به «پیش‌گشایش»، امکان ثبت سفارش توسط متقاضیان فراهم می‌شود و حجم تقاضا تعیین می‌گردد. در مرحله دوم یعنی دوره «حراج» یا «مظنه‌یابی»، اگرچه امکان ثبت یا حذف سفارش وجود

ندارد، اما خریداران می‌توانند با افزایش نرخ پیشنهادی و کاهش حجم سفارش، شرایط سفارش خود را بازتنظیم کنند. پس از دوره مظنه‌یابی اگر مازاد تقاضا وجود داشته باشد خریداران وارد «رقابت» می‌شوند. هنگام رقابت، امکان وارد کردن قیمت‌هایی بالاتر از قیمت پایه وجود دارد و قیمت‌های پیشنهادی بالاتر در اولویت قرار می‌گیرند. در نهایت طی دوره نظارت، صحت و سقم معاملات توسط ناظر بازار بررسی می‌شود و در صورت وجود مشکل، معامله در حالت تصمیم‌گیری قرار می‌گیرد.

با وجود انسجام نسبی در سازکار فرایندی معاملات بورس کالا، الگوی کنونی تأمین محصولات پتروشیمیایی از این بستر با چالش‌های ساختاری و اجرایی متعددی مواجه است. این چالش‌ها، که برخی از آن‌ها ریشه در سازکارهای حاکم بر بورس و برخی دیگر ناشی از ضعف‌های سیاست‌گذاری در زنجیره تأمین هستند، موجب بروز نارسایی‌هایی در تخصیص مطلوب محصولات شده‌اند.

پس از ارزیابی و آسیب‌شناسی الگوی تأمین محصولات پتروشیمیایی در بستر بورس کالا، مهم‌ترین مشکلات و مسائل به شرح ذیل احصاء شده است:

- (۱) رقابت غیرواقعی در بورس کالا
- (۲) نظام سهمیه‌بندی خرید محصولات پتروشیمیایی
- (۳) چندپارگی سامانه‌های فعال در زنجیره تأمین محصولات پتروشیمیایی
- (۴) خلأ آماری از میزان تولید صنایع پایین‌دستی و تأثیر آن بر بازار و سیاست‌گذاری
- (۵) فروش داخلی در بازارهای غیررسمی
- (۶) قاچاق محصولات پتروشیمیایی
- (۷) تداخل مقررات بورس کالا با ملاحظات عرضه محصولات پتروشیمیایی
- (۸) کمبود کدهای تعرفه اختصاصی محصولات پتروشیمیایی

برخی از مشکلات و مسائل موجود در نظام تأمین محصولات پتروشیمیایی، ریشه در عوامل ساختاری و نظام‌مند دارند. از جمله این عوامل می‌توان به نبود برنامه‌ریزی میان‌مدت و بلندمدت برای مدیریت عرضه محصولات پتروشیمیایی، تقاضای فصلی، عدم تولید یا کمبود تولید پتروشیمی‌ها، تغییرات نرخ ارز، انتظارات تورمی و کمبود کدهای تعرفه اختصاصی محصولات پتروشیمیایی اشاره کرد.

بنابراین برخی تغییرات که ناظر به نقاط مهم مدل تأمین اعمال می‌شود، می‌تواند منجر به رفع چندین مشکل از الگوی تأمین فعلی گردد. یک نقطه‌ی مهم که به تنظیم تقاضای محصولات مرتبط است بحث بازنگری و پایش مستمر سهمیه‌های خرید توسط وزارت صنعت، معدن و تجارت است و یکی دیگر از نقاط دارای اهمیت

که به تنظیم‌گری عرضه محصولات می‌انجامد، موضوع تنظیم ساختار عرضه توسط شرکت ملی صنایع پتروشیمی است.

در شرایط فعلی، سهمیه‌های کاذب یا همان سهمیه‌های تخصیص داده شده به واحدهایی که صرفاً به خرید و فروش مواد اولیه می‌پردازند، دلیل اصلی شکل‌گیری فروش داخلی در بازار غیررسمی هستند. پیاده‌سازی سیستم دو مرحله‌ای برای تخصیص سهمیه به واحدهای متقاضی دریافت سهمیه، پایش و رصد مستمر سهمیه‌ها به‌منظور حذف سهمیه‌های کاذب و افزایش سهمیه تولیدکنندگان واقعی، گام مهمی در راستای مقابله با افزایش رقابت خرید محصولات پتروشیمیایی خواهد بود.

همچنین به‌منظور ارتقای کارآمدی در مدیریت عرضه محصولات پتروشیمیایی، نیاز است که شرکت ملی صنایع پتروشیمی، فراتر از اقدامات و برنامه‌ریزی‌های جاری، نقش فعال‌تری در حوزه تنظیم‌گری و مهندسی عرضه ایفا کند. در این مسیر، تحلیل روندهای عرضه و تقاضا و پیش‌بینی نوسانات مرتبط با عواملی نظیر تقاضای فصلی و دوره‌های تعمیرات اساسی مجتمع‌های پتروشیمی، از الزامات اساسی به‌شمار می‌رود.

علاوه بر این، بهره‌گیری از فناوری‌هایی نظیر هوش مصنوعی، اینترنت اشیا و یادگیری ماشین در حوزه‌هایی همچون گردآوری و تحلیل داده، پیش‌بینی تقاضای بازار، مدیریت زنجیره تأمین و اجرای نظام قیمت‌گذاری پویا، می‌تواند نقش مؤثری در تسریع فرایندهای تصمیم‌گیری و ارتقای بهره‌وری ایفاء کند.

در شرایط کنونی، ایجاد اصلاحات و اعمال تغییرات در سازکارهای فعلی، قابل پذیرش‌تر و دارای قابلیت اجرایی بیش‌تری در مقایسه با تعریف بستر و سازکار جدید برای عرضه محصولات پتروشیمیایی است. به همین منظور، فعال‌سازی ظرفیت‌های مغفول بورس کالا برای استفاده در معاملات محصولات پتروشیمیایی مانند استفاده از گواهی سپرده کالایی می‌تواند تأثیر قابل توجهی در پویایی بخشی به الگوی تأمین فعلی داشته باشد.

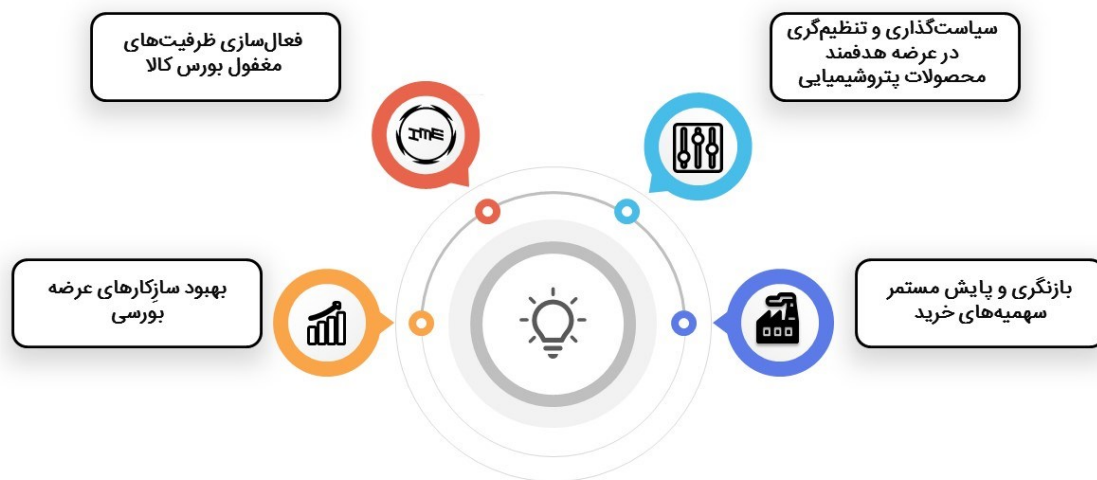
گواهی سپرده کالایی، به‌ویژه در شرایطی که فرایند کشف قیمت به‌درستی انجام شده باشد، می‌تواند ابزار مؤثری برای کنترل و کاهش التهابات بازار تلقی شود. کاهش هزینه‌های انبارداری برای پتروشیمی‌ها، بهبود استانداردسازی کالاها، ایجاد شرایط مناسب برای معاملات خرد محصولات پتروشیمیایی، کمک به ایجاد و توسعه صندوق‌های سرمایه‌گذاری قابل معامله به‌عنوان دارایی پایه و همچنین تأمین مالی از جمله مهم‌ترین مزایای این گواهی‌ها برای استفاده در معاملات محصولات پتروشیمیایی محسوب می‌شود.

در کنار فعال‌سازی ظرفیت‌های یادشده، بهبود برخی از سازکارهای عرضه در بورس، از جمله بازنگری در شیوه اعمال سقف تناژ خرید برای محصولات دارای بازار ملتهب و اتخاذ سیاست کارمزد منعطف در شرایط افزایش رقابت، می‌تواند در ارتقای کارایی بازار و بهبود تخصیص منابع مؤثر باشد.

پیشنهادهای ارائه شده در گزارش، بر مبنای آسیب‌شناسی مسائل اولویت‌دار در الگوی تأمین محصولات پتروشیمیایی از بستر بورس کالا تدوین شده است. بازنگری و پایش مستمر سهمیه‌های خرید، سیاست‌گذاری و تنظیم‌گری در عرضه هدفمند محصولات و فعال‌سازی ظرفیت‌های مغفول بورس کالا از اهم این پیشنهادها به‌شمار می‌رود.

بازتعریف سازکارهای موجود با تمرکز بر اولویت‌بندی مسائل و اجرای راهکارهای مطرح‌شده، می‌تواند گامی مؤثر در جهت دستیابی به الگوی مطلوب برای تأمین محصولات باشد؛ الگویی که تأمین پایدار، کافی، آسان و مقرون‌به‌صرفه محصولات را میسر سازد. تحقق این هدف، بستر مناسبی برای رشد و توسعه واحدهای پایین‌دستی فراهم ساخته و در پی آن، انگیزه و تمایل این صنایع جهت گسترش فعالیت‌ها و سرمایه‌گذاری در حوزه تولید تقویت خواهد شد.

مهم‌ترین راهکارهای بیان شده که در گزارش نیز به تفصیل مورد بررسی قرار گرفته‌اند، در شکل زیر قابل مشاهده است:



فهرست مطالب

مقدمه.....	۹
فصل ۱. بررسی جایگاه بورس کالا در تأمین محصولات پتروشیمیایی.....	۱۱
۱-۱- فرایند عرضه بورسی.....	۱۳
۱-۱-۱- سهمیه خرید محصولات پتروشیمیایی.....	۱۴
۱-۱-۲- تالار پتروشیمی بورس کالا.....	۱۵
۱-۱-۳- تالار حراج باز.....	۱۶
۱-۱-۴- تالار فرعی.....	۱۸
۱-۱-۵- عرضه‌های مازاد.....	۱۸
۱-۱-۶- فرایند تسویه و پایاپای در بازار فیزیکی بورس کالا.....	۱۸
۲-۱- روش‌های معاملاتی.....	۲۱
۲-۱-۱- قرارداد نقدی.....	۲۲
۲-۲-۱- قرارداد سلف.....	۲۳
۲-۲-۳- قرارداد نسبه.....	۲۳
۲-۲-۴- قرارداد کشف پرمیوم.....	۲۳
۳-۱- ملاحظات قیمتی و نظارتی در عرضه محصولات پتروشیمیایی.....	۲۶
۱-۳-۱- قیمت پایه محصولات پتروشیمیایی.....	۲۶
۲-۳-۱- کف عرضه محصولات پتروشیمیایی.....	۲۷
۴-۱- بورس انرژی.....	۲۷
فصل ۲. ارزیابی و آسیب‌شناسی الگوی تأمین محصولات پتروشیمیایی از بستر بورس کالا.....	۳۰
۱-۲- رقابت غیرواقعی در بورس کالا.....	۳۰
۱-۱-۱- تقاضای فصلی.....	۳۳
۲-۱-۲- عدم تولید یا کاهش تولید پتروشیمی‌ها.....	۳۳
۳-۱-۲- انتظارات تورمی.....	۳۵
۴-۱-۲- تغییرات نرخ ارز.....	۳۶
۲-۲- نظام سهمیه‌بندی خرید محصولات پتروشیمیایی.....	۳۷
۳-۲- چندپارگی سامانه‌های فعال در زنجیره تأمین محصولات پتروشیمیایی.....	۳۹
۴-۲- خلأ آماری از میزان تولید صنایع پایین‌دستی و تأثیر آن بر بازار و سیاست‌گذاری.....	۴۰
۵-۲- فروش داخلی در بازارهای غیررسمی.....	۴۲

۴۲.....	۶-۲- قاجاق محصولات پتروشیمیایی
۴۵.....	۷-۲- تداخل مقررات بورس کالا با ملاحظات عرضه محصولات پتروشیمیایی
۴۶.....	۸-۲- کمبود کدهای تعرفه اختصاصی محصولات پتروشیمیایی
۵۷.....	فصل ۳. بازتعریف سازکار تأمین محصولات پتروشیمیایی در صنایع پایین‌دستی کشور
۵۷.....	۱-۳- بازنگری و پایش مستمر سهمیه‌های خرید
۵۹.....	۲-۳- سیاست‌گذاری و تنظیم‌گری در عرضه هدفمند محصولات پتروشیمیایی
۶۱.....	۳-۳- فعال‌سازی ظرفیت‌های مغفول بورس کالا
۶۱.....	۱-۳-۳- گواهی سپرده کالایی
۶۵.....	۲-۳-۳- صندوق‌های سرمایه‌گذاری قابل معامله
۶۷.....	۴-۳- بهبود سازکارهای عرضه بورسی
۶۸.....	۵-۳- اتصال سامانه‌های فعال در بخش عرضه محصولات به یکدیگر
۶۹.....	فصل ۴. نتیجه‌گیری و پیشنهادها
۷۵.....	منابع

فهرست جداول

۱۱.....	جدول ۱. سازکارهای تأمین محصولات پتروشیمیایی در صنایع پایین‌دستی
۲۵.....	جدول ۲. فروش داخلی محصولات گروه پلیمری و شیمیایی در بورس کالا به تفکیک نوع قرارداد طی سال ۱۴۰۳
۳۶.....	جدول ۳. برخی از محصولات پتروشیمیایی دارای قابلیت انبارش بالا
۳۸.....	جدول ۴. تعدادی از واحدهای فاقد اعتبار خریدار محصولات پتروشیمیایی از بورس کالا
۴۰.....	جدول ۵. تعدادی از سامانه‌های فعال در حوزه تأمین محصولات پتروشیمیایی
۴۴.....	جدول ۶. شرکت‌های واریزکننده وجه به حساب شرکت‌های خریدار از بورس کالا
۴۷.....	جدول ۷. کد تعرفه‌های محصولات پتروشیمیایی
۶۷.....	جدول ۸. کارمزدهای معاملات کالاهای غیرتنظیم بازار در بازار فیزیکی بورس کالای ایران

فهرست اشکال

۱۵.....	شکل ۱. فرایند حراج در بازار معاملات کالای فیزیکی
۱۷.....	شکل ۲. نمونه‌ای از تالار حراج باز چند محموله‌ای
۲۱.....	شکل ۳. فرایند عرضه بورسی محصولات پتروشیمیایی در بورس کالا
۲۲.....	شکل ۴. ساختار کلی بازارهای بورس کالا
۵۹.....	شکل ۵. فرایند تخصیص دو مرحله‌ای سهمیه خرید محصولات پتروشیمیایی

شکل ۶. ماتریس راهبردهای مواجهه با بازار محصولات پتروشیمیایی ۷۱

فهرست نمودارها

- نمودار ۱. میزان فروش محصولات پتروشیمیایی در بورس کالا و انرژی از سال ۱۳۹۰ تا ۱۴۰۲ ۱۳
- نمودار ۲. فروش داخلی محصولات پتروشیمیایی به تفکیک نوع قرارداد طی سال ۱۴۰۳ ۲۶
- نمودار ۳. محصولات دارای بیش‌ترین حجم معاملات در بورس انرژی طی ۶ ماه دوم سال ۱۴۰۳ ۲۹
- نمودار ۴. قیمت متوسط محصولات دارای بیش‌ترین حجم معامله در بورس انرژی طی ۶ ماه دوم سال ۱۴۰۳ ۲۹
- نمودار ۵. میانگین رقابت برخی محصولات پتروشیمیایی در بورس کالا طی سال ۱۴۰۳ ۳۱
- نمودار ۶. سهم عوامل عدم تولید صنعت پتروشیمی در سال ۱۴۰۲ ۳۴
- نمودار ۷. سهم هر یک از مسیرهای عرضه در حجم بازار محصولات پتروشیمیایی طی سال ۱۴۰۲ ۶۹
- نمودار ۸. ارزش فروش محصولات پتروشیمیایی در هر یک از مسیرهای عرضه طی سال ۱۴۰۲ ۷۰