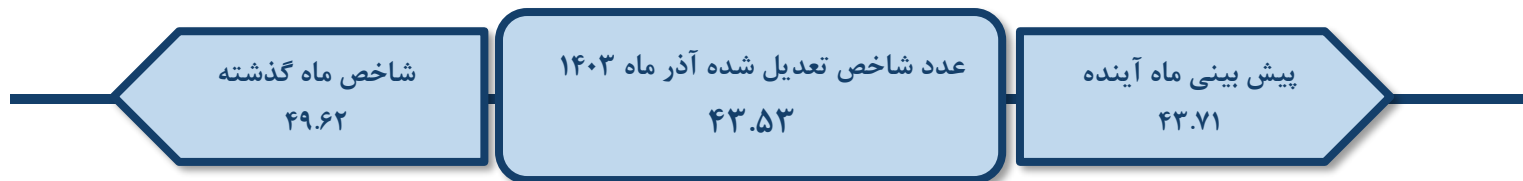


گزارش شصت و سومین دوره طرح شاخص مدیران خرید (PMI) ساختمان - آذر ماه ۱۴۰۳

معاونت پشتیبانی و برنامه ریزی اتاق تعاون ایران



معرفی طرح شامخ (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 شامخ 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 آذر ماه بدست آمده است.

- عدد شامخ کل در آذر ماه (تعدیل نشده فصلی) (۳۸.۸۳) در مقایسه با ماه گذشته (۴۷.۴۷) کاهش قابل توجهی داشته است.
- عدد شامخ کل در آذر ماه پس از حذف اثر فصلی (۴۳.۵۳) در مقایسه با آبان ماه (۴۹.۶۲)، با کاهش قابل توجهی همراه بوده است.
- مولفه "موجودی محصول نهایی در انبار و یا کارهای معوق و ناتمام" پس از حذف اثر فصلی، نسبت به آبان ماه افزایشی قابل توجه داشته است.
- مولفه های "مصرف حامل انرژی" و "سرعت انجام و تحویل سفارش و یا فرآیند کار" پس از حذف اثر فصلی، نسبت به آبان ماه کاهش بی سابقه داشته است.
- مولفه "انتظارات در ارتباط با فعالیت های شرکت در ماه آینده" (۴۳.۷۱) با کاهش قابل توجه، فعالیت های دی ماه را در وضعیت رکود اقتصادی پیش بینی می نماید.

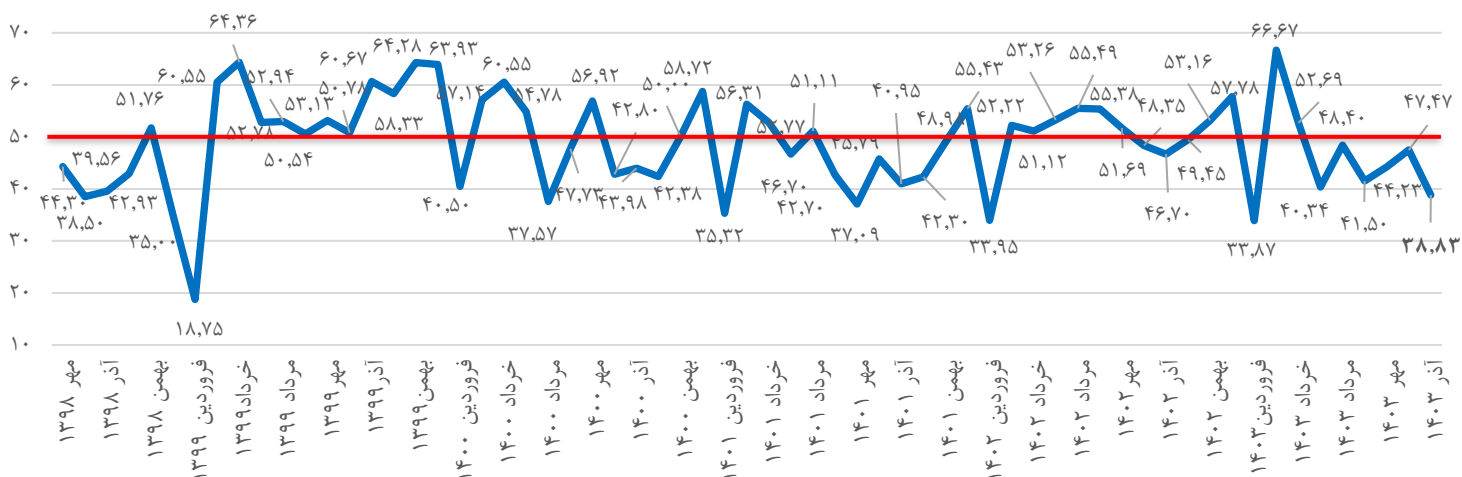
جدول ۱: مولفه های شامخ ساختمان در آبان ماه و آذر ماه ۱۴۰۳

تعدیل شده فصلی		تعدیل نشده فصلی		شاخص
آذر ۱۴۰۳	آبان ۱۴۰۳	آذر ۱۴۰۳	آبان ۱۴۰۳	
۴۳.۵۳	۴۹.۶۲	۳۸.۸۳	۴۷.۴۷	شامخ کل ساختمان
۴۳.۵۳	۴۹.۶۲	۳۸.۸۳	۴۷.۴۷	میزان فعالیت های انجام شده (تولید، ارائه خدمات و ...)
۴۵.۳۴	۴۴.۷۱	۴۱.۷۵	۴۴.۴۴	میزان سفارشات جدید مشتریان
۳۵.۱۸	۴۸.۷۴	۳۱.۵۵	۴۴.۴۴	سرعت انجام و تحویل سفارش و یا فرآیند کار
۴۴.۱۲	۴۳.۸۵	۴۴.۱۷	۴۳.۴۳	موجودی مواد اولیه یا لوازم خریداری شده
۴۸.۰۶	۵۰.۰۰	۴۸.۰۶	۵۰.۰۰	میزان استخدام و بکارگیری نیروی انسانی
۶۹.۴۲	۷۰.۲۰	۶۹.۴۲	۷۰.۲۰	قیمت خرید مواد اولیه یا لوازم مورد نیاز
۵۲.۹۱	۴۶.۹۲	۵۲.۹۱	۴۵.۹۶	موجودی محصول نهایی در انبار و یا کارهای معوق و ناتمام
۴۹.۴۶	۵۰.۶۵	۴۹.۵۱	۵۰.۵۱	میزان صادرات کالا یا خدمات
۵۶.۸۰	۵۸.۰۸	۵۶.۸۰	۵۸.۰۸	قیمت محصولات تولید شده (خدمات ارائه شده)
۳۳.۶۲	۵۰.۳۴	۳۳.۹۸	۵۰.۰۰	مصرف حامل های انرژی
۴۰.۳۰	۴۸.۰۶	۳۹.۳۲	۴۴.۹۵	میزان فروش کالاها و خدمات
۴۳.۷۱	۵۳.۲۱	۴۵.۶۳	۴۷.۹۸	انتظارات در ارتباط با فعالیت های شرکت در ماه آینده

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



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



جدول ۳: عدد شامخ ترکیبی (تولید، خدمات و ساختمان)

کشورهای منتخب در دو ماه اخیر

کشور	نوامبر	دسامبر
استرالیا	۴۹٫۴	۴۹٫۹
اتحادیه اروپا	۴۸٫۱	۴۹٫۵
فرانسه	۴۴٫۸	۴۶٫۷
آلمان	۴۷٫۳	۴۷٫۸
ژاپن	۴۹٫۸	۵۰٫۸
انگلستان	۴۹٫۹	۵۰٫۵
آمریکا	۵۵٫۳	۵۶٫۶

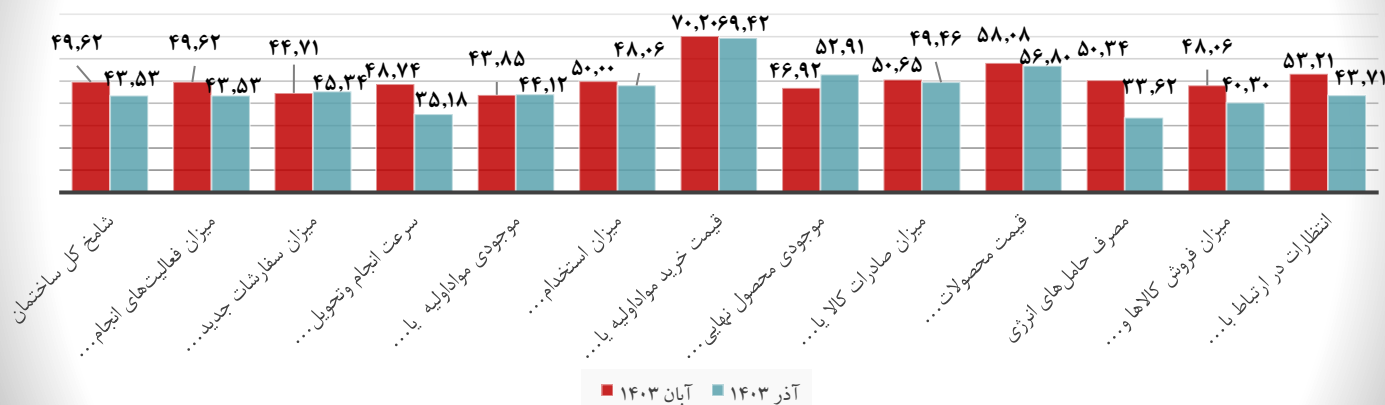
جدول ۲: عدد شامخ ساختمان کشورهای منتخب در دو ماه گذشته

کشور	اکتبر	نوامبر
ایرلند	۴۹٫۴	۴۷٫۵
اتحادیه اروپا	۴۳	۴۲٫۷
فرانسه	۴۲٫۲	۴۳٫۷
آلمان	۴۰٫۲	۳۸
ایتالیا	۴۸٫۲	۴۸٫۵
انگلستان	۵۴٫۳	۵۵٫۲

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

ساختمان در کشورهای ذکر شده در ماه دسامبر 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 چرخه‌ای از روند یک سری زمانی را مستقل از مؤلفه‌های فصلی آن تحلیل کنیم. مؤلفه فصلی بخشی از یک سری زمانی است که در آن داده‌ها تغییرات منظم و قابل پیش‌بینی را که منطبق بر فواصل زمانی تقویمی منظم و دارای الگوی تکراری (مانند ماه‌ها یا سال مالی) است، تجربه می‌کنند. به عنوان مثال، میزان تقاضا در ماه اسفند به طور معمول افزایش می یابد و در ماه فروردین کاهش می‌یابد 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 مؤلفه‌های دیگری مانند روند، سیکل‌ها 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 مؤلفه‌های فصلی، از نظر تئوری، هر سال در یک دوره زمانی مشابه با بزرگی مشابه اتفاق می‌افتند، بنابراین در هنگام ردیابی آثار یک سیاست‌گذاری 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 قوی‌تر باشد و تغییرات فصلی در آن مشهود باشد، ضرورت تعدیل فصلی آن سری زمانی خصوصاً برای تحلیل دقیق‌تر نتایج سیاستی بیشتر می‌شود. شواهد تجربی در ایران حاکی از قوی بودن اثرات فصلی در اغلب سری‌های زمانی متغیرهای اقتصادی است. خوشبختانه، در نتیجه استمرار تهیه شامخ و با افزایش طول دوره سری‌های زمانی آن، شناسایی مؤلفه فصلی این سری‌های زمانی ممکن شده است و بر اساس این امکان، تعدیل فصلی این سری‌های زمانی در دستور کار قرار گرفته است.

تحلیل شامخ بخش ساختمان ایران در آذر ماه ۱۴۰۳:

با استناد به مجموع اظهارات فعالان ساختمانی ۱۰۳ 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 آذر ماه (۴۳.۵۳) در مقایسه با آبان ماه (۴۹.۶۲) با کاهش قابل توجه، برای هفتمین ماه متوالی بیانگر وضعیت رکود صنعت ساختمان است (عدد شاخص کل پایین تر از ۵۰ است).

✓ مولفه های "مصرف حامل های انرژی" و "سرعت انجام و تحویل سفارش و یا فرآیند کار" پس از حذف اثر فصلی، با کاهش بی سابقه (متاثر از تداوم برنامه قطعی برق) در آذر ماه همراه بود.

✓ افزایش مولفه "موجودی محصول نهایی در انبار و یا کارهای معوق و ناتمام" پس از حذف اثر فصلی، در نتیجه کاهش مولفه های "میزان فروش کالاها و خدمات" و "مصرف حامل های انرژی" و نیز افزایش مستمر نرخ ارز طی ماه های گذشته بوده است.

✓ مولفه "انتظارات در ارتباط با فعالیت های شرکت در ماه آینده" پس از حذف اثر فصلی، با رقم (۴۳.۷۱) پایین ترین میزان خود از ابتدای سال جاری را به ثبت رسانده است؛ این در حالی است که پیش بینی وضعیت فعالیت ها برای دی ماه در دوره مشابه سال گذشته به مراتب خوش بینانه تر بوده است. براساس اظهار نظر فعالین صنعت ساختمان و ساخت و ساز، ادامه فعالیت ها در تنگنای کمبود نقدینگی ناشی از بی ثباتی نرخ ارز و نیز دشواری تامین مواد اولیه به عنوان اصلی ترین موانع کسب و کار، دور از انتظار است.

➤ 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.