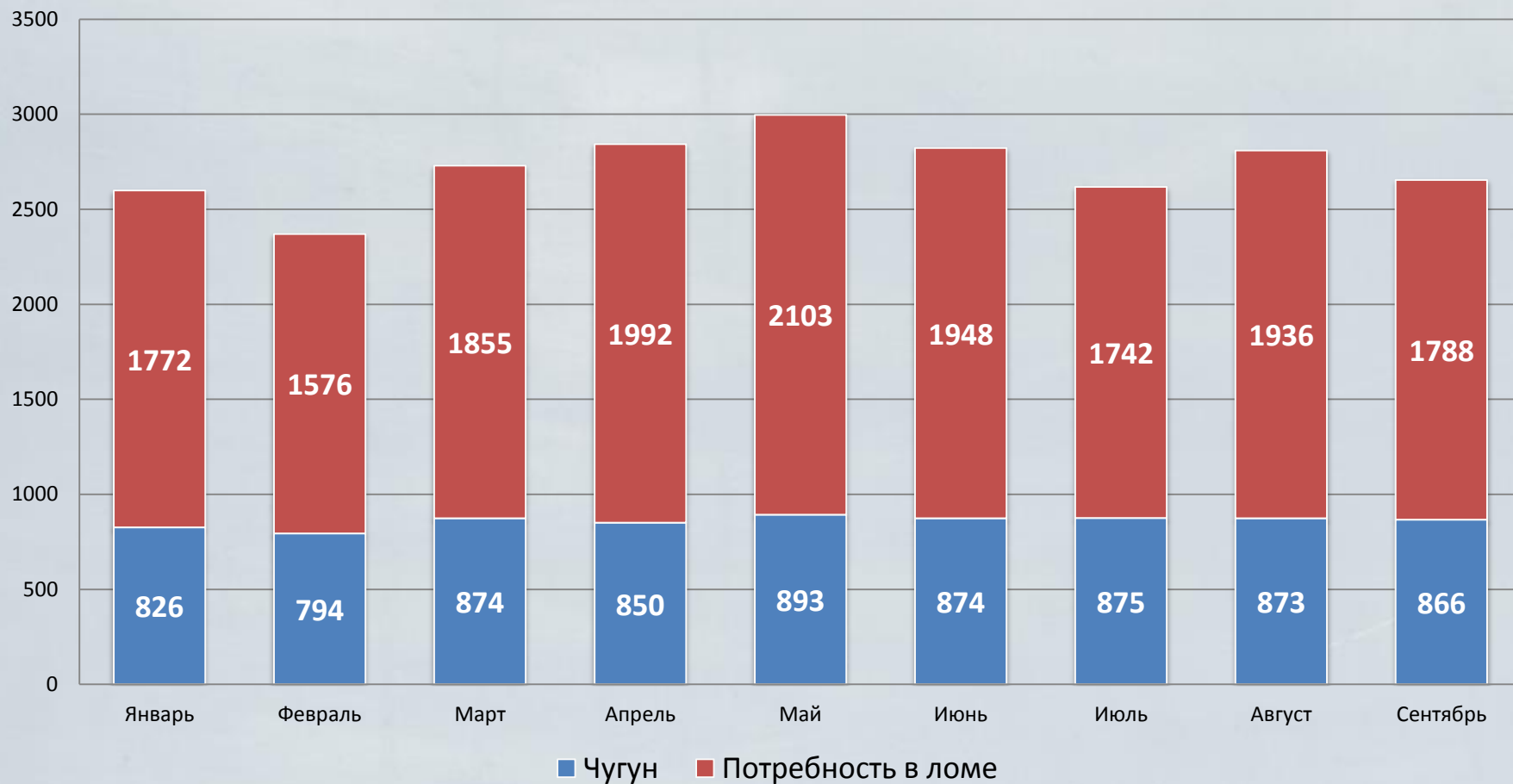


Опыт прогнозирования цен на лом в Турции

Секция «ВТОРМЕТ-2016»
XV Международной конференции
«Новые тенденции рационального использования
вторичных ресурсов и проблемы экологии»
9 ноября 2016 г.

Потребление лома заводами Турции за 9 мес. 2016 г.



Цены на лом CFR Турция, 9 мес. 2016 г.



Как спрогнозировать локальный пик цен?

Из двух предшествующих графиков видно, что пик цен соответствует пику производства – чем больше лома требуется, тем дороже завод готов за него платить.

Как узнать момент пика цен?

Мы используем 2 метода:

- «Народный прогноз» по теореме Кондорсе;
- Анализ поставок сырья водным транспортом;

Если вернуться к методикам прогнозирования, то стоит вспомнить чемпионат мира по футболу и осьминога Пауля, удачно предсказавшего результаты матчей с участием сборной Германии. В данном случае в роли «коллективного осьминога Пауля» выступили посетители сайта RuslomNews.

Согласно сформулированной в 1785 году маркизом де Кондорсе теореме о жюри присяжных, если вероятность правильного ответа каждого эксперта выше 50% и таких экспертов достаточно много — вероятность правильного ответа приближается к 100%.

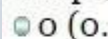
В результатах опроса как раз можно наблюдать реализацию теоремы Кондорсе на примере предсказания цен на рынке Турции: за счет профильной аудитории был обеспечен входной фильтр — каждый голосовавший был заинтересован в теме и по меньшей мере в ней разбирался или интересовался (первое условие) и их было относительно много (второе условие).

Как скоро упадет цена CIF Турция до 250:

в начале мая

 2 (11.8%)

в середине мая

 0 (0.0%)

в конце мая

 6 (35.3%)

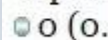
в июне

 3 (17.6%)

во второй половине года

 2 (11.8%)

через много лет

 0 (0.0%)

после решения правительства о запрете экспорта

 1 (5.9%)

да пошли бы вы .. с таким прогнозом: (

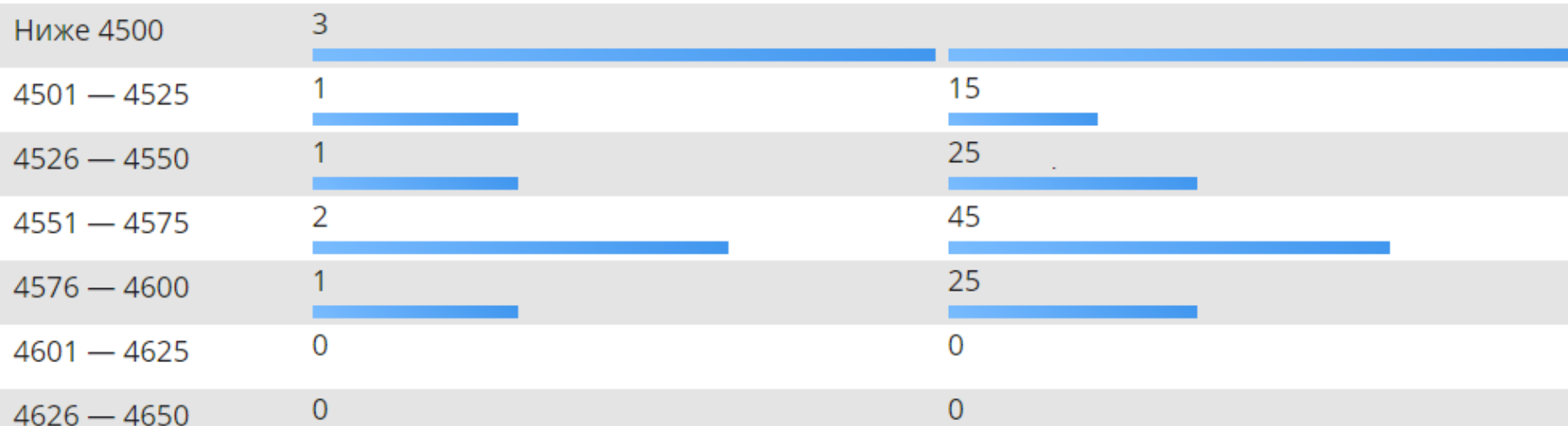
 3 (17.6%)

«Народный прогноз»

оказался точным – в конце
мая цена упала ниже 250!

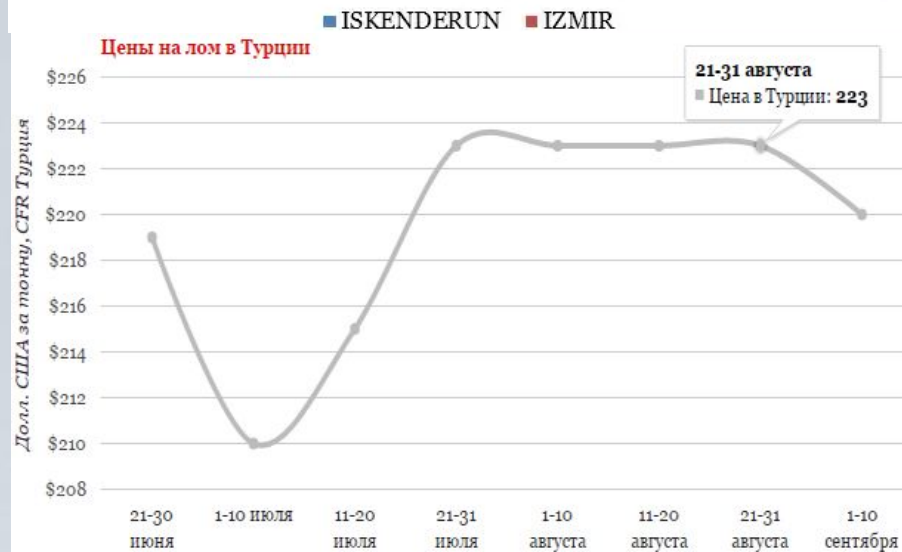
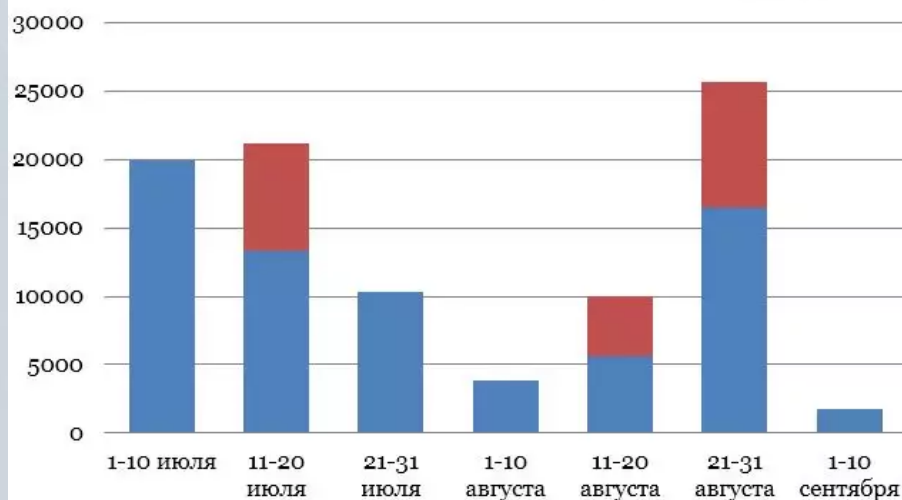
1-10 апреля	11-20 апреля	21-30 апреля	1-10 мая	11-20 мая	21-31 мая	1-10 июня	11-20 июня	21-30 июня
260	270	312	320	280	220	240	210	219

Может ли народный прогноз быть ошибочным?



Анализ данных по поставкам сырья водным транспортом. Модель «Ашдодский экспресс»

Поставки лома из порта Ашдод



В какие моменты росли объемы поставок лома из Ашдода?

Когда дефицит лома на заводах Измира и Искендеруна приводил к тому, что заводы были вынуждены повышать цены, в то же время они и закупали менее качественный, но «более быстрый» израильский лом: среднее время поставки лома в Искендерун порядка двух дней.

Прогноз на июль 2016 года от 22 июня

Заключение договоров экспортерами из СПб по 218 долл. США за лом вида HMS 1&2 80:20 и неясная ситуация с китайской заготовкой (надежда на рост пока неопределенная) дает ясный сигнал ростовскому рынку: 208 — 213 долл. США, в зависимости от большего или меньшего дефицита.

Таким образом, мы понимаем, что спрос на «короткие карго» особенно интересен, когда надо разбавить дорогой лом.

Ссылка: <http://infolom.ru/iyulskij-rynok-pojdet-na-210/>

Результат:

1-10 июня	11-20 июня	21-30 июня	1-10 июля	11-20 июля	21-31 июля
240	210	219	210	215	223

Задача формирования цены и спроса зависит от:
момента прихода «больших карго» и их цены,
динамики спроса на заготовку,
роста либо падения цен имеющихся запасов.

Рассмотрим как работает этот рынок:

18 мая был затаможен и 25 мая выпущен груз из Петролеспорта, 12500 тонн, и прибыл 18 июня на Ичдаш. В 1 декаде мая (когда подписывался контракт на эту поставку) цена в Турции была 320 долл. США CIF. Контрактная цена мелких карго составляет примерно 218 долларов CFR на 22 июня. Т.е. этот лом обходится примерно на 100 долл. США дороже мелких карго по текущей цене.

В 3 декаде мая из Ростова отплыл груз 4000 тонн тоже на завод Ичдаш. Во 2 декаде мая (момент подписания контракта) цена составляла 280 долл. США. Экономия на «коротких карго» составила от 40 до 100 долл. США. Таким образом, мы понимаем, что спрос на «короткие карго» особенно интересен, когда надо разбавить дорогой лом. По этой логике **ниже 210 падать смысла нет**, а при подъеме цен на заготовку даже отыграть свои 10 долларов.

Итоги прогнозов октября

Рекомендация клиентам Корпорации Исток 17 октября:

Дешевле 222 USD по паритету заключаться не стоит. До 20го и может даже до конца месяца внутренний рынок интереснее, потом конец навигации и может вырасти цена и на Турции — американцы держат прайс. Дело в том, что в Индию они отправляют по 235, при фрахте 13 от США до Индии и 15 — 17 до Турции грузится по 222 нет расчета, хотя бы по 237 USD за обычный HMS 1&2 80:20 было бы интересно.

Сделка: 2000 тонн 12300 CFR Ростов (при общем ростовском прайсе «для всех» 11500 на момент поставки баржи.

Наш клиент заработал дополнительно 1,4 млн. руб., окупив аналитику за несколько лет вперед!

Итоги прогноза

1-10 октября	11-20 октября	21-31 октября
210	222	235

Цена вопроса:

Договор R_2_INFOLOM_ISTOK_CORPORATION, 15 000 руб./мес.

Заменяет ЖД и БД по ВЭД, позволяет принимать экономически обоснованные решения по сделкам на рынке лома.

Остались вопросы?

Звоните +7 495 210 30 26

Пишите main@ruslom.biz

СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ!