

تشریح الگوریتم شناسایی مارجین حوزه شمش و میلگرد

تشریح جزئیات بیشتری از الگوریتم شناسایی مارجین ها و دلایل اینکار
پایگاه خبری تحلیلی فولاد مرکز آهن

تشریح الگوریتم شناسایی مارجین حوزه شمش و میلگرد



تشریح جزئیات بیشتری از الگوریتم شناسایی مارجین ها و دلایل اینکار

محاسبه شاخص مارجین دو حوزه تولیدکنندگان شمش القایی و نوردکاران میلگرد آجدار بصورت روزانه توسط گزارشگر فولاد و با استفاده از داده ها و اطلاعات موجود بازار و بکارگیری یک الگوریتم ساده مبتنی بر جمع و میانگین گیری انجام می گردد. محاسبات مارجین بنا به هدفی که دنبال می شود و همان طوری که از نحوه عملکرد آن مشخص است معمولاً به صورت نمونه گیری از یک جامعه آماری؛ میانگین گیری و در نهایت کشف یک شاخص فرضی خام برای مقایسه و تشخیص عملکرد و سمت و سوی پیش گرفته آن جامعه آماری برای میلگرد به جهت دستیابی به یکسری حقایق بازار، مورد استفاده واقع می گردد؛ به طوری که این شاخص آماری تعریف شده کاملاً جنبه کلی و تقریبی داشته؛ و همچنان که مشخص است برای هر یک از اعضای این جامعه آماری و بصورت مستقل، معنا و مفهوم کاربردی نخواهد داشت.

ارائه مثال در خصوص تعیین مارجین

برای درک بهتر هدف؛ طرح موضوع با مثال ادامه پیدا می کند.
فرض بر اینکه سه مبدا تولیدی شمش القایی یا میلگرد X و Y و Z با نرخ متوسط شمش یا میلگرد تولیدی خود در زمان معین t؛ رقم های زیر را به بازار فروش پیشنهاد داده اند.

$$X = 2800$$

$$Y = 2900$$

$$Z = 2910$$



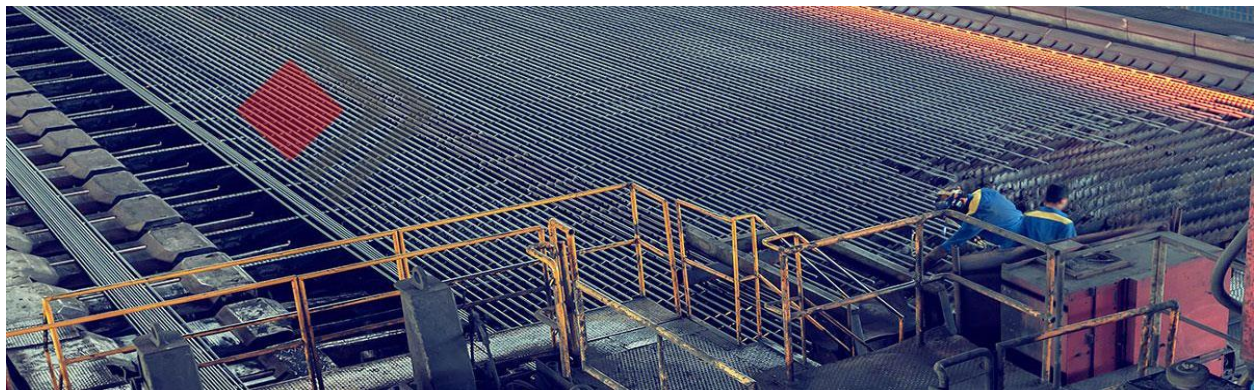


۲

در زمان مشخص t ؛ شاخص متوسط نرخ قراضه آهن ویژه را با جمع و میانگین گیری؛ محاسبه نموده و عدد تقریبی ۲۱۰۵ تومان به ازای هر کیلو را استخراج می نماید.

بنا بر الگوریتم مفروض؛ با جمع نرخ محصول این سه تولیدکننده به عنوان نمونه ای از این جامعه آماری و میانگین گیری از آن ها به رقم ۲۸۷۰ تومان به ازای هر کیلو می رسد و با کسر نمودن شاخص تقریبی قراضه آهن از این عدد، به یک مارجین تقریبی و خام با رقم $i=765$ تومان می رسد.

توجه به این نکته ضروری است که گذشته از این که این مارجین متوسط کاملاً خام محسوب شده و یک رقم کلی و بدون کسر سایر هزینه های جانبی متحمل شده تولیدکننده به دست آمده است؛ این رقم کاملاً وابسته به جمع و جامعه آماری است؛ یعنی به صورت انفرادی هیچ مفهومی برای آن واحد نخواهد داشت.



از طرفی روشن است که ما از مارجین های واقعی این مبادی با ارقام دقیق

$$X = m$$

$$Y = n$$

$$Z = o$$

این سه کارخانه میلگرد یا شمش هیچ اطلاعاتی نداریم، چرا که بدست آوردن مارجین دقیق یک واحد تولیدی اولاً اطلاعات طبقه بندی شده و مخفی است و دوم این که مستلزم در نظر گرفتن متغیرهای زیادی همانند میزان حقوق و دستمزد کارکنان؛ در نظر گرفتن استهلاک دستگاه ها؛ میزان پرت مواد اولیه و بسیاری دیگر از این متغیرها بوده و یک سری محاسبات پیچیده و گروه تخصصی خودش را طلب می نماید.





۳

سوال : پس چرا این رقم مارجین خام کلی i را بدست می آوریم و هدف چیست ؟

ما نمی دانیم در زمان t مارجین واقعی این تولیدکنندگان چقدر بوده است؛ در واقع نیازی هم به دانستن دقیق آن نداریم؛ اما نکته اصلی اینجاست که ما با گذشت زمان 1 روز بعد و در زمان $t+1$ و با همان شرایط تقریباً یکسان؛ این محاسبات را مجدداً تکرار خواهیم کرد؛ هدف اینجا مشخص می شود:

در زمان $t+1$ متوجه می شویم که مارجین خام i مثلاً از 765 تومان به 700 تومان کاهش پیدا کرده است؛ در اینجا دانستن این 65 - تومان حاوی پیام مهم و تاثیرگذاری برای تصمیم گیری های استراتژیک ما در هدف گذاری خرید و فروش بازار میلگرد محسوب خواهد شد:



دلایل استفاده از مارجین شمش و میلگرد

- ۱ (برای مارجین های واقعی این مبادی؛ قطعاً حادثه $n-65$; $m-65$ و $o-65$ اتفاق افتاده است.
- ۲ (روند بازار نزولی بوده است.
- این نخستین استنتاج ما از این محاسبات تنها در یک روز بوده است؛ اما با استمرار در یک بازه مثلاً سه ماهه به نتایج مهم تری دست پیدا خواهیم کرد:
- ۳ (در سه ماهه نخست به یک مارجین خام و متوسط مثلاً 600 تومانی دست پیدا خواهیم کرد که با مقایسه آن با سه ماهه دوم که مثلاً 800 تومان بوده؛ متوجه می شویم که میانگین مارجین واقعی این مبادی 200 تومان افزایش یافته و این عدد 200 تومان کاملاً درست و قابل اثبات است؛ در یک بازه یک ساله باز هم به حقایق بیشتری می رسیم؛





۴

۴) مثلاً در فلان ماه بیشترین مارجین نصیب این حوزه شده و یا این که در مقایسه با سال قبل فلان تومان متوسط مارجین این گروه از تولیدکنندگان افزایش پیدا کرده است.

۵) (و در نهایت و از همه مهم تر این که با دانستن ارقام میانگین هر چند خام، و مقایسه آن ها با یکدیگر؛ می توانیم بصورت تقریبی نقاط بیشینه کاذب و یا نقاط سر به سر تولید را تا حدودی شناسایی نموده تا در نهایت بتوانیم نقاط قابل اطمینان برای سرمایه گذاری و یا بازه های زمانی مناسب برای خرید و فروش در چرخه های متناوب بازار در واحد زمان را تا حدودی تشخیص دهیم.

