

بررسی نقش و جایگاه بورس انرژی ایران در توسعه صنعت برق کشور

وبینار تخصصی : بررسی چشم انداز صنعت برق، فرصتها و تهدیدها، با نگاهی به ظرفیتهای بازار سرمایه

۱۴۰۰/۰۵/۱۰



بورس انرژی ایران در یک نگاه

۱۳۹۱/۰۴/۱۷	تاسیس
۱۳۹۱/۰۴/۲۷	ثبت نزد سازمان
۱۹ اسفند ۱۳۹۱	آغاز معاملات
۷۵	تعداد کارگزاران عضو
۹۸	تعداد ایستگاه های معاملاتی
۶۰۰ میلیارد ریال	سرمایه
۴۰۸	تعداد کالاها و اوراق پذیرفته شده
۷۱	تعداد شرکتهای عرضه کننده فرآورده های هیدروکربوری
۷۴	تعداد نیروگاه های عرضه کننده برق
۱۳۹۹/۰۳/۱۸	تاریخ درج در بازار دوم بورس تهران
www.irenex.ir	وب سایت

راهبردهای بورس انرژی ایران

- شناساندن بورس انرژی ایران به عنوان نهادی قانونمند به منظور ایجاد بازاری متشکل و توسعه‌مدار در حوزه انرژی داخل و خارج از کشور
- ایجاد بازاری شفاف، قانونمند و کارا (با نقدشوندگی و رقابت‌پذیری بالا) به منظور استفاده بهینه از منابع انرژی و دستیابی به قیمت‌های تعادلی حامل‌های انرژی
- تقویت فعالان حوزه انرژی از طریق فراهم نمودن امکان تامین مالی، مدیریت ریسک و هزینه عرضه‌کنندگان و مصرف‌کنندگان انرژی
- تلاش جهت فراهم آوردن امکان حضور سرمایه‌گذاران (فعالان) خارجی از طریق توسعه رینگ بین‌المللی معاملات بورس انرژی ایران و همچنین ارتقا سطح دسترسی عرضه‌کنندگان و خریداران داخلی به بازارهای بین‌المللی
- نوآوری در بهبود سازوکارهای معاملاتی همچنین مشارکت در طراحی ابزارهای مالی به منظور پاسخگویی به نیازهای مشتریان
- تشویق بکارگیری روش‌های بازار محور برای ایفای مسئولیت‌های اجتماعی در راستای حفاظت از محیط زیست از جمله استفاده از انرژی‌های تجدیدپذیر

برخی از مهم ترین اقدامات انجام شده از سوی بورس انرژی ایران برای توسعه بازار برق

- طراحی و توسعه سامانه های تمام الکترونیک پیش از معاملات، معاملات و پس از معاملات و تدوین مقررات و دستورالعمل های مورد نیاز
- تعامل با کلیه ذینفعان بازار برق
- پیگیری توسعه بازار برق از طریق حضور در مراجع قانونی و تدوین گزارش های کارشناسی در این خصوص
- طراحی، تصویب و عملیاتی نمودن ابزارهای نوین مالی از قبیل اوراق سلف موازی استاندارد، صندوق پروژه، اوراق گواهی ظرفیت نقدی و آتی، گواهی صرفه جویی انرژی نقدی و تأمین مالی
- پاسخگویی مناسب به نیازهای طیف گسترده فعالین بازار برق از طریق گشایش نمادهای با دوره تحویل ماهانه در بازار عمده فروشی و نمادهای با دوره تحویل روزانه و هفتگی در بازار سلف مصرف کنندگان بزرگ برق،
- طراحی نمادهای دوجانبه در تابلوی برق بازار فیزیکی به منظور انعقاد قراردادهای دوجانبه از طریق تابلوی بورس انرژی ایران
- توسعه توانمندی شرکت های کارگزاری عضو از طریق برگزاری دوره های آموزشی مستمر

انواع بازارهای با قابلیت معامله برق در بورس انرژی ایران

بازار فیزیکی

تابلوی برق

خریداران: مصرف کنندگان بزرگ برق بالای ۵ مگاوات و شرکت های خرده فروشی برق

فروشنندگان: نیروگاه های دارای قابلیت عرضه در بازار برق بورس انرژی ایران

بازار مشتقه

تابلوی قراردادهای سلف موازی استاندارد

بازار عمده
فروشی برق

بازار مصرف
کنندگان بزرگ
(خرده فروشی برق)

بازار قراردادهای
سلف موازی
استاندارد با سررسید
یکسال و بیشتر

فروشنندگان
: نیروگاه
های دارای
قابلیت
عرضه در
بازار برق
بورس
انرژی ایران

خریداران: مصرف
کنندگان بزرگ برق
بالای ۵ مگاوات و
شرکت های خرده
فروشی برق

ناشر: نیروگاه های
متقاضی تامین مالی
از طریق بورس انرژی

خریدار: عموم مردم

تابلوی صندوق
سرمایه گذاری
پروژه

بازار سایر اوراق بهادار قابل معامله

فروشنندگان: نیروگاه
های متقاضی تامین
مالی

خریداران: عموم
مردم

تابلوی اوراق گواهی ظرفیت

فروشنندگان: ظرفیت
نیروگاهی جدید،
متقاضیان کاهش
قدرت قراردادی

خریداران:
متقاضیان اتصال
به شبکه یا افزایش
قدرت قراردادی
بالای پنج مگاوات و
نیروگاه های مواجه با
افت ظرفیت

مشارکت کنندگان در بازار برق بورس انرژی ایران

خریداران بازار برق

۳۹ شرکت توزیع نیروی برق

۳۶ شرکت خرده فروشی
نیروی برق

مصرف کنندگان برق بالای ۵
مگاوات (۴۱۳ شرکت کد دریافت
نموده اند)

مشترکین جدید یا متقاضیان افزایش
قدرت قراردادی معرفی شده توسط
شرکت مدیریت شبکه برق ایران

عرضه کنندگان بازار برق

۳۸ نیروگاه خصوصی

۳۶ نیروگاه دولتی

ناشر اوراق گواهی
ظرفیت نقدی

جایگاه بازار برق بورس انرژی ایران در قوانین و مقررات بالادستی

ماده ۱۸ قانون توسعه ابزارها و نهادهای مالی جدید مصوب مجلس شورای اسلامی (۱۳۸۸/۰۹/۲۵):
دولت مکلف است کالاهای پذیرفته شده در بورس را از نظام قیمت‌گذاری خارج نماید.

قانون هدفمند کردن یارانه‌ها مصوب مورخ ۱۳۸۸/۱۰/۱۵ مجلس شورای اسلامی:
بند "ج" ماده ۱: دولت مکلف است با رعایت این قانون قیمت حاملهای انرژی را اصلاح کند:
میانگین قیمت فروش داخلی برق به گونه‌ای تعیین شود که به تدریج تا پایان برنامه پنج ساله پنجم توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی جمهوری اسلامی ایران معادل قیمت تمام شده آن باشد.

بند ۵ ماده ۷ دستورالعمل بند «و» ماده ۱۳۳ قانون برنامه پنج ساله پنجم توسعه:
پس از راه اندازی بورس انرژی ایران تامین انرژی برای مصارف سطح ولتاژ انتقال و فوق توزیع توسط شرکت های برق منطقه ای و همچنین تامین برق برای مصارف با قدرت بیش از پنج مگاوات توسط شرکت های توزیع نیروی برق به تدریج محدود خواهد شد به نحوی که تا پایان برنامه پنجم توسعه این قبیل مصرف کنندگان بایستی حداقل دو سوم از انرژی مورد نیاز خود را از نیروگاه های غیر دولتی، عرضه کننده ها و یا بورس تامین نمایند.

بند ۱۲ مصوبات هیات دولت در جلسه مورخ ۹۳/۰۵/۱۹:
قیمت‌گذاری کالاهایی که امکان پذیرش و خرید و فروش آنها در بورس انرژی یا کالا وجود دارد به جز کالاهای اساسی و انحصاری ممنوع است. دستگاه‌های اجرایی ظرف یکسال از تاریخ ابلاغ این تصویب‌نامه نسبت به پذیرش کالاهای مذکور در بورس مربوط اقدام نمایند.

تبصره ۱ ماده ۱۳ قانون خروج غیرتورمی از رکود (۹۴/۰۲/۰۱):

استفاده از سازوکارهای بورس انرژی در خرید و فروش نفت خام و میعانات گازی و فرآورده‌های نفتی و انرژی برق در اولویت قرار دارد.

مصوبه شماره ۱۴۵۹۳۷/ت/۵۰۹۹۹ مورخ ۹۴/۱۱/۱۰ هیئت محترم وزیران:

وزارت نیرو مکلف است شرایط را برای آن دسته از مشترکینی که قدرت قراردادی آنها بالای پنج مگاوات می باشد و مایلند تمام یا بخشی از انرژی برق مورد نیاز خود را از طریق نیروگاه های متعلق به خود یا بورس انرژی یا قراردادهای دوجانبه با نیروگاه ها تامین نمایند، فراهم آورد.

بند ب ماده ۴۴ قانون برنامه پنجساله ششم توسعه:

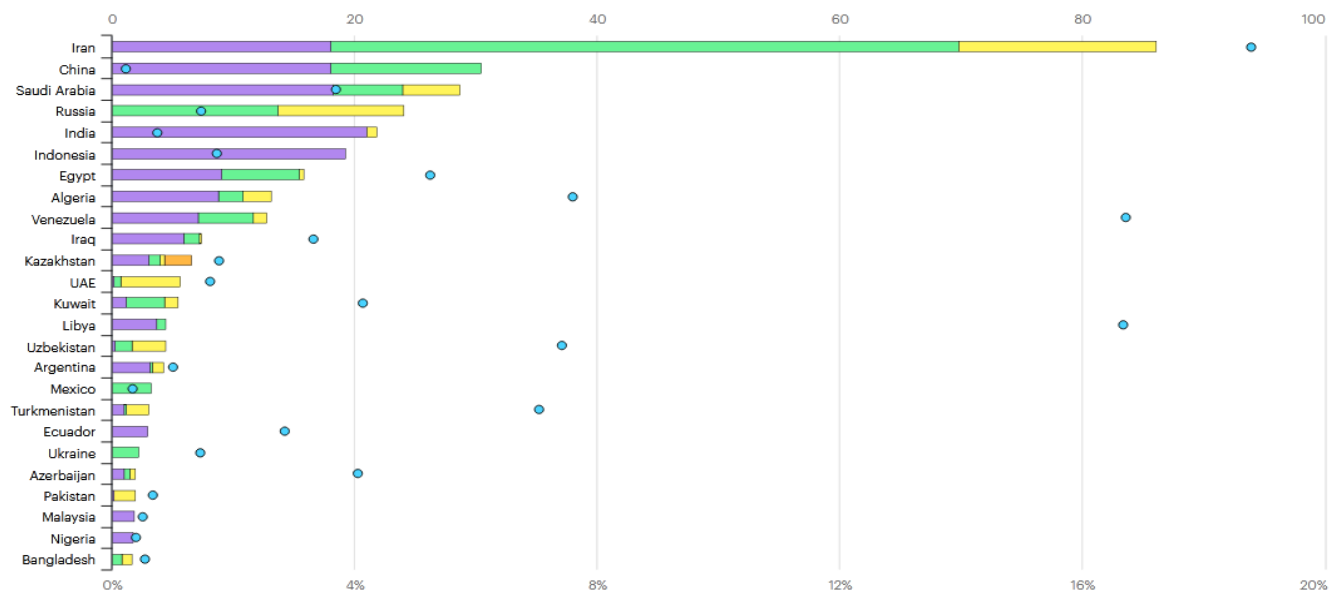
وزارت نیرو موظف است به منظور افزایش بازدهی و ضریب بهره وری نیروگاهها قیمت خرید برق را با توجه به سازوکار بازار در بورس تعیین نماید.

مصوبه شماره ۸۲۳۵۷/ت/۵۷۴۶۷ مورخ ۹۹/۰۷/۲۰ هیات محترم وزیران بویژه بند(۱) آن به شرح:

"کلیه مشترکین صنعتی برق با قدرت بالای ۵ مگاوات موظفند برق (انرژی الکتریکی) مورد نیاز را از طریق قرارداد های دو جانبه و یا سایر روش های متداول در بورس انرژی تامین نمایند."

در حال حاضر کشور ایران در رتبه بندی ارائه یارانه های انرژی جایگاه نخست را در اختیار دارد که لازم است با شکل گیری بازار های رقابتی در حوزه انرژی این موضوع مرتفع گردد.

سهم ایران از یارانه های انرژی در جهان



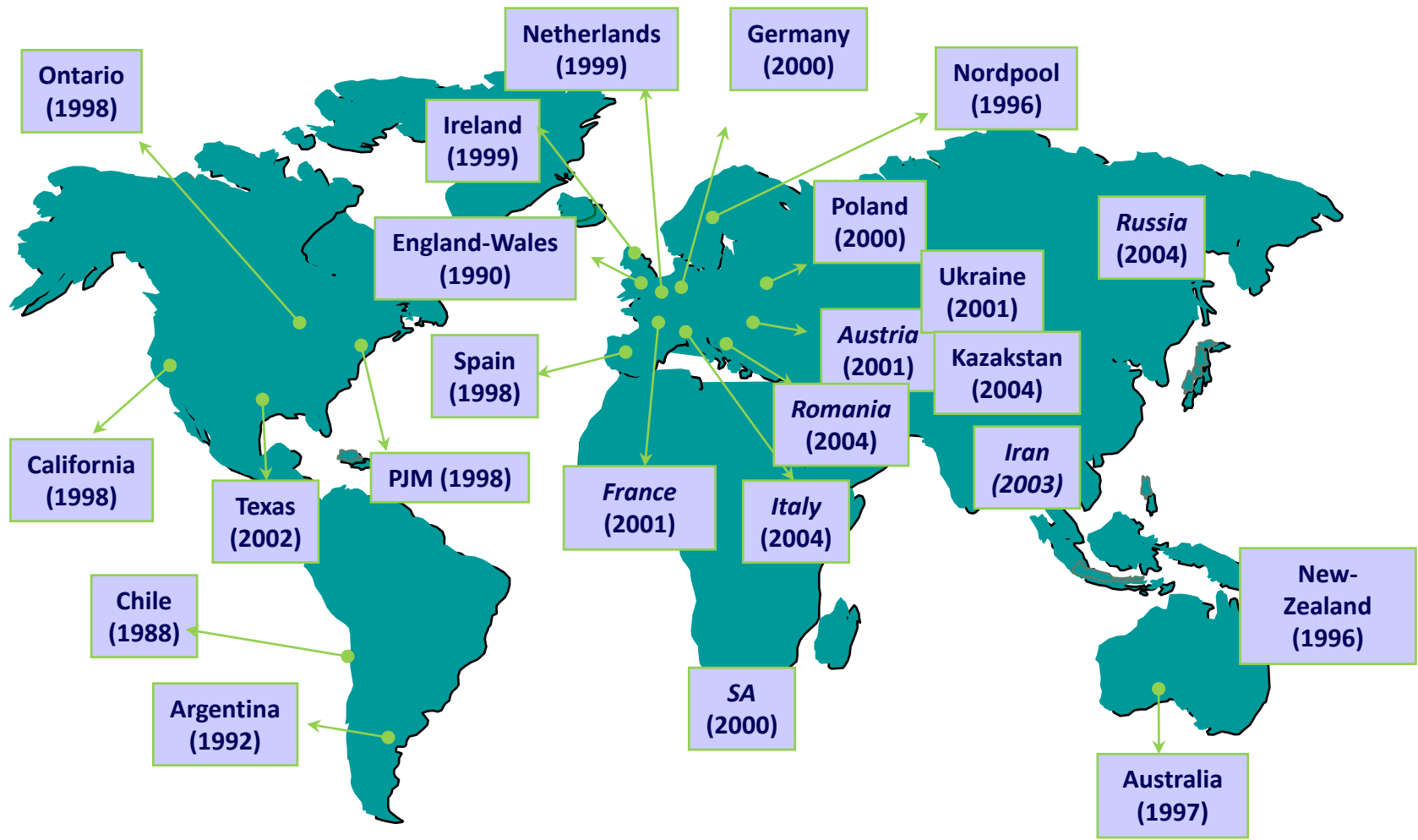
ایران در سال ۲۰۱۹ با سهم ۹۱.۴ میلیارد دلاری (بالغ بر ۱۸۰۰ هزار میلیارد تومان) از یارانه های انرژی جایگاه نخست را در این زمینه در جهان دارد و میزان این یارانه ها در هر بخش به شرح ذیل می باشد:

نفت: ۱۸ میلیارد دلار
 برق: ۵۷.۱ میلیارد دلار
 گاز: ۱۶.۳ میلیارد دلار

IEA. All Rights Reserved

● Total subsidies as % of GDP (MER) ● Oil ● Electricity ● Gas ● Coal

برخی از بازارهای برق ایجاد شده در دنیا



برخی از بورسهای برق مطرح دنیا

نام بورس برق	کشور	آدرس اینترنتی
APX NL	هلند	www.apxgroup.com
Belpex	بلژیک	www.belpex.be
European Energy Exchange (EEX)	آلمان	www.eex.de
EXAA	اتریش	www.exaa.at
Gestore del mercato elettrico (GME)	ایتالیا	www.mercatoelettrico.org/GmeWebInglese/Default.aspx
Nord Pool	نروژ	www.nordpool.com
Operador del Mercado Ibérico de Energía (OMEL)	اسپانیا	www.omel.es
Powernext	فرانسه	www.powernext.fr
UKPX , APX UK, UK IPE	انگلستان	www.apxgroup.com

آمار معاملات برق در بازارهای بورس انرژی ایران از ابتدا تا کنون

سهم از بازار درصد	مجموع معاملات برق در بورس انرژی ایران		سال
	مجموع معاملات برق کشور معادل کیلووات ساعت	ارزش (میلیارد ریال)	
۱/۱۳٪	۲۵۰,۷۷۹,۰۸۲,۰۰۰	۹۸۶	۱۳۹۲
۲/۶۹٪	۲۶۷,۳۳۱,۶۴۴,۰۰۰	۲,۹۸۳	۱۳۹۳
۶/۸۰٪	۲۷۶,۷۰۹,۷۹۳,۰۰۰	۷,۳۴۴	۱۳۹۴
۴/۴۰٪	۲۷۸,۷۷۷,۵۷۳,۰۰۰	۴,۱۵۸	۱۳۹۵
۴/۲۲٪	۲۹۷,۱۵۵,۸۶۹,۰۰۰	۴,۱۱۹	۱۳۹۶
۱/۲۸٪	۲۹۹,۸۵۵,۶۶۱,۰۰۰	۱,۳۲۹	۱۳۹۷
۱/۹۳٪	۳۰۷,۶۷۱,۲۱۷,۰۰۰	۲,۲۹۵	۱۳۹۸
۲/۸۴٪	۳۱۹,۹۲۱,۶۲۷,۰۰۰	۴,۶۸۸	۱۳۹۹
۳/۱۵٪	۲,۲۹۸,۲۰۲,۴۶۶,۰۰۰	۲۷,۹۰۲	جمع

آمار معاملات برق در بازارهای بورس انرژی ایران در سال ۱۴۰۰ (تا تاریخ ۰۶/۰۵/۱۴۰۰)

درصد تغییرات حجم به دوره مشابه سال ۹۹	درصد تغییرات ارزش نسبت به دوره مشابه سال ۹۹	دوره مشابه سال ۹۹		از ابتدای سال ۱۴۰۰ تا کنون		نام بازار
		ارزش معاملات (ریال)	حجم معاملات (کیلووات ساعت)	ارزش معاملات (ریال)	حجم معاملات (کیلووات ساعت)	
۳۷۳	۴۸۸	۴۴,۸۹۸,۸۱۶,۰۰۰	۸۷,۳۹۱,۲۰۰	۲۶۴,۱۳۳,۷۷۰,۸۰۰	۴۱۳,۱۱۵,۱۴۰	بازار عمده فروشی
۴۷	۷۵	۱,۳۱۰,۷۸۳,۲۳۴,۱۰۰	۲,۶۹۲,۷۶۹,۸۵۰	۲,۲۹۴,۴۱۰,۹۷۸,۱۰۰	۳,۹۷۰,۳۸۲,۳۸۰	بازار مصرف کنندگان بزرگ (بازار فیزیکی و سلف)
۵۸	۸۸/۷	۱,۳۵۵,۶۸۲,۰۵۰,۱۰۰	۲,۷۸۰,۱۶۱,۰۵۰	۲,۵۵۸,۵۴۴,۷۴۸,۹۰۰	۴,۳۸۳,۴۹۷,۵۲۰	جمع معاملات برق

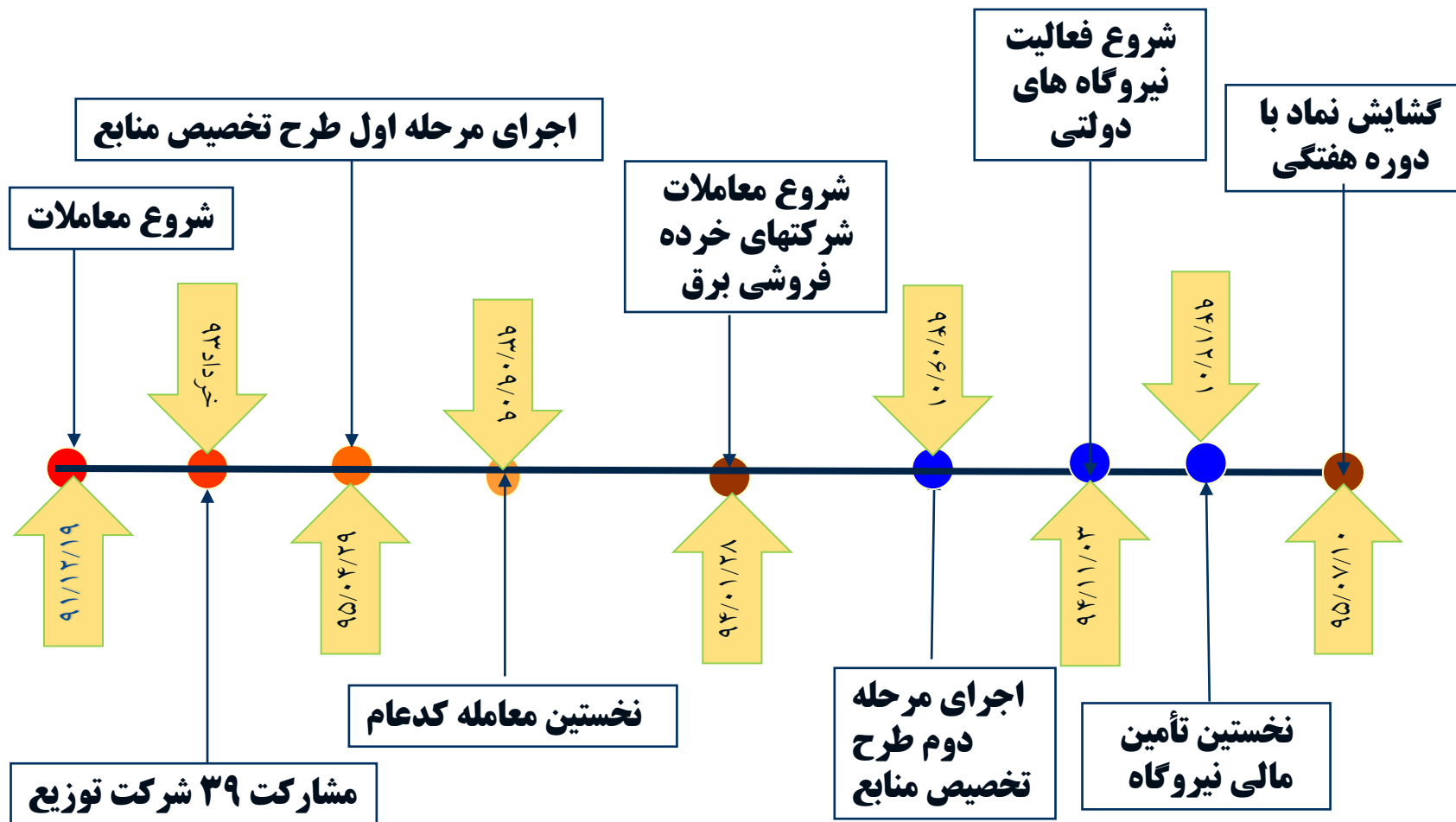
آمار معاملات شرکت های توزیع نیروی برق در بورس انرژی ایران از ابتدا تا کنون

سال	ارزش میلیارد ریال	سهم از کل
۱۳۹۲	۹۸۶	۵٪
۱۳۹۳	۲,۹۸۱	۱۵٪
۱۳۹۴	۷,۳۱۸	۳۸٪
۱۳۹۵	۴,۱۵۵	۲۱٪
۱۳۹۶	۳,۷۷۵	۱۹٪
۱۳۹۷	۲۴۰	۱٪
۱۳۹۸	۲۰	۰٪
۱۳۹۹	۱۳	۰٪
۱۴۰۰ (تا پایان تیر)	۰/۵	۰٪
جمع	۱۹,۴۸۸	۱۰۰٪

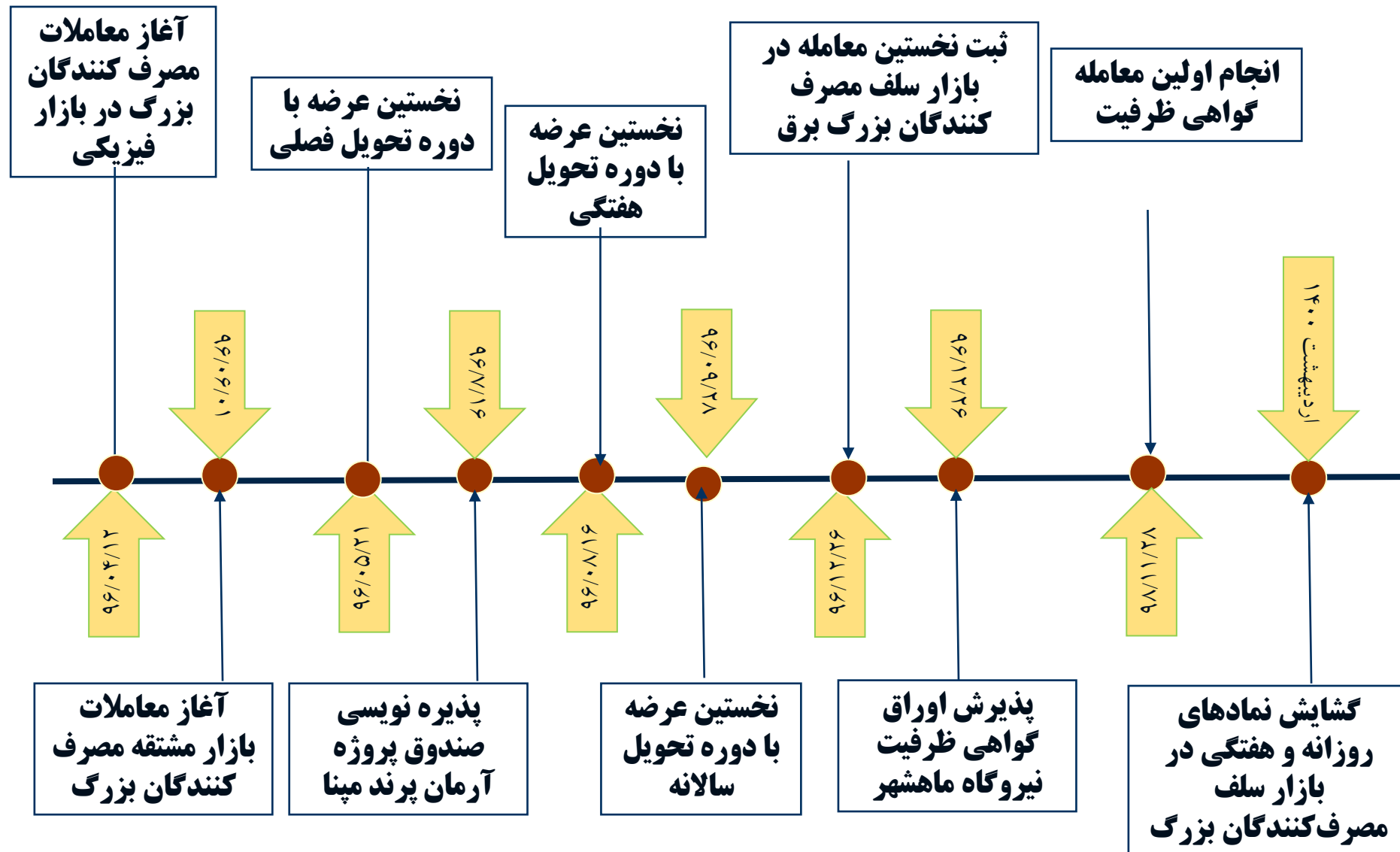
عدم تزریق منابع جهت خرید شرکت های توزیع نیروی برق:

علیرغم مکاتبات متعدد و پیگیری های فراوان، تاریخ آخرین اعتبار تخصیصی در این خصوص مربوط به ۹۷/۱۰/۱۸ بوده است.

اهم رویدادهای بازار برق بورس انرژی ایران از آغاز معاملات تاکنون



اهم رویدادهای بازار برق بورس انرژی ایران از آغاز معاملات تا کنون



آمار تأمین مالی از طریق ابزارهای نوین مالی در بورس انرژی ایران از ابتدا تا کنون

ارقام به میلیارد ریال

صندوق پروژه		اوراق سلف موازی استاندارد با سررسید یکسال و بیشتر		
بخش دولتی	بخش خصوصی	بخش دولتی	بخش خصوصی	
			۲۰۰	۱۳۹۴
			۳,۲۰۰	۱۳۹۵
	۱,۰۱۰		۴,۴۱۷	۱۳۹۶
			۱,۳۵۰	۱۳۹۷
			۵۰۰	۱۳۹۸
		۲۸,۵۷۹	۵۰۰	۱۳۹۹
	۱,۰۱۰	۲۸,۵۷۹	۱۰,۱۶۷	مجموع

چالش ها و موانع توسعه بازار برق در بورس انرژی ایران

عوامل خارجی تاثیرگذار بر توسعه بازار برق در بورس

- ساختار دولتی و بعضاً انحصاری حاکم بر نهادهای فعال در حوزه انرژی کشور (پررنگ بودن نقش دولت در تعیین قیمت حاملهای انرژی و انجام مبادلات آن)،
- مقاومت در مقابل سازوکار نظاممند بورس،
- مقاومت در اجرای مقررات بالادستی
- طولانی بودن فرایند تدوین و تصویب مقررات در وزارت نیرو
- پیچیدگی‌های ذاتی موجود در ارتباط با کالای برق
- وجود پیچیدگی در برخی قوانین و مقررات مربوط به حساب دستگاه‌های دولتی با خزانه‌داری کل کشور، سازمان امور مالیاتی و ... ،
- عدم شناخت کافی بخش‌های مختلف فعال در حوزه انرژی با ظرفیت‌ها و پتانسیل‌های بورس انرژی ایران و بازار سرمایه کشور جهت تأمین مالی، پوشش ریسک، شفاف نمودن هزینه‌ها و
- عدم عرضه برق تجدید پذیرها جهت استفاده ماینرها
- عدم صادرات برق در مکانیزم شفاف بورس انرژی
- محاسبه حق بهره برداری و حق ترانزیت طبق فرموله های یکسویه

راهکارهای پیشنهادی جهت توسعه بازار برق بورس انرژی ایران

1. اجرای قوانین و مقررات بالادستی طبق نص صریح قوانین و عدم تفسیر به رای آنها
2. خروج مصرف کنندگان بالای یک مگاوات از نظام قیمت گذاری دستوری و الزام این دسته از مشترکین به تأمین برق از طریق ابزارهای بورس انرژی ایران
3. ارائه سازوکاری به منظور شفافیت و فرموله کردن کلیه پارامترهای اثرگذار بر قیمت برق نظیر حق ترانزیت و حق بهره برداری با مشارکت ذینفعان
4. ارائه زمان بندی منظم جهت تزریق نقدینگی به شرکت های توزیع نیروی برق به منظور خرید برق از طریق بورس انرژی ایران و تعهد به انجام آن
5. جلوگیری از انعقاد قراردادهای دوجانبه خارج از بورس در اجرای مصوبه شماره ۸۲۳۵۷/ت/۵۷۴۶۷ هـ مورخ ۹۹/۰۷/۲۰ هیات محترم وزیران

راهکارهای پیشنهادی جهت توسعه بازار برق بورس انرژی ایران

6. توسعه بازار گواهی ظرفیت وفق مقررات

7. حضور نیروگاه‌های تولید پراکنده و نیروگاه‌های تجدیدپذیر در بورس انرژی ایران و شکل‌گیری بازار محلی برای این تولیدکنندگان

8. اجازه صادرات به نیروگاه‌های بخش خصوصی از طریق رینگ صادراتی بورس انرژی مشروط به تامین خوراک از مکانیزم بورس و با قیمت رقابتی

9. ارائه تضامین لازم و معتبر برای امکان معاملات غیرنقد از طریق مکانیزم بورس

با تشکر

PRAN
KUN
BOHER
AGRA