

Методы прогноза цен на алюминий

У Международный форум
«Уральский рынок лома, промышленных и коммунальных
отходов»
(«ЛОМ-ТЕХНОГЕН-ПОЛИГОН-2017»)
КОНГРЕССА «ТЕХНОГЕН-2017»,
Екатеринбург, 6-9 июня 2017 г.

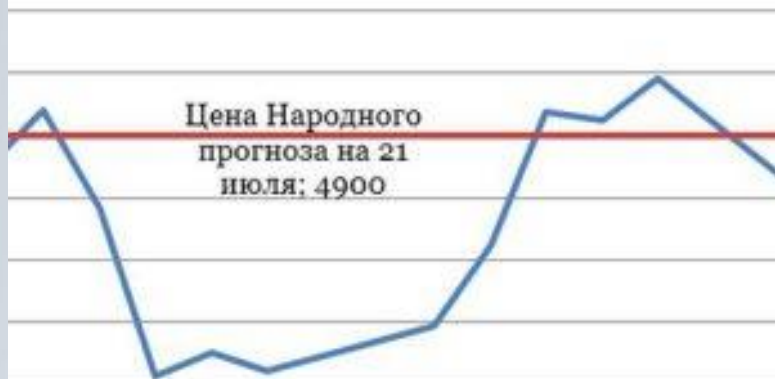
2 метода прогнозирования:

1. Использование теоремы Кондорсе (экспертный)
2. Анализ потоков физического металла (статистический)

Прогноз рынков меди:
Опыт применения теоремы Кондорсе:

Прогноз цен на медь на 21 июля. Пик ставок пришелся на уровень цены 4900 долл. США за тонну, и если бы подведение итогов было по 20 июля, это стало бы 100% «попаданием в яблочко». В то же время точность прогноза по сравнению с колебаниями цен представляется достаточно высокой, большая часть экспертов и ставок уверенно предсказала тренд на повышение.

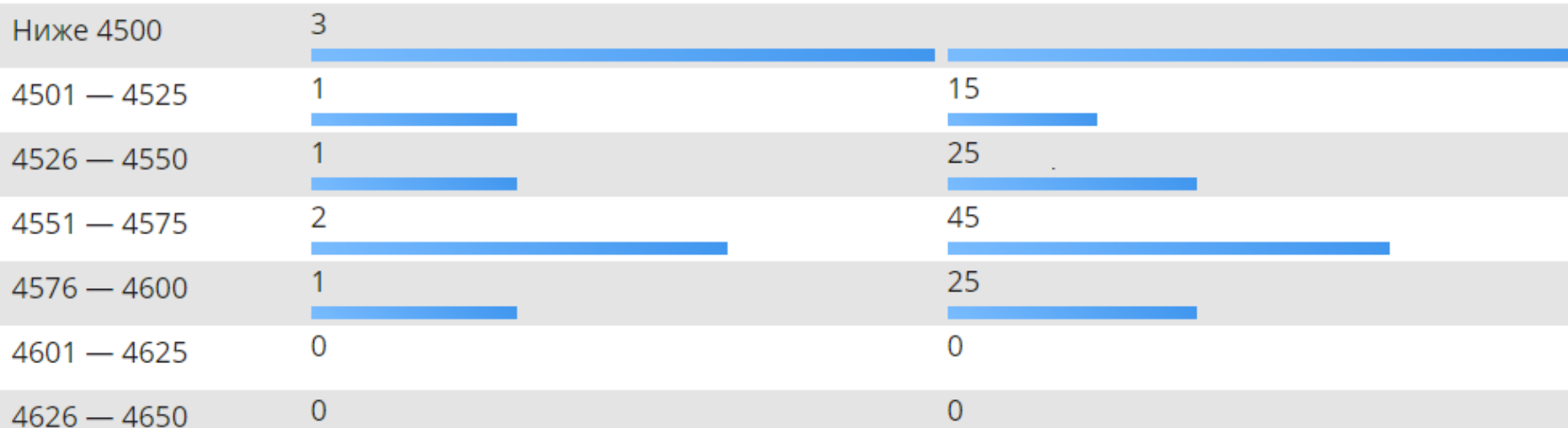
Прогноз цен на медь Grade A USD/тонна



Статистика ставок

4870 - 4879 долларов	1	16
4880 - 4889 долларов	5	109
4890 - 4899 долларов	2	67
4900 - 4909 долларов	6	156
4910 - 4919 долларов	1	34
4920 - 4929 долларов	1	50
4930 - 4939 долларов	1	17
4940 - 4949 долларов	1	10

Всегда ли работает теорема Кондорсе?



Как реализовать прогноз по Кондорсе на российском рынке?

1. Создать пул экспертов на основе подписчиков отчета ИНФОЛОМ-БАЗОВЫЙ (13500 р/квартал). Корпорация Исток как организатор за счет этого обеспечивает техническую и методологическую основу проведения прогноза по Кондорсе
2. Проводить опрос с определенной периодичностью в он-лайн и с использованием видеоконференций
3. При наличии 20+ количества компетентных экспертов (трейдеры и кабельные заводы) мы получим достаточно точный результат
4. При повторяющемся точном результате наши коллеги в Канаде подключают иностранных трейдеров – в отличие от США, в Канаде нет регулирования «рынка предсказаний»
5. При международной базе 100+ экспертов по рынкам меди/алюминия прогноз может работать достаточно точно – проверено на рынке черного лома!

Статистический метод для рынка алюминия.

Основа на измерении статистики перевозок бокситов по отдельным направлениям.

Порт А – контролируется поставщиками сырья. Чем дороже сырье – тем выгоднее для бенефициаров.

Порт Б – основной интересант это потребитель алюминия. Чем дешевле сырье, тем для него выгоднее.

Статистика порта А

	Декады	K1	K2	Цена	Изменение цены	Изменение K2
Июль	21-31 июля	3 283	2 836	1645		
Август	1-10 августа	3 247	2 869	1645	0	
	11-20 августа	1 575	1 939	1648	3	
	21-31 августа	3 377	2 949	1600	-48	32
Сентябрь	1-10 сентября	3 817	2 486	1566	-34	-930
	11-20 сентября	5 003	5 966	1562	-4	1 010
	21-30 сентября	2 603	1 720	1568	6	-463
Октябрь	1-10 октября	4 163	3 753	1677	109	3 480
	11-20 октября	2 811	3 249	1612	-65	-4 246
	21-31 октября	3 366	2 936	1722	110	2 033

Правило 2х недель

Статистика порта Б

	Декады	K1	K2	Цена	Изменение цены	Изменение K2
Июль	21-31 июля	192,102	192,11	1645		
Август	1-10 августа	151,429	151,417	1645	0	
	11-20 августа	326,568	235,091	1648	3	
	21-31 августа	350,377	350,377	1600	-48	-40,693
Сентябрь	1-10 сентября	304,342	203,108	1566	-34	83,674
	11-20 сентября	226,275	185,403	1562	-4	115,286
	21-30 сентября	287,065	254,289	1568	6	-147,269
Октябрь	1-10 октября	99,418	92,637	1677	109	-17,705
	11-20 октября	208,697	115,863	1612	-65	68,886
	21-31 октября	299,536	206,279	1722	110	-161,652

Выводы:

1. Рынком манипулируют и продавцы и покупатели
2. Физический рынок и финансовый рынок взаимосвязаны
3. Корреляция поддается вычислению

Исследовательская программа, охватывающая все порты перевозки бокситов, потребует:

12 месяцев

40000 долл. США

Результаты:

100% отслеживание рынка бокситов в ежесуточном режиме
Выявление корреляций для прогнозирования движения цен на алюминий, запасов в Китае, курса акций алюминиевых компаний.
Результаты будут принадлежать заказчику и сделка оформлена согласно законодательству Канады

СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ!