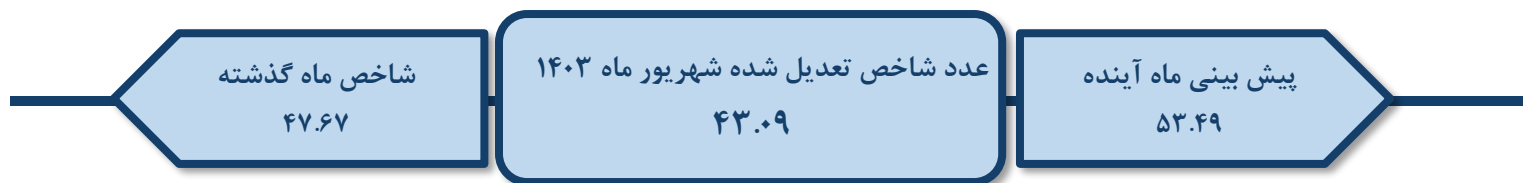


گزارش شصتمین دوره طرح شاخص مدیران خرید (PMI) ساختمان – شهریور ماه ۱۴۰۳

معاونت پشتیبانی و برنامه ریزی اتاق تعاون ایران



معرفی طرح شاخص (شاخص مدیران خرید)

از میان شاخص‌های گوناگون اقتصادی که توسط کشورها و سازمان‌های بین‌المللی انتشار می‌یابند، شاخص (Purchasing Manager's Index) PMI که در فارسی به اختصار "شامخ" نامگذاری شده است، یکی از مهم‌ترین شاخص‌های اقتصادی است که مورد پذیرش اکثر کشورهای توسعه‌یافته قرار دارد. در حال حاضر شاخص شامخ برای حدود ۲۹۰۰۰ بنگاه بخش خصوصی در بیش از ۴۰ کشور دنیا محاسبه و منتشر می‌شود. در ایران نیز اجرای این طرح توسط اتاق بازرگانی ایران در بخش صنعت از مهرماه سال ۹۷ آغاز گردید. نتایج این شاخص که بر اساس پایش پرسشنامه‌ای به دست می‌آید، بینش آنی و تصویر سریعی از شرایط اقتصاد کلان به‌ویژه وضعیت رونق و رکود در بخش‌های ساختمان، صنعت و خدمات ارائه می‌دهد. ویژگی‌های این شاخص عبارتند از:

- داده‌های شامخ به صورت ماهانه در روزهای ابتدایی ماه و پیش از انتشار داده‌های رسمی منتشر می‌شود.
- شامخ، امکان مقایسه مستقیم بسیاری از کشورهای توسعه‌یافته و در حال توسعه از طریق تولید داده‌های استاندارد شده را فراهم می‌سازد.
- داده‌ها در شامخ بر اساس مستندات واقعی کسب‌وکارها و نه بر اساس نظرات شخصی و حدس مدیران جمع‌آوری می‌شوند.
- به‌صورت مستمر و دقیق توسط بازارهای مالی، بانک‌های مرکزی، مراکز تصمیم‌گیری اقتصادی و رسانه‌ها در جهان پیگیری می‌شود.

در طرح شامخ، از پاسخ‌دهندگان خواسته می‌شود به ۱۲ پرسش مطرح‌شده در قالب سه معیار وضعیت نسبت به ماه پیش (بهتر شده، بدتر شده و یا تغییری نکرده است)، پاسخ دهند. در صورت انتخاب گزینه بیشتر از ماه قبل: عدد ۱، گزینه بدون تغییر: عدد ۵/۰ و گزینه کمتر از ماه قبل: عدد صفر برای آن پرسش ثبت می‌شود. مجموع حاصل ضرب درصد پاسخگویان به هریک از گزینه‌ها در عدد همان گزینه، مبین عدد شامخ در آن پرسش است. در نهایت معیار سنجش این شاخص عددی بین ۰ تا ۱۰۰ است. عدد ۰ و ۱۰۰ به ترتیب به معنای آن است که ۱۰۰ درصد پاسخگویان گزینه "بدتر شده است" و "بهتر شده است" را انتخاب نموده‌اند، عدد ۵۰ نشان‌دهنده عدم تغییر وضعیت نسبت به ماه قبل، بالای ۵۰ نشانه بهبود وضعیت نسبت به ماه قبل و زیر ۵۰ به معنای بدتر شدن وضعیت نسبت به ماه قبل است.

اتاق تعاون ایران برای نخستین بار در کشور از مهرماه ۱۳۹۸ نسبت به اجرای طرح شامخ ساختمان اقدام نموده که نتیجه آن بصورت ماهانه توسط مرکز آمار اتاق تعاون ایران منتشر می‌شود. در همین راستا محاسبه شاخص ترکیبی کل اقتصاد، با همکاری سه اتاق بازرگانی، تعاون و اصناف در حال انجام است.

چکیده:

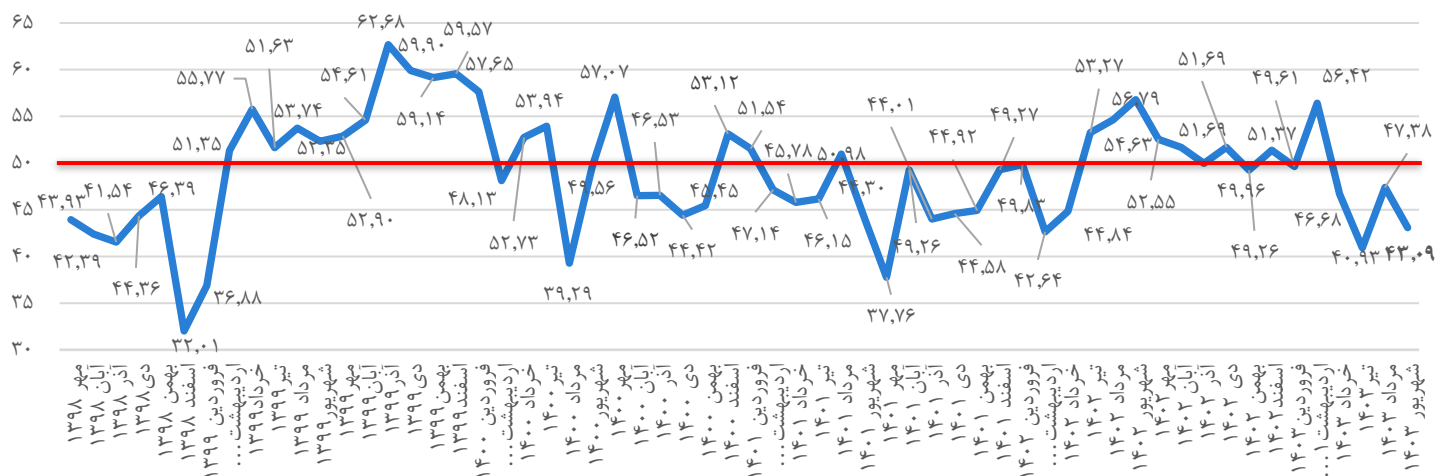
در محاسبه عدد شامخ بخش ساختمان، با توجه به اینکه پرسش اول بالاترین تاثیر را در معیار سنجش کل دارا بوده و بر اساس مطالعات صورت گرفته، رویکرد بکار رفته در محاسبه شاخص کل ساختمان برخی دیگر از کشورها نیز موید این مطلب است؛ لذا عدد شامخ کل برابر با عدد شامخ پرسش اول در نظر گرفته شده است. نتایج ذیل با نظرسنجی از مدیران عامل و یا نمایندگان آنها در شرکت های فعال ساختمانی منتخب، در شهریور ماه بدست آمده است.

- عدد شامخ کل در شهریور ماه (تعدیل نشده فصلی) (۴۱.۵۰) در مقایسه با ماه گذشته (۴۸.۴۰) کاهش قابل توجهی داشته است.
- عدد شامخ کل در شهریور ماه پس از حذف اثر فصلی (۴۳.۰۹) در مقایسه با مرداد ماه (۴۷.۶۷)، با کاهشی نسبی همراه بوده و همچنان بیانگر تداوم وضعیت رکود در صنعت ساختمان است.
- مولفه های "قیمت خرید مواد اولیه یا لوازم مورد نیاز" و "قیمت خرید محصولات تولید شده و یا خدمات ارائه شده" پس از حذف اثر فصلی، نسبت به مرداد ماه افزایش قابل توجهی داشته است.
- مولفه های "میزان فروش کالاها و خدمات" و "میزان سفارشات جدید مشتریان" پس از حذف اثر فصلی، نسبت به مرداد ماه کاهش قابل توجهی داشته است.
- مولفه "انتظارات در ارتباط با فعالیت های شرکت در ماه آینده" وضعیت فعالیت در مهر ماه را در وضعیت رونق پیش بینی می کند.

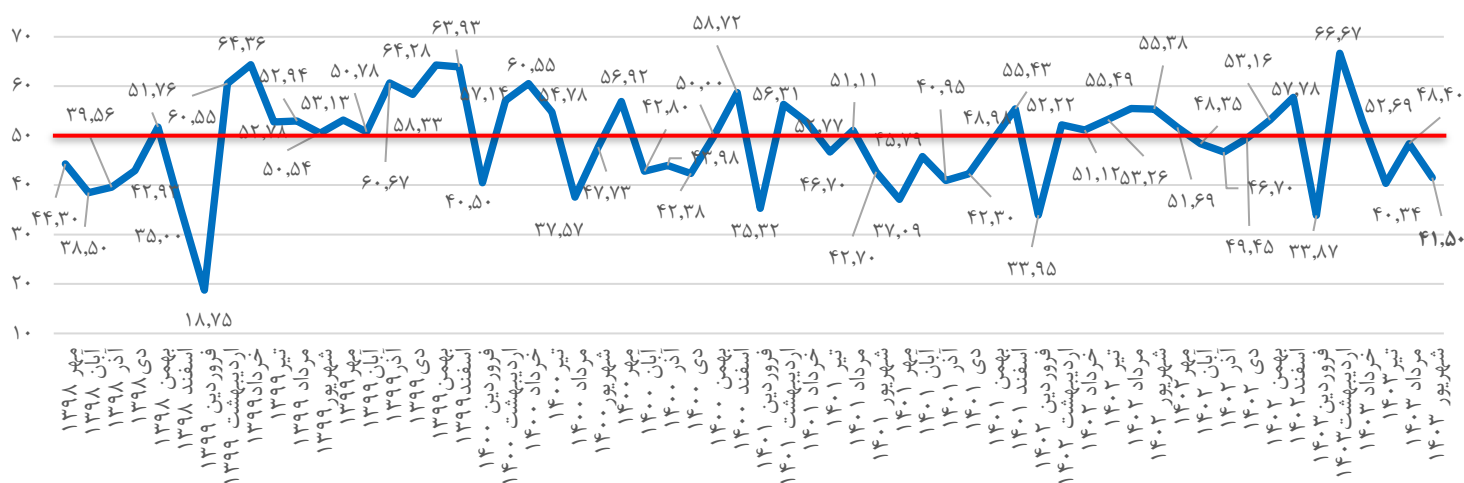
جدول ۱: مولفه های شامخ ساختمان در مرداد ماه و شهریور ماه ۱۴۰۳

شخص		تعدیل نشده فصلی		تعدیل شده فصلی	
		مرداد	شهریور	مرداد	شهریور
شامخ کل ساختمان		۴۸.۴۰	۴۱.۵۰	۴۷.۶۷	۴۳.۰۹
میزان فعالیت های انجام شده (تولید، ارائه خدمات و...)		۴۸.۴۰	۴۱.۵۰	۴۷.۶۷	۴۳.۰۹
میزان سفارشات جدید مشتریان		۴۵.۲۱	۳۹	۴۴.۷۱	۴۰.۵۸
سرعت انجام و تحویل سفارش و یا فرآیند کار		۵۰.۵۳	۵۲.۵	۵۰.۴۳	۵۱.۵۰
موجودی مواد اولیه یا لوازم خریداری شده		۴۲.۵۵	۴۷	۴۲.۱۸	۴۲.۲۴
میزان استخدام و بکارگیری نیروی انسانی		۴۹.۴۷	۵۳.۵	۴۸.۳۹	۵۱.۲۴
قیمت خرید مواد اولیه یا لوازم مورد نیاز		۶۱.۷۰	۶۸	۶۷.۳۷	۷۵.۳۳
موجودی محصول نهایی در انبار و یا کارهای معوق و ناتمام		۵۰.۵۳	۴۷.۵	۴۸.۱۳	۴۳.۹۵
میزان صادرات کالا یا خدمات		۵۰.۰	۴۹	۴۹.۶۲	۴۹.۸۶
قیمت محصولات تولید شده (خدمات ارائه شده)		۵۳.۷۲	۵۹	۵۸.۴۲	۶۵.۰۳
مصرف حامل های انرژی		۵۰.۵۳	۴۵	۴۹.۵۲	۴۸.۶۷
میزان فروش کالاها و خدمات		۴۶.۸۱	۳۵	۴۵.۶۴	۳۶.۴۳
انتظارات در ارتباط با فعالیت های شرکت در ماه آینده		۵۱.۰۶	۵۰	۵۱	۵۳.۴۹

روند شامخ ساختمان از مهر ماه ۱۳۹۸ تا شهریورماه ۱۴۰۳ (تعدیل شده)



روند شامخ ساختمان از مهر ماه ۱۳۹۸ تا شهریور ماه ۱۴۰۳ (تعدیل نشده)



جدول ۳: عدد شامخ ترکیبی (تولید، خدمات و ساختمان)
کشورهای منتخب در دو ماه اخیر

کشور	آگوست	سپتامبر
استرالیا	۵۱.۴	۴۹.۶
اتحادیه اروپا	۵۱.۲	۴۹.۶
فرانسه	۵۲.۷	۴۸.۶
آلمان	۴۸.۵	۴۷.۵
ژاپن	۵۳	۵۲
انگلستان	۵۳.۴	۵۲.۶
آمریکا	۵۴.۱	۵۴

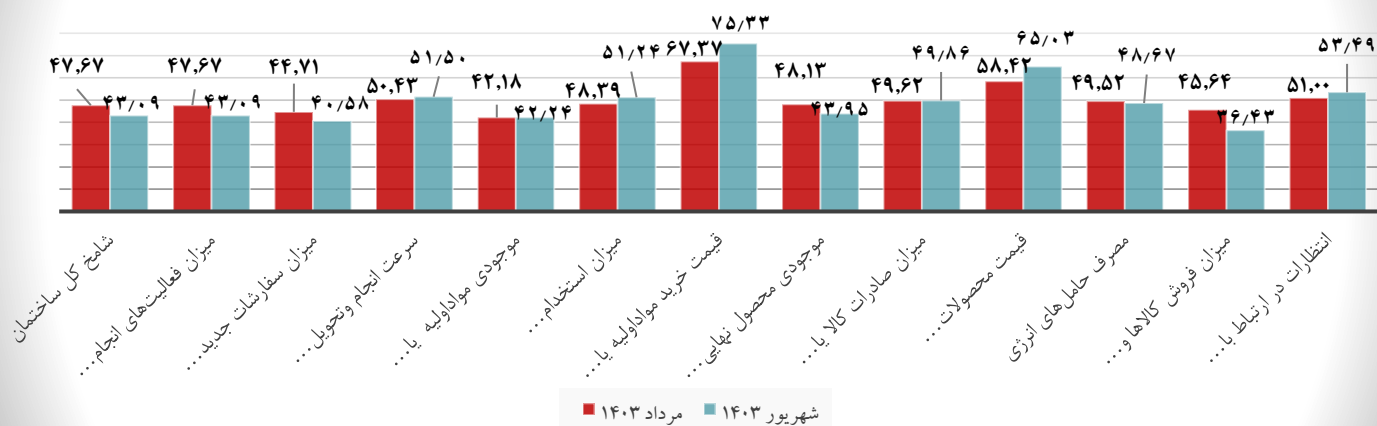
جدول ۲: عدد شامخ ساختمان کشورهای منتخب در دو ماه گذشته

کشور	جولای	آگوست
ایرلند	۴۹.۹	۵۰
اتحادیه اروپا	۴۱.۴	۴۱.۴
فرانسه	۳۹.۷	۴۰.۱
آلمان	۴۰	۳۸.۹
ایتالیا	۴۵	۴۶.۶
انگلستان	۵۵.۳	۵۳.۶

tradingeconomics.com * در زمان تهیه ی این گزارش، نتیجه شامخ

ساختمان در کشور های ذکر شده در ماه سپتامبر اعلام نشده است

مقایسه شاخص های شامخ در دو ماه اخیر (تعدیل شده)



اهمیت و روش تعدیل فصلی شامخ:

تعدیل فصلی یا فصل زدایی یک روش آماری برای حذف مؤلفه فصلی یک سری زمانی است و معمولاً زمانی انجام می شود که بخواهیم روند و انحرافات چرخه ای از روند یک سری زمانی را مستقل از مؤلفه های فصلی آن تحلیل کنیم. مؤلفه فصلی بخشی از یک سری زمانی است که در آن داده ها تغییرات منظم و قابل پیش بینی را که منطبق بر فواصل زمانی تقویمی منظم و دارای الگوی تکراری (مانند ماه ها یا سال مالی) است، تجربه می کنند. به عنوان مثال، میزان تقاضا در ماه اسفند به طور معمول افزایش می یابد و در ماه فروردین کاهش می یابد به عنوان یک مثال دیگر، مصرف گاز طبیعی در تابستان کمتر و در زمستان بسیار بیشتر از سایر فصول است. غیر از الگوی فصلی یک سری زمانی می تواند شامل مؤلفه های دیگری مانند روند، سیکل ها و یا جز اخلاص نیز باشد که می توان آنها را نیز توسط روشهای مربوطه از سری مورد نظر استخراج کرد.

باید توجه داشت که مؤلفه های فصلی، از نظر تئوری، هر سال در یک دوره زمانی مشابه با بزرگی مشابه اتفاق می افتند، بنابراین در هنگام ردیابی آثار یک سیاست گذاری خاص و یا بررسی رخدادهای اقتصادی بر یک سری زمانی، بهتر است مؤلفه فصلی از سری زمانی حذف شود هرچه مؤلفه فصلی در یک سری زمانی قوی تر باشد و تغییرات فصلی در آن مشهود باشد، ضرورت تعدیل فصلی آن سری زمانی خصوصاً برای تحلیل دقیق تر نتایج سیاستی بیشتر می شود. شواهد تجربی در ایران حاکی از قوی بودن اثرات فصلی در اغلب سری های زمانی متغیرهای اقتصادی است. خوشبختانه، در نتیجه استمرار تهیه شامخ و با افزایش طول دوره سری های زمانی آن، شناسایی مؤلفه فصلی این سری های زمانی ممکن شده است و بر اساس این امکان، تعدیل فصلی این سری های زمانی در دستور کار قرار گرفته است.

تحلیل شامخ بخش ساختمان ایران در شهریور ماه ۱۴۰۳:

با استناد به مجموع اظهارات فعالان ساختمانی ۱۰۰ شرکت بزرگ در گروه های ساخت بنا، مهندسی عمران و فعالیت های ساخت و ساز تخصصی ساختمان نتایج زیر به ثبت رسید :

✓ عدد شاخص کل ساختمان (تعدیل شده فصلی) در شهریور ماه (۴۳.۰۹) در مقایسه با مرداد ماه (۴۷.۶۷) با کاهش نسبی، برای سومین دوره متوالی بیانگر وضعیت رکود صنعت ساختمان است (عدد شاخص کل پایین تر از ۵۰ است). از عمده دلایل کاهش فعالیت ها در این دوره می توان به تعطیلات متوالی شهریور ماه اشاره کرد.

✓ مولفه های "قیمت خرید مواد اولیه یا لوازم مورد نیاز" و "قیمت خرید محصولات تولید شده و یا خدمات ارائه شده" پس از حذف اثر فصلی، نسبت به مرداد ماه افزایش قابل توجهی داشته است. مولفه "قیمت خرید مواد اولیه یا لوازم مورد نیاز" در بیست و سه دوره اخیر رکورد بیشترین تکرار به عنوان بالاترین مولفه در بین مولفه های دوازده گانه را به خود اختصاص داده است.

✓ مولفه های "میزان فروش کالاها و خدمات" و "میزان سفارشات جدید مشتریان" پس از حذف اثر فصلی، نسبت به مرداد ماه کاهش قابل توجهی داشته است.

✓ طبق نظر خبرگان صنعت ساختمان بر اساس مولفه "انتظارات در ارتباط با فعالیت های شرکت در ماه آینده"، فعالیت شرکت های ساختمانی در شهریور ماه در وضعیت رونق پیش بینی می شود. اما تحقق این امر در گرو اصلاح نظام مالیاتی و بیمه تامین اجتماعی و نیز تسهیل در روند پرداخت تسهیلات می باشد.

➤ کاربران، ذینفعان و محققین محترم می توانند با مراجعه به پورتال تخصصی اتاق تعاون ایران به نشانی www.icccoop.ir به نسخه الکترونیکی این گزارش دست یابند. در ضمن می توانید نظرات، پیشنهادات و انتقادات ارزشمند خود را از طریق پست الکترونیک icc-statistics@icccoop.ir با ما در میان بگذارید.