

Можно ли прогнозировать рынок ?

Александр Поляк

Молинформ

Член Совета РСПМО

Для чего нужен прогноз рынка ?

- В молочной промышленности сырьевая составляющая 65-75% от себестоимости
- Средняя рентабельность молочного производства 8-15%
- Сезонные колебания цены на сырое молоко 15-20%, на сырьевые составляющие (СОМ + масло) - 20-30% !
- Цена ошибки в закупках сырья – вся рентабельность ! Или потеря конкурентоспособности ...

Философия рынка - вопросы

- Что такое рынок молочного сырья в России вообще ?))
- От чего зависит изменение цены на рынке ?
- Как формируется баланс рынка (спрос , предложение, потребление, покупательная способность) ?
- Является ли изменение цены результатом объективных процессов или субъективных действий\решений участников рынка ?

Философия рынка – граничные условия для моделирования

- Рынок условно замкнут (импорт цельномолочки практически отсутствует)
- Закон «сообщающихся сосудов» по сырью подвержен влиянию эмбарго
- Потребление не растет скачками.
- Объем потребляемого сырья при небольших колебаниях цен стабилен, при больших -падает
- Рынок сырого молока и рынок сырья (СОМ +масло) связаны «коридором цен».

Методы прогнозирования рынка

- Экспертная оценка
- Аналитика
- Программы анализа рынка по заданному алгоритму
- Прогнозирование рынка с применением глубокого машинного обучения и нейросетей (обучение машины учебе ...)

Прогноз- Аналитика

Исходные условия 1

1. Объем **производства** сырья с 2014 по 2017 гг вырос на 10,6 % или на (+ **1,85 млн тн**) . Спасибо эмбарго.
2. **Потребление** молочки в объеме с 2015 года упало на ~10-12% или (- **2,4 млн тн**)
3. Количество **фальсификата** с 2015 года выросло на ~ 45-50% или до **3 млн тн**
4. Цена в РФ сырья (стандарт) спот ~ 21,5 руб (без НДС)
5. Цена сырья экстра ~ 23,5 руб (без НДС)
6. Цена СОМа в мире ~ 2000 usd (190 тыс руб)

Прогноз-Аналитика

Исходные условия 2

- Политические риски в мире
- Курс рубля вырос на 10% - импорт СОМа подорожал до 190 руб
- Цена на полке на молоко начал медленно снижаться (впервые за 20 лет и за счет акций)
- Самое проблемное – корректность статистических данных !

Варианты развития событий

Жесткое регулирование рынка.

Сухое молоко закрыто

- Цены на сырое молоко в РФ ~ 23-24 руб (5 млн тн импорт !)
- Повезут импорт
- РБ увеличит производство творога и сыров
- Растут склады сом в РБ до 25 тыс тн (экспорт- 1700 usd)
- Увеличение доли сыров РБ на полке (+ 30-40 тыс.тн)

Мягкое регулирование рынка.

Серый импорт, транзит

- Казахстан-транзит
- Цены на сырье ~ 21-22 руб
- Импорт минимален
- Рынок в балансе-
Цена СОМа ~ 130-140 руб
Масло 82 ~ 300 руб (весна),
320-360 лето, 380 + зима

«Запрет» на поставки из РБ

EXPORT BELARUS: Main 10 purchasers of SMP in year 2017 (Tons)

Country	Annual					Jan-Jun		
	2013	2014	2015	2016	2017	2017	2018	± % su 2017 *
Russia	92.125	87.106	114.504	105.540	86.557	45.760	23.838	-47,91%
Kazakhstan	3.411	5.301	6.247	3.971	9.691	3.808	13.101	+244%
Kyrgyzstan	-	-	14	200	7.306	2.379	3.052	+28,26%
Ukraine	20	0	332	1.000	1.970	879	993	+13,00%
Armenia	60	-	123	119	978	359	764	+113%
Georgia	-	-	20	250	973	733	220	-70,04%
Azerbaijan	40	-	140	100	745	390	139	-64,41%
Mongolia	0	-	-	-	439	69	45	-33,94%
Turkmenistan	4	6	-	65	269	175	50	-71,43%
Syria	-	-	25	-	246	246	140	-43,09%

Source: Processed by Cia based on IHS data

* Change from the same period of previous year.

«Запрет» на поставки из РБ

EXPORT BELARUS: Main 10 purchasers of Butter in year 2017 (Tons)

Country	Annual					Jan-Jun		
	2013	2014	2015	2016	2017	2017	2018	± % su 2017 *
Russia	61.059	66.282	85.752	82.156	69.181	39.159	24.718	-36,88%
Kyrgyzstan	-	-	-	20	3.867	1.567	2.160	+37,84%
Kazakhstan	2.835	2.125	1.558	1.153	2.385	719	10.719	-
Turkey	0	-	-	-	2.333	1.231	2.639	+114%
Ukraine	1.592	177	96	740	627	253	545	+115%
Azerbaijan	327	322	273	420	556	169	728	+331%
Georgia	85	-	-	144	540	308	707	+129%
Syria	-	-	28	-	168	168	81	-51,79%
Armenia	84	7	27	104	152	41	219	+430%
Mongolia	-	-	-	-	59	-	100	-

Source: Processed by CIal based on IHS data
 * Change from the same period of previous year.

Импорт «упал»?

IMPORT RUSSIA : Main 10 suppliers of SMP in year 2017 (Tons)								
Country	Annual					Jan-May		
	2013	2014	2015	2016	2017	2017	2018	± % su 2017 *
Belarus	72.545	78.996	106.559	112.529	103.673	39.736	29.268	-26,34%
Turkey	-	-	-	9.266	9.287	6.859	-	-100,00%
Iran	-	-	-	381	3.400	1.780	503	-71,77%
Switzerland	705	1.707	1.459	4.836	3.388	1.455	1.069	-26,54%
Argentina	8.313	2.692	1.658	6.403	2.393	277	236	-14,85%
New Zealand	-	0	1.713	322	2.302	563	929	+65,07%
Uruguay	4.050	2.325	948	975	953	300	175	-41,67%
Kyrgyzstan	-	-	-	289	428	101	598	+493%
Kazakhstan	-	59	258	90	63	33	2	-93,47%
Moldova	20	100	-	785	20	20	-	-100,00%

Source: Processed by CIAl based on IHS data
 * Change from the same period of previous year.

Влияние информации о закрытии РБ на цены

Источник Dairy Trader

В мае и феврале цены на СОМ росли без объективных причин



Цена на сырое молоко выросла только на информации



Ключевые долговременные факторы влияющие на рынок

- Льготное кредитование отрасли (2-4% годовых)
- Рынок не консолидирован - доля мультинациональных компании ~ 20% (крупнейшие компании просели за два года на ~18-20% в физическом объеме)
- Передел рынка – как по компаниям, так и по структуре
- Через 1,5-2 года в РФ прекратится рост объемов производства сырья
- Возможная приватизация в РБ..?

Прогнозирование рынка с
применением *глубокого*
машинного обучения и
нейросетей

Программа анализа и прогноза рынка для телефона\планшета **Dairy Trader**

почему разорван × Все молоко в одн × Dairy Trader × +

www.dairytrader.ru Dairy Trader

DAIRY TRADER

Молочный рынок в одном приложении

В этом приложении вы найдёте все, что нужно трейдеру, аналитику, менеджеру, бизнесмену, работающему на рынке молочной продукции.

Установить Android

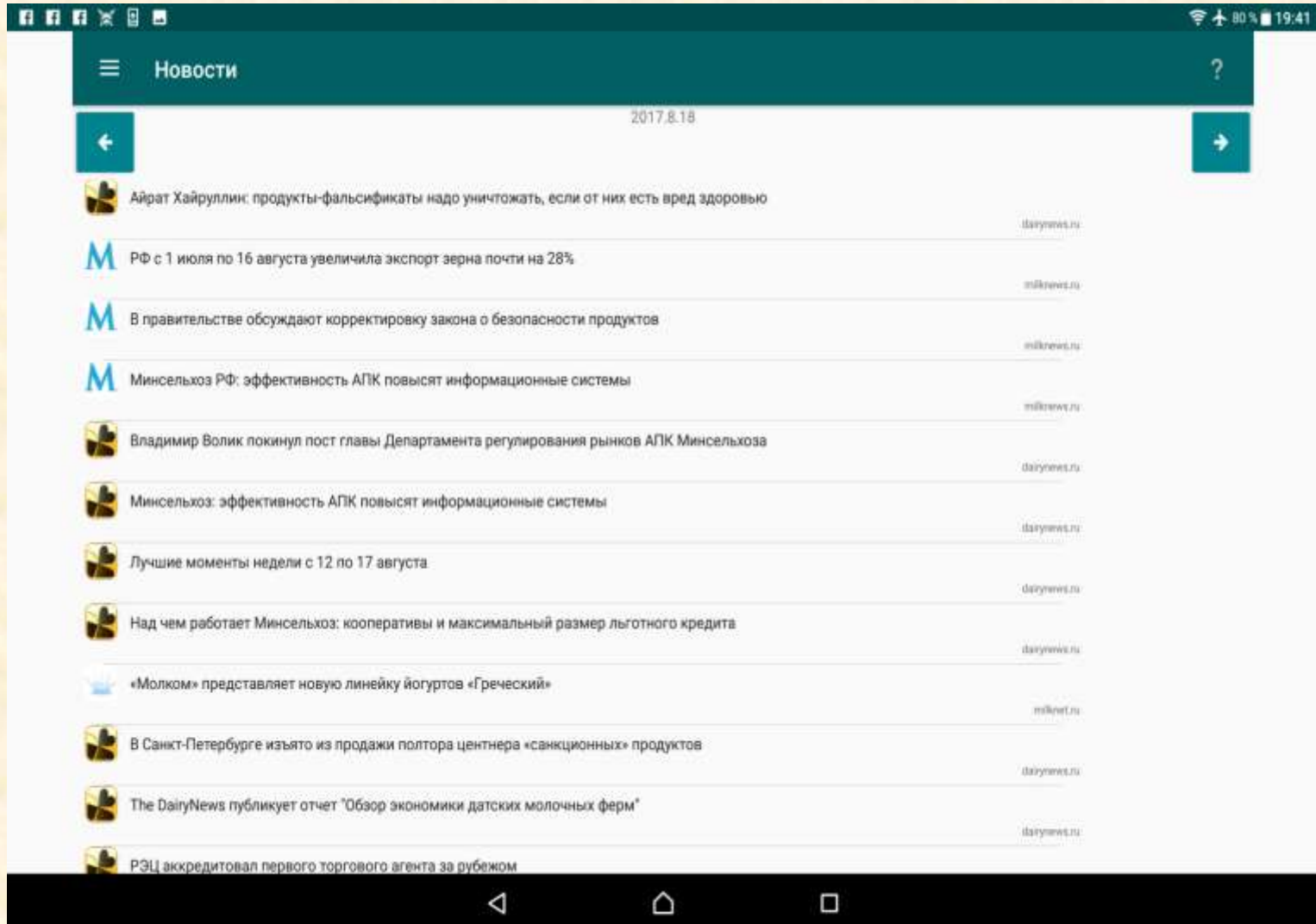
Установить iOS

- Таблица цен и график
- Новости
- Цены
- Общие
- Подписка
- Поддержка

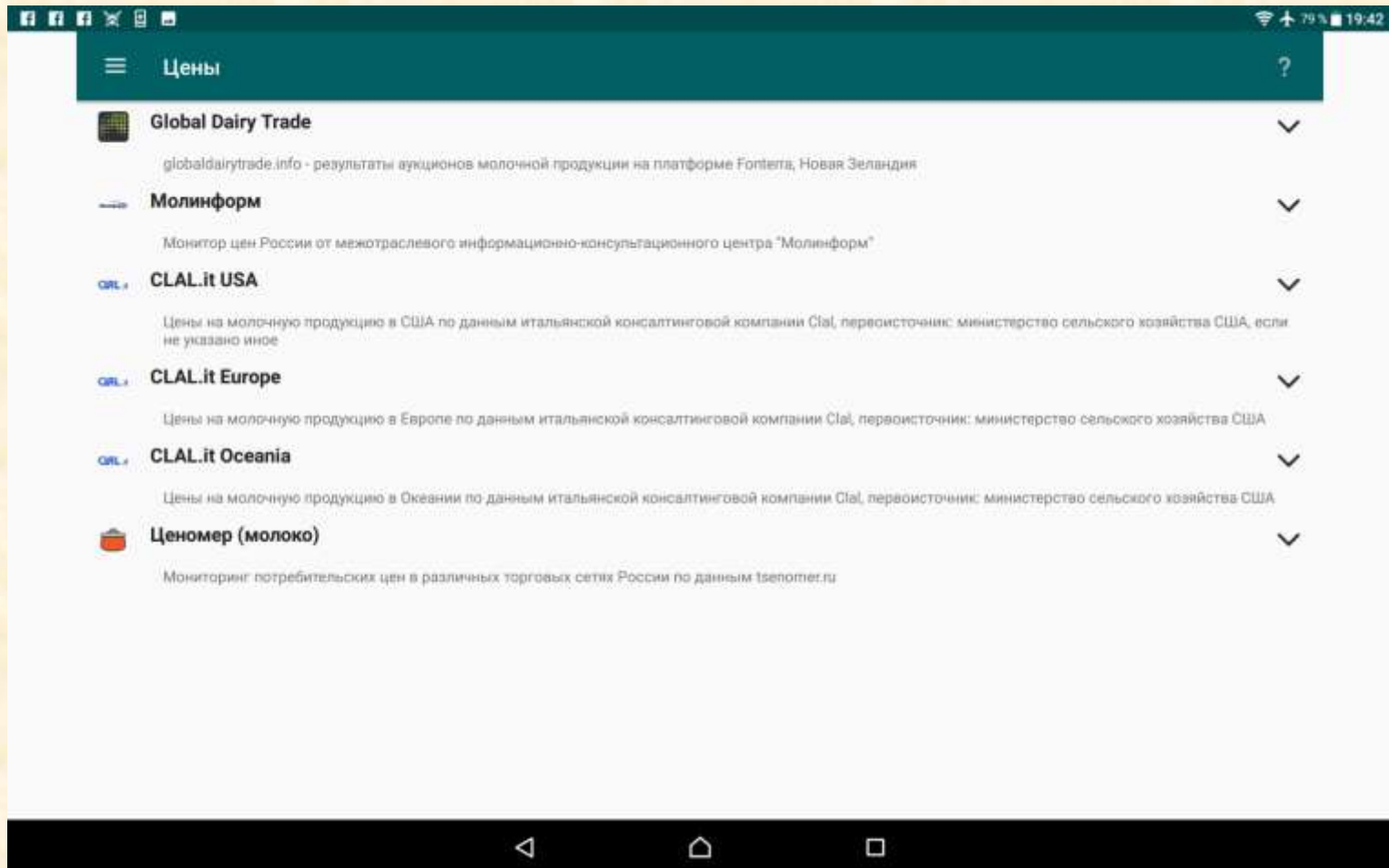
Приложение Dairy Trader

- Ежедневное отслеживание информации о наиболее важных событиях в отрасли
- *Мониторинг и агрегация ценовых изменений всех основных торговых и информационных площадок в мире*
- ***Прогноз цен по всем основным видам сырья и биржевым продуктам на основе алгоритмов глубокого машинного обучения***
- Приложение позволяет в реальном времени **отслеживать все изменения рынка и предоставляет информацию для оперативного принятия решений**

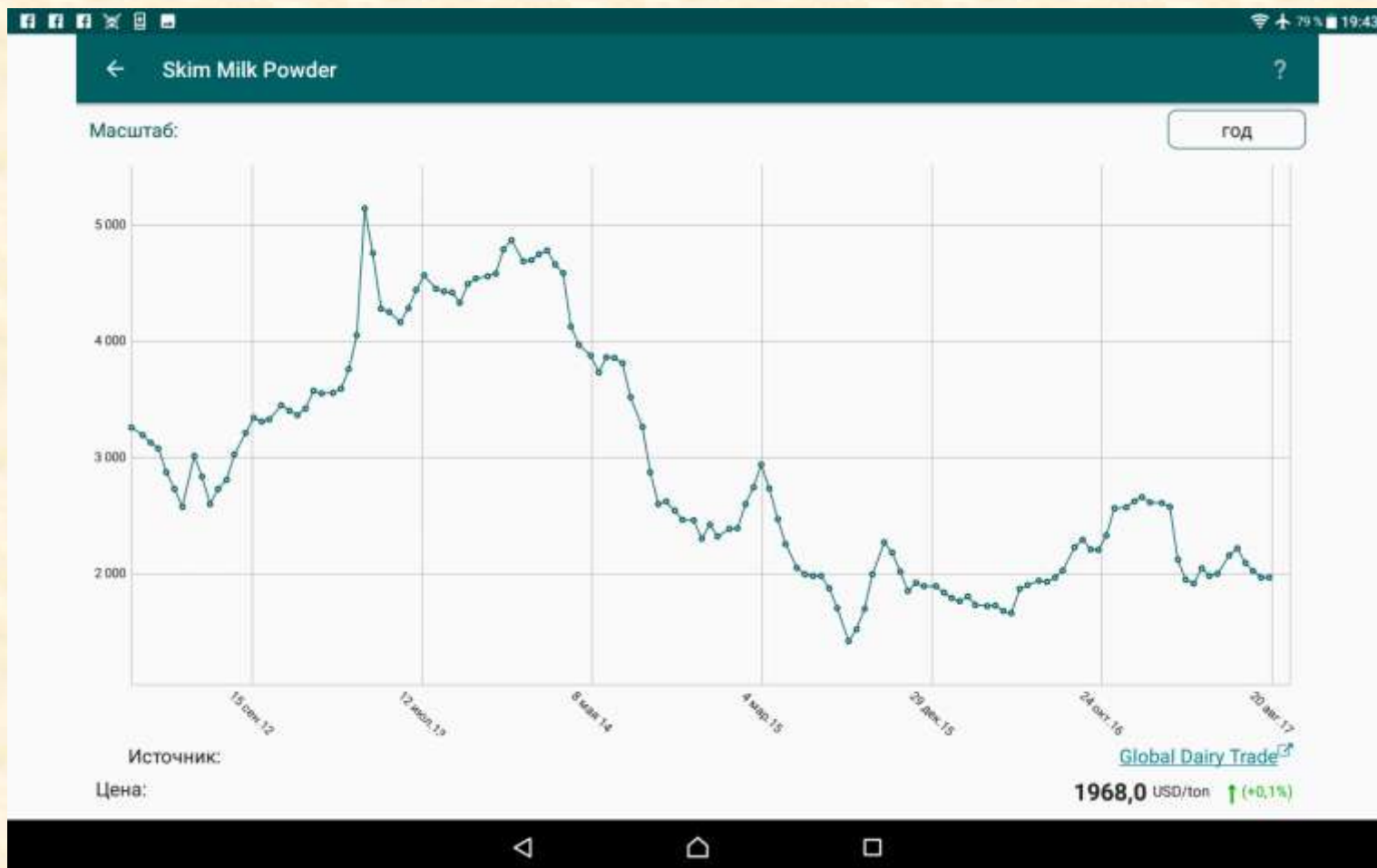
Dairy Trader



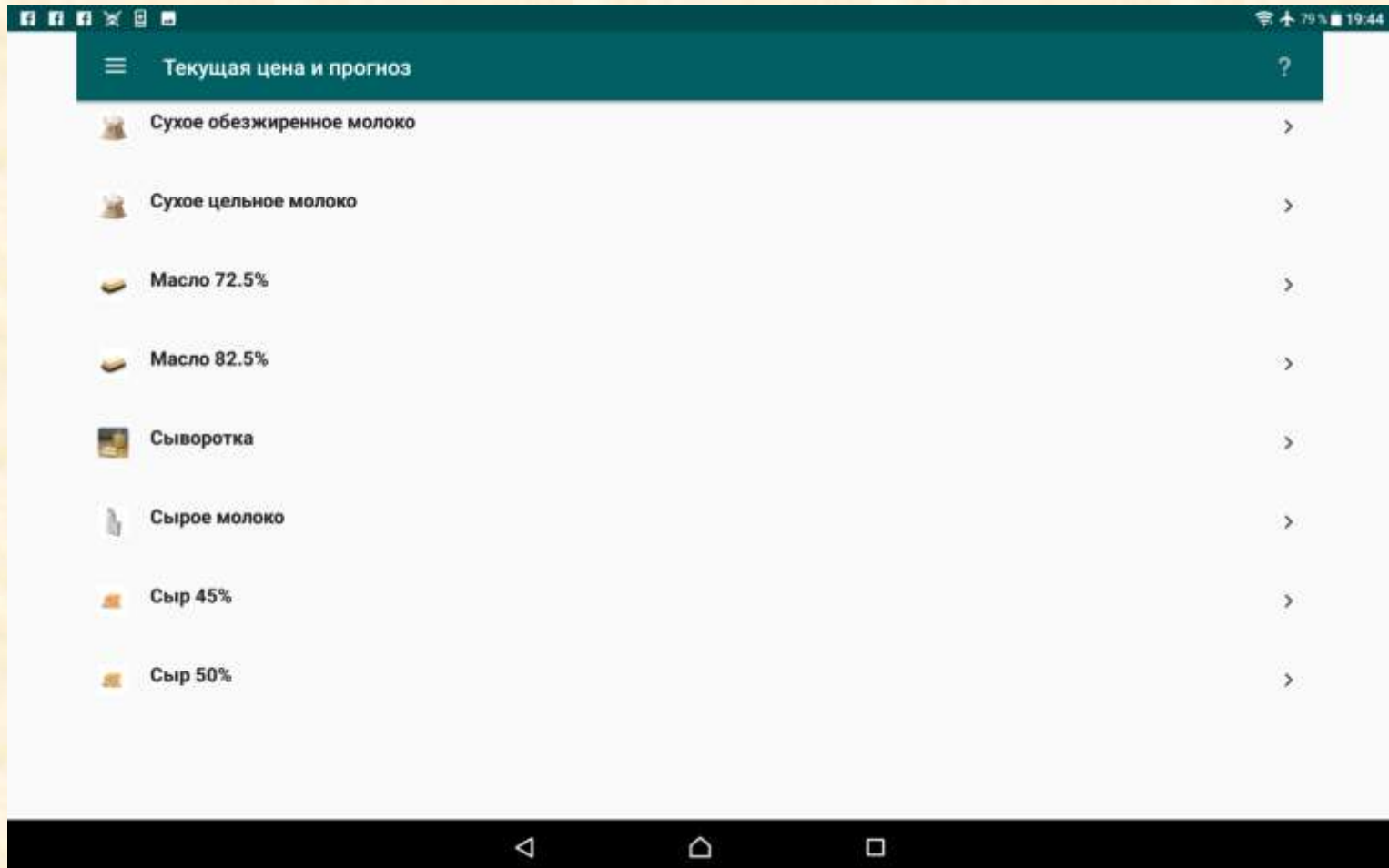
Основные торговые площадки











Цена СОМа на GDT(НЗ)



Текущие цены и прогноз на рынке РФ



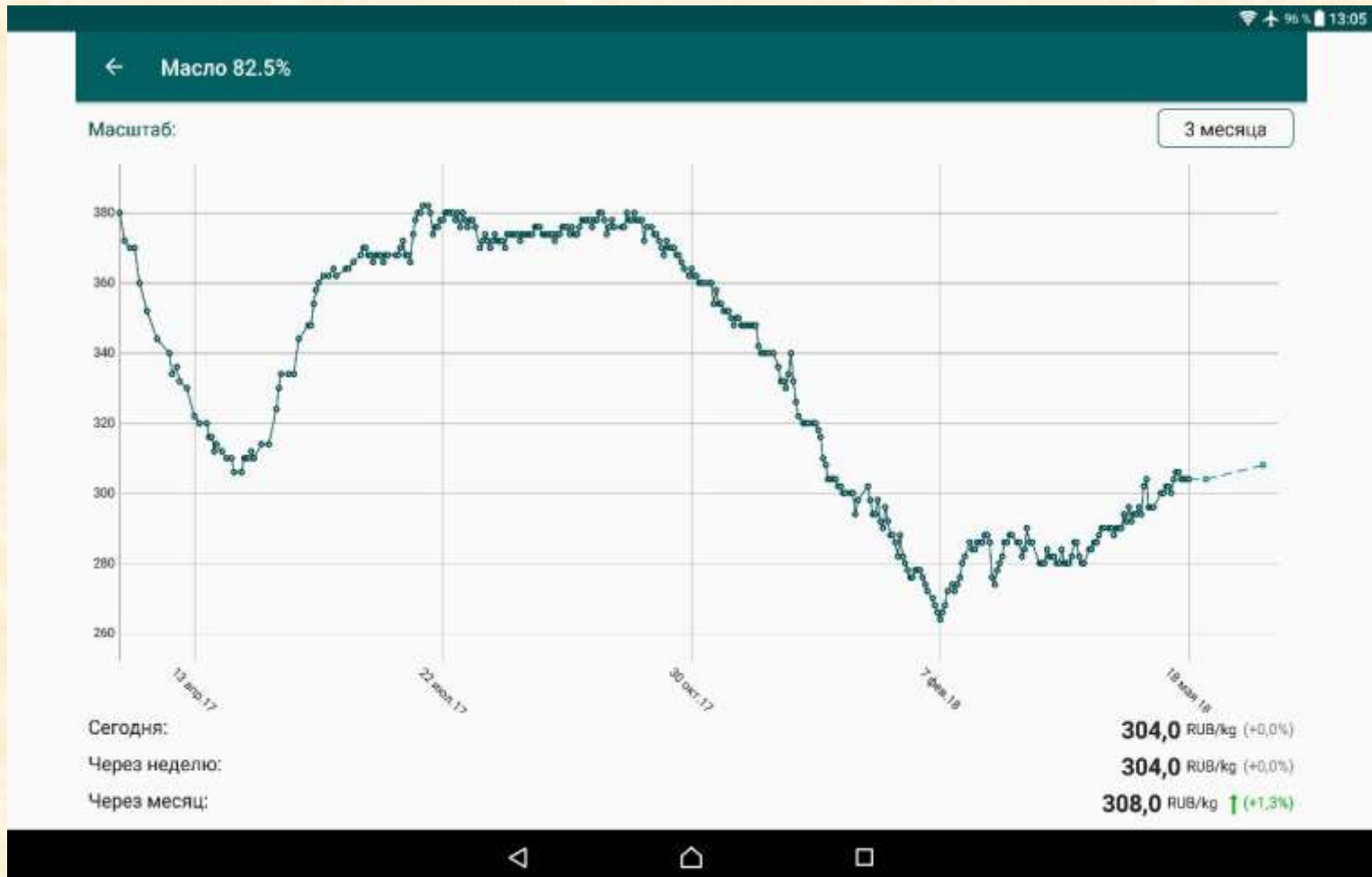
The screenshot shows a mobile application interface with a dark green header bar. The header contains a hamburger menu icon on the left, the text "Текущая цена и прогноз" in the center, and a question mark icon on the right. Below the header is a list of dairy products, each with a small icon, the product name, and a right-pointing chevron. The products listed are:

Icon	Product Name	Action
	Сухое обезжиренное молоко	>
	Сухое цельное молоко	>
	Масло 72.5%	>
	Масло 82.5%	>
	Сыворотка	>
	Сырое молоко	>
	Сыр 45%	>
	Сыр 50%	>

The bottom of the screen shows the standard Android navigation bar with three icons: a triangle, a circle, and a square.

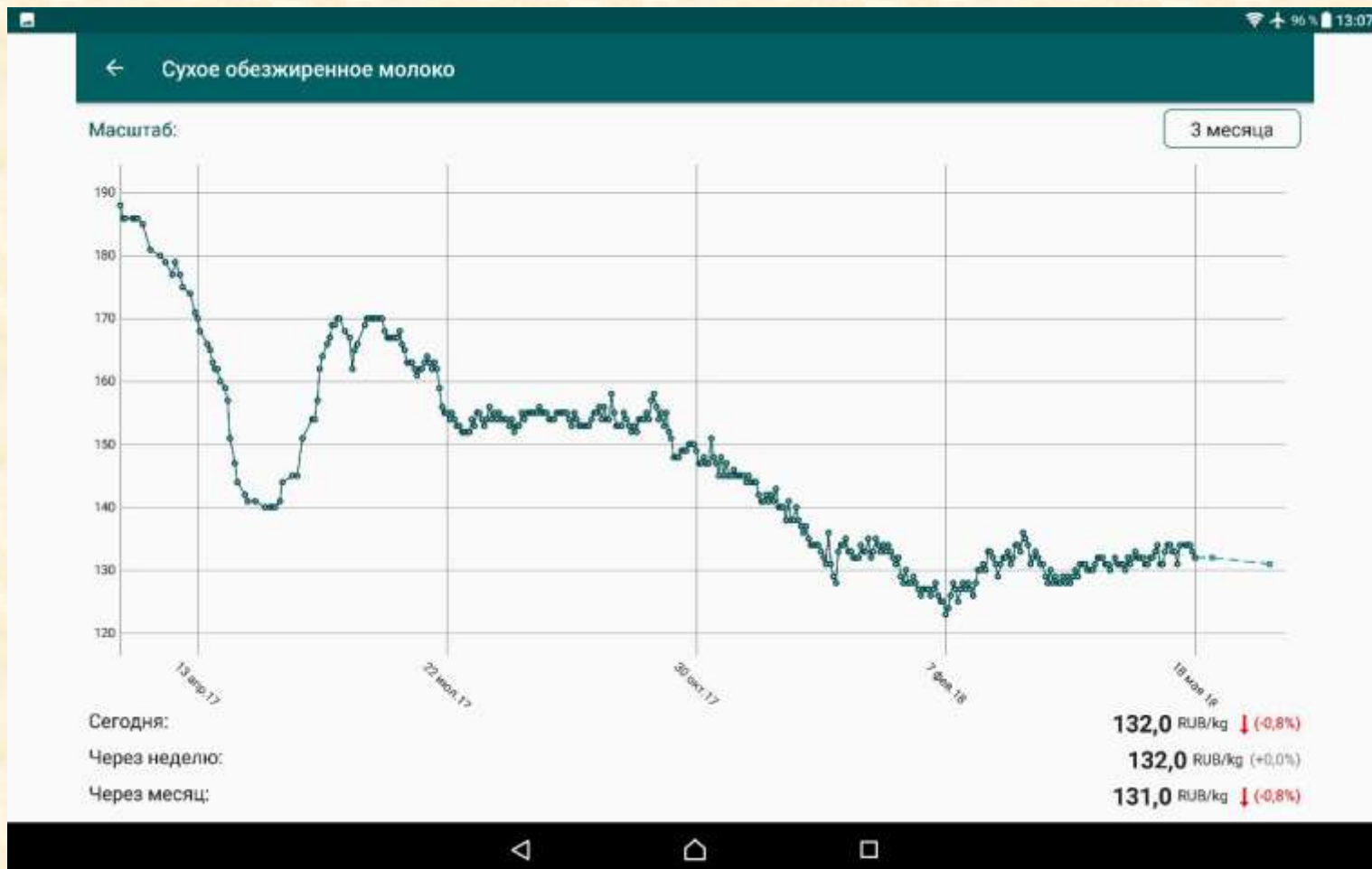
Dairy Trader

Прогноз рынка масла

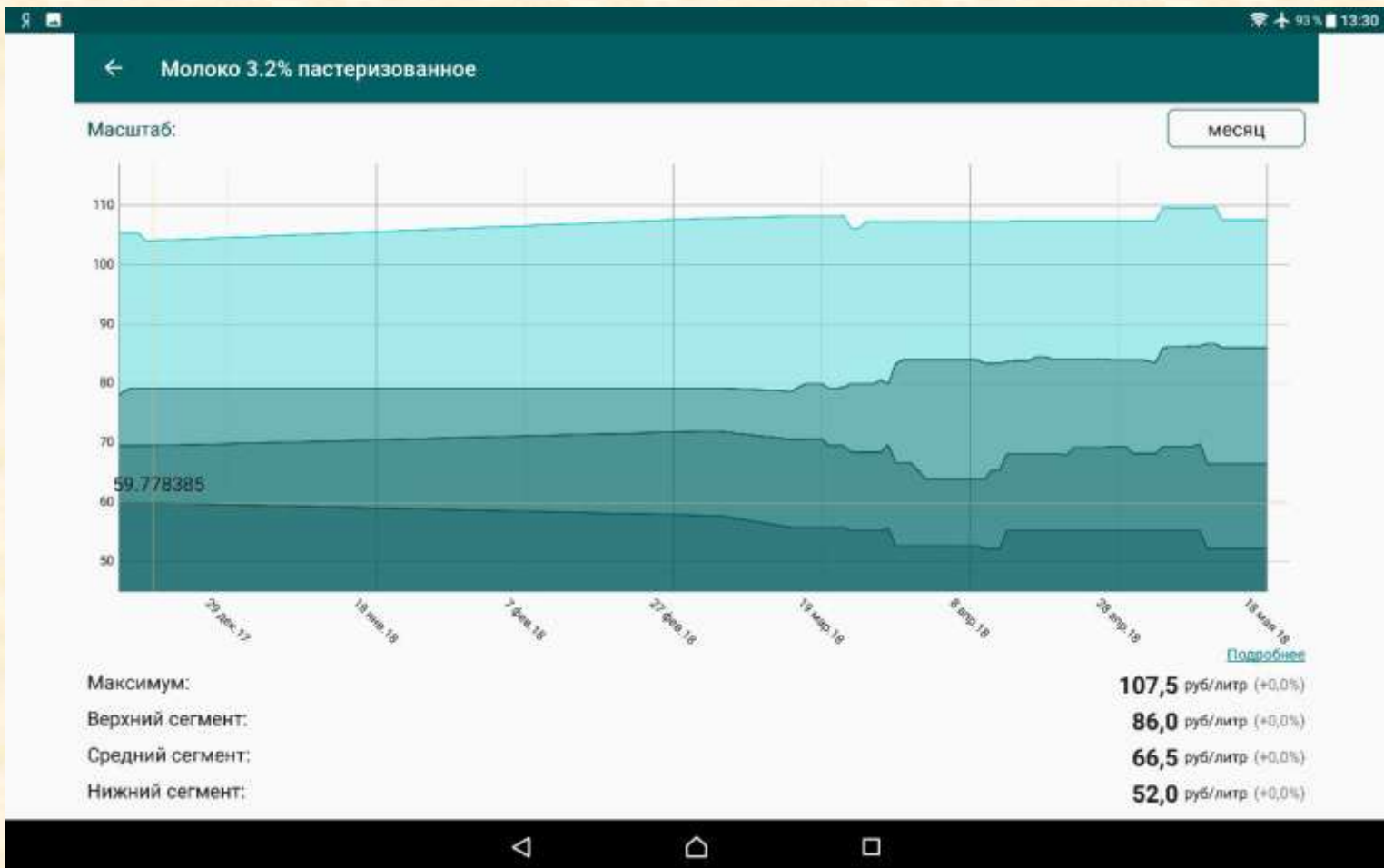


Dairy Trader

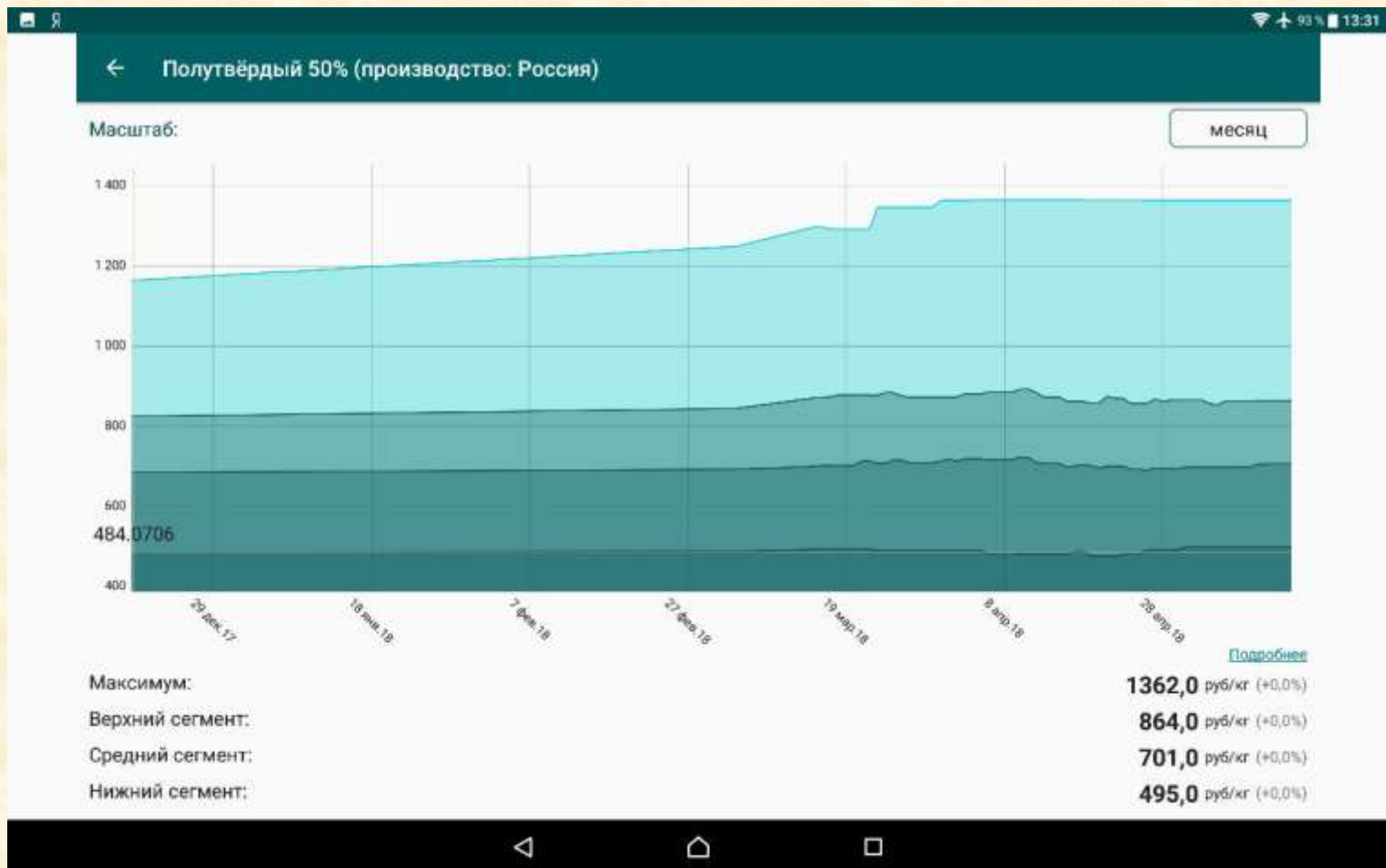
Прогноз рынка COM



Цены на молоко в сетях

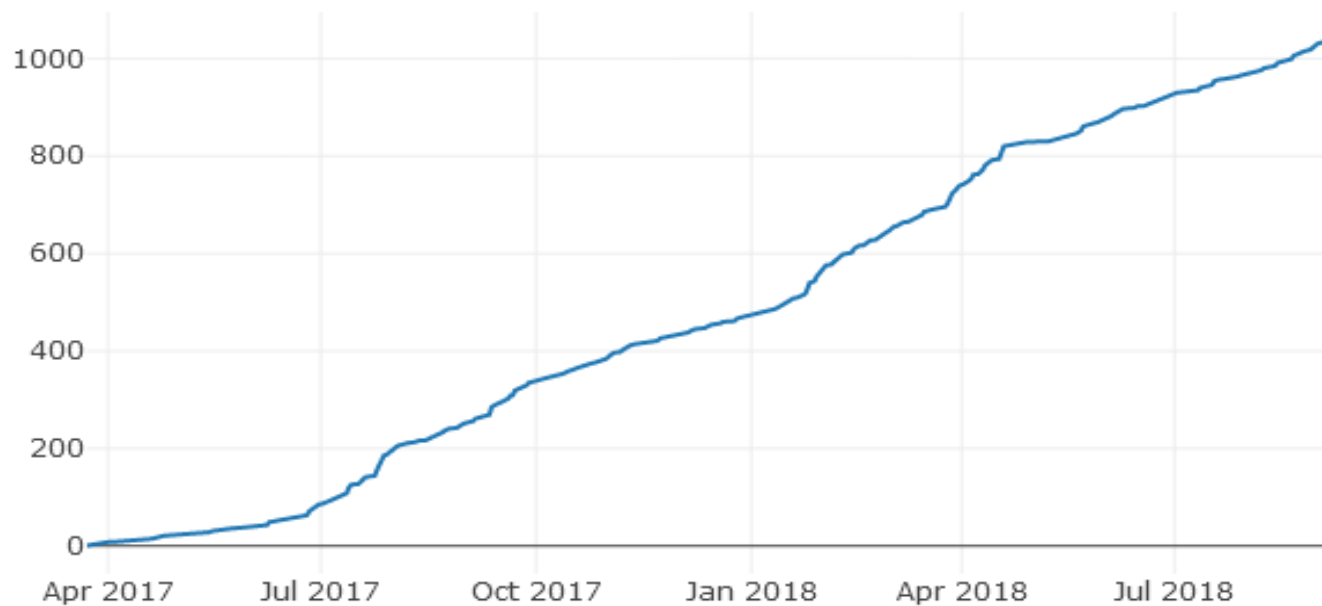


Цены на сыры в сетях



Число пользователей приложения

Всего пользователей



почему разорван × Все молоко в одн × Dairy Trader × +

www.dairytrader.ru Dairy Trader

DAIRY TRADER

Молочный рынок в одном приложении

В этом приложении вы найдёте всё, что нужно трейдеру, аналитику, менеджеру, бизнесмену, работающему на рынке молочной продукции.

Установить Android

Установить iOS

- Теория цен и прогнозы
- Новости
- Цены
- Общие
- Подписка
- Поддержка

Спасибо за внимание !

Александр Поляк

dairytrader.ru

apolyak@swedtg.com

тел 7 903 136 65 04