



# تحلیل تورم برخی از گروه‌های کالایی مربوط به مواد غذایی در دو بخش تولیدکننده و مصرف‌کننده

بازه زمانی ۱۳۹۸-۱۳۹۱

فاطمه مالی

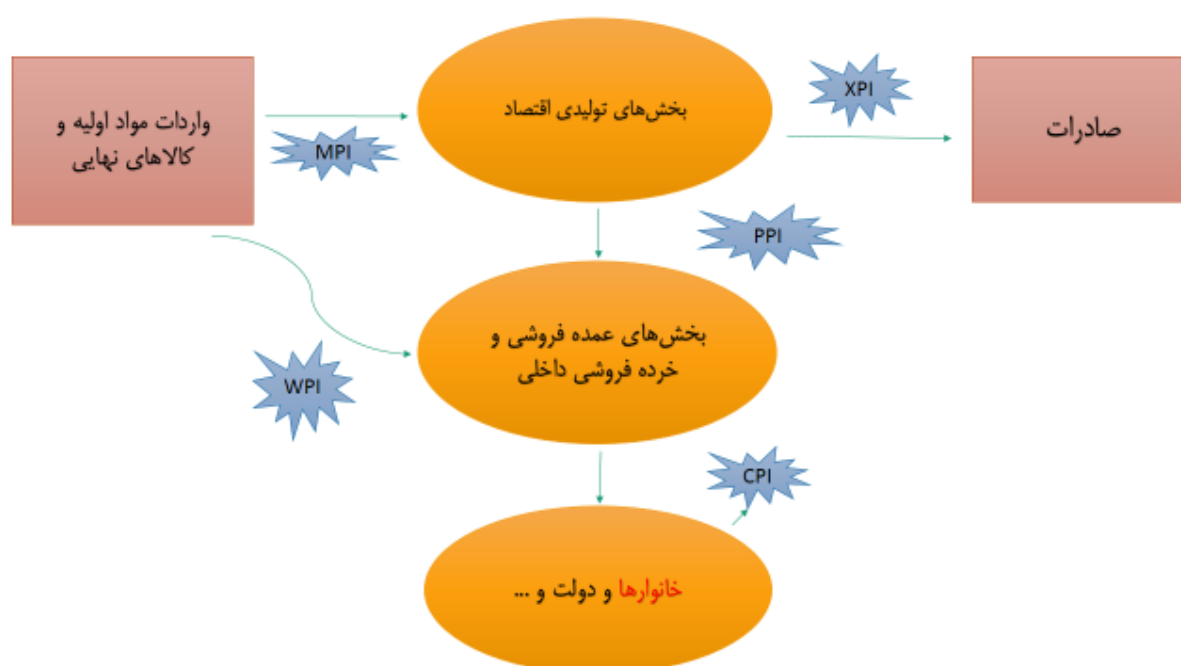
رئیس گروه شاخص‌های قیمت تولیدکننده، صنعت، معدن و انرژی

## مقدمه:

ارزش اقتصادی هر کالا یا خدمت با قیمت آن مشخص می‌شود. این متغیر در طول زمان می‌تواند دچار تغییر و نوسان شود. قیمت از مهم‌ترین پارامترهای اقتصادی بوده که در تحلیل‌های خرد و کلان اقتصادی مورد توجه قرار می‌گیرد. در اقتصاد هر کشور مجموعه‌ی گسترده‌ای از کالاها و خدمات تولید یا مصرف می‌شود که به منظور بررسی روند کلی قیمت کالاها و خدمات باید به دنبال شیوه‌ای برای خلاصه کردن سطوح قیمت کالاها و خدمات باشیم. استفاده از شاخص‌های قیمت به آسانی این ابزار را در اختیار ما قرار می‌دهد و با محاسبه آن‌ها می‌توان با وجود تنوع بالای کالاها و خدمات و کیفیت متفاوتشان، معیار مناسبی از سطح عمومی قیمت‌ها ارائه داد و وضعیت کلی قیمت‌ها را بیان کرد.

در محاسبات مربوط به شاخص قیمت، بسته به اینکه از چه نوع قیمتی (نوع معامله) استفاده کنیم و قیمت‌های مورد استفاده در محاسبه شاخص با چه وزن و ضریب اهمیتی (منابع مورد استفاده در وزن‌دهی قیمت اقلام) در نظر گرفته شوند، می‌توان شاخص‌های قیمت متفاوتی را تعریف کرد. به منظور معرفی انواع متفاوت شاخص قیمت، ابتدا نگاه اجمالی به مبادلات ساده بین بخشی در یک اقتصاد باز می‌اندازیم.

نمودار ۱: نمودار ساده از مبادلات بین بخشی در یک اقتصاد باز



همانطور که در نمودار فوق مشاهده می‌شود، یا توجه به روابط و مبادلات اقتصادی بین بخش‌های مختلف اقتصادی، می‌توان یک نظام آماری اقتصادی را معرفی کرد که شامل پنج شاخص قیمت اصلی می‌باشد.

### ۱- شاخص قیمت تولیدکننده (PPI)

- ۲- شاخص قیمت مصرف کننده (CPI)
- ۳- شاخص قیمت محصولات وارداتی (MPI)
- ۴- شاخص قیمت محصولات صادراتی (XPI)
- ۵- شاخص قیمت عمده‌فروشی محصولات (WPI)

این پنج شاخص قیمت اصلی بسیار مهم بوده و در ارزیابی عملکرد کلان یک اقتصاد کاربردهای گسترده‌ای دارند. همچنین این شاخص‌های قیمت با هم غیرمرتبط نیستند و دیدگاه یکپارچه و منسجمی از تحولات قیمت را در عرصه‌های تولید، توزیع، مصرف و معاملات بین‌المللی نشان می‌دهند.

در تحلیل‌های مربوط به تورم، به منظور دستیابی به بینش لازم در مورد پیوند متقابل بین قیمت‌های مختلف به بیش از یک شاخص نیاز داریم و لازم است دقیقاً بدانیم که شاخص قیمت تولیدکننده چگونه به شاخص قیمت مصرف‌کننده و سایر شاخص‌ها، از قبیل شاخص‌های قیمت کالاهای صادراتی و وارداتی مربوط می‌شود.

با توجه به اینکه در این گزارش به دنبال بررسی و تحلیل روند تورم مواد غذایی و آشامیدنی در دو بخش تولیدکننده و مصرف‌کننده هستیم، تنها به معرفی و بیان وجوه اشتراک و تمایز دو شاخص قیمت تولیدکننده و مصرف‌کننده و موارد استفاده از آن‌ها بسنده می‌کنیم و در نهایت، مقایسه و تحلیل اعداد محاسبه شده را خواهیم داشت.

### تعاریف و مفاهیم:

شاخص قیمت تولیدکننده (PPI): معیاری برای اندازه‌گیری تغییرات در میانگین قیمت دریافت شده توسط تولیدکنندگان، به ازای تولید کالا و خدمات در داخل کشور، نسبت به یک دوره زمانی معین (سال پایه) می‌باشد.

شاخص قیمت مصرف‌کننده (CPI): معیاری برای اندازه‌گیری تغییرات در میانگین قیمت تعداد معین و ثابتی از کالاها و خدمات مورد مصرف خانوار نسبت به سال پایه می‌باشد.

هر دو این شاخص‌های قیمت، ابزار کلیدی اندازه‌گیری تغییرات قیمتی هستند که به تورم منجر می‌شود. در فرآیند محاسبه متغیرهای کلان اقتصادی دو اصل برای ارزش‌گذاری وجود دارد، یکی برای تولیدکنندگان کالاها و خدمات و دیگری برای مصرف‌کنندگان کالاها و خدمات. معاملات کالاها و خدمات برای تولیدکنندگان به قیمت‌های پایه ارزش‌گذاری می‌شود. قیمت پایه، قیمت هر واحد کالا یا خدمت قابل دریافت توسط تولیدکننده است. با توجه به اینکه مالیات بر محصولات به تولیدکننده تعلق نمی‌گیرد (مالیات به دولت تعلق می‌گیرد و برای تولیدکننده عایدی حاصل نمی‌کند)، اما یارانه محصولات (در صورت وجود) به وی تعلق می‌گیرد، مالیات بر محصولات از قیمت پایه

حذف و یارانه محصولات در آن منظور می‌شود. هزینه‌های مربوط به حمل و نقل و بیمه نیز به همان دلیل مذکور در قیمت مورد استفاده در محاسبه شاخص قیمت تولیدکننده لحاظ نخواهد شد. در عوض، چون مصرف‌کننده در هنگام خرید تمام این هزینه‌ها را می‌پردازد، خریدهای مصرف‌کننده به قیمت خریدار ارزش‌گذاری می‌شود که در آن خالص مالیات منهای یارانه بر محصولات و افزوده‌های مربوط به خدمات حمل و نقل، بیمه و هزینه‌های دلالی و واسطه‌گری بر قیمت پایه افزوده می‌شود.

در نهایت، با توضیحاتی که ارائه شد، باید بگوییم که با دستیابی به یک شناخت لازم در خصوص شاخص‌های قیمت که به اجمال بیان شد، می‌توان نتیجه گرفت که شاخص‌های قیمت تولیدکننده و مصرف‌کننده نشانگرهای اقتصادی مهمی بوده و ابزار محاسبه تورم در دو بخش تولیدکننده و مصرف‌کننده را در اختیار ما قرار می‌دهند.

### پوشش جغرافیایی و فعالیتی:

شاخص‌های قیمت را می‌توان برحسب رشته‌های مختلف کسب و کار شامل بخش‌های مختلف اقتصادی، فعالیت‌ها، گروه‌های اصلی، اختصاصی و کالایی و محصول و همچنین برحسب محدوده‌های جغرافیایی متفاوت تعریف و محاسبه کرد.

شاخص قیمت تولیدکننده در مرکز آمار ایران در سطح جغرافیایی کل کشور و در سطوح تفصیلی رشته فعالیت‌های اقتصادی در بخش‌های کشاورزی، صنعت، معدن، تولید برق و خدمات تهیه و منتشر می‌شود.

شاخص قیمت مصرف‌کننده در سطوح تفکیکی متنوع‌تری، به لحاظ جغرافیایی، شامل تفکیک شهری، روستایی و کل کشور و همچنین به تفکیک استان‌ها تولید و منتشر می‌شود. همچنین این شاخص برای دو گروه کالایی اصلی شامل گروه خوراکی‌ها، آشامیدنی‌ها و دخانیات و گروه کالاهای غیرخوراکی و خدمات و سطوح تفصیلی تر آن تهیه و منتشر می‌شود.

صاحبان کسب و کار و پژوهشگران در حوزه بررسی محصولات و بازارهای خاص می‌توانند با استفاده از شاخص‌های قیمت تولید شده در سطوح تفصیلی تر به اطلاعات سودمند و مناسب‌تری نسبت به شاخص‌های کل دست یابند و تغییرات قیمت را در حوزه فعالیتی خود را با شاخص‌های سرجمع یا رشته فعالیت خاص خود مقایسه و تطبیق دهند. این بررسی‌ها درک بالایی از بازارهای خاص و مختلف و روابط و پیوندهای متقابل بین آن‌ها در اختیارشان قرار خواهد داد. در مقایسه تورم و شاخص‌های قیمت اصلی، فرضاً در دو بازار تولیدکننده و مصرف‌کننده، می‌توان با ردیابی مسیر حرکت قیمت‌ها در بازار دیگر، میزان و فاصله زمانی انتقال تورم بین بازارها و فشارهایی که به حاشیه سود تولیدکنندگان، توزیع‌کنندگان و فروشندگان وارد می‌شود اطلاعات کسب کرد.

### ارتباط تورم تولیدکننده و مصرف‌کننده:

در خصوص چگونگی رابطه میان تورم تولیدکننده و تورم مصرف‌کننده، نگرش‌های متفاوتی وجود دارد. نگرش اول به طرف عرضه توجه دارد و تغییرات در هزینه‌های تولید را عامل تغییرات در قیمت‌های نهایی

( قیمتی که کالا با آن به دست مصرف‌کننده می‌رسد) می‌داند. بر اساس این نگرش بررسی شاخص قیمت تولیدکننده در طول زمان اطلاعات مفیدی را در خصوص پیش‌بینی شاخص قیمت مصرف‌کننده ارائه می‌دهد.

نگرش دوم به طرف تقاضای کالاها و خدمات توجه دارد و تغییرات در تقاضا را عامل تغییرات در قیمت نهایی کالاها و خدمات و به تبع آن تغییرات آتی در قیمت تولیدکننده می‌داند.

نگرش سوم به هر دو اثرات طرف‌های عرضه و تقاضا به طور همزمان توجه داشته و رابطه دو طرفه در شاخص‌ها را مورد بررسی قرار می‌دهد. بررسی این روابط نیازمند تحلیل‌های آماری از نوع اقتصادسنجی هست.

در ادبیات اقتصادی نگرش طرف عرضه، از شاخص قیمت تولیدکننده به عنوان یک شاخص پیش‌ران یا پیش‌نگر (Leading Indicator) یاد می‌شود. به این معنی که هر افزایش یا کاهش قیمت در شاخص قیمت تولیدکننده با وقفه زمانی (یا گاهی همزمان) در شاخص قیمت مصرف‌کننده نیز مشاهده می‌شود. بنابراین، از تغییرات شاخص قیمت تولیدکننده می‌توان به عنوان ابزاری برای پیش‌بینی تورم استفاده نمود.

تغییرات متفاوت شاخص قیمت تولیدکننده و شاخص قیمت مصرف‌کننده نشان‌دهنده تغییرات متفاوت قیمت در هر یک از این بازارهاست. در صورتیکه بین بازارهای مختلف ارتباطی در انتقال قیمت‌ها وجود داشته باشد می‌توان روند آتی یک شاخص را با توجه به روند شاخص یا شاخص‌های دیگر تخمین زد و آثار شوک‌های این قیمت‌ها را بر یکدیگر در طول زمان بررسی نمود.

با توجه به این ارتباطات موجود بین بازارها، تولیدکنندگان به منظور حفظ حاشیه سود، تورم ناشی از فشار هزینه‌ها و افزایش هزینه‌های تولید را به مصرف‌کنندگان منتقل می‌کنند. البته این انتقال قیمت ممکن است با وقفه همراه باشد و قیمت‌های مصرف‌کننده در فواصل زمانی مختلف بسته به استراتژی قیمت‌گذاری تولیدکننده و شرایط بازار تعدیل می‌شوند.

میزان ارتباط بین این دو شاخص به رفتار فروشندگان، تولیدکنندگان، خریداران و ساختار خاص اقتصادی یک کشور بستگی دارد. درجه رقابتی بودن بازار و بالا بودن شرایط رقابتی در بازار خرده‌فروشی باعث انتقال کمتر افزایش قیمت‌ها از بازار تولیدکننده به بازار مصرف‌کننده می‌شود.

ذکر این نکته ضروری است که برای بررسی میزان پیشگویی و محاسبه زمان مورد نیاز برای انتقال قیمت (تاخیر)، استفاده از اطلاعات در بازه زمانی کوتاه‌مدت (ماهانه یا فصلی) می‌تواند مفید واقع شود. استفاده از ابزارهای موجود در برنامه‌های آماری و اقتصادسنجی در دستیابی به یک جواب دقیق و درست، بسیار راه‌گشا هستند. در این تحقیق بررسی‌ها در بلندمدت و در بازه‌های سالانه مورد منظور بوده و با استفاده از دو نوع شاخص قیمت تولیدکننده و مصرف‌کننده که در مرکز آمار ایران محاسبه می‌شود، به دنبال

بررسی میزان همخوانی و هماهنگی بازارها هستیم. در تحلیل بلندمدت مقایسه تورم تولیدکننده و تورم مصرف کننده، ما عموماً شاهد رفتار یکسان در هر دو بخش هستیم.

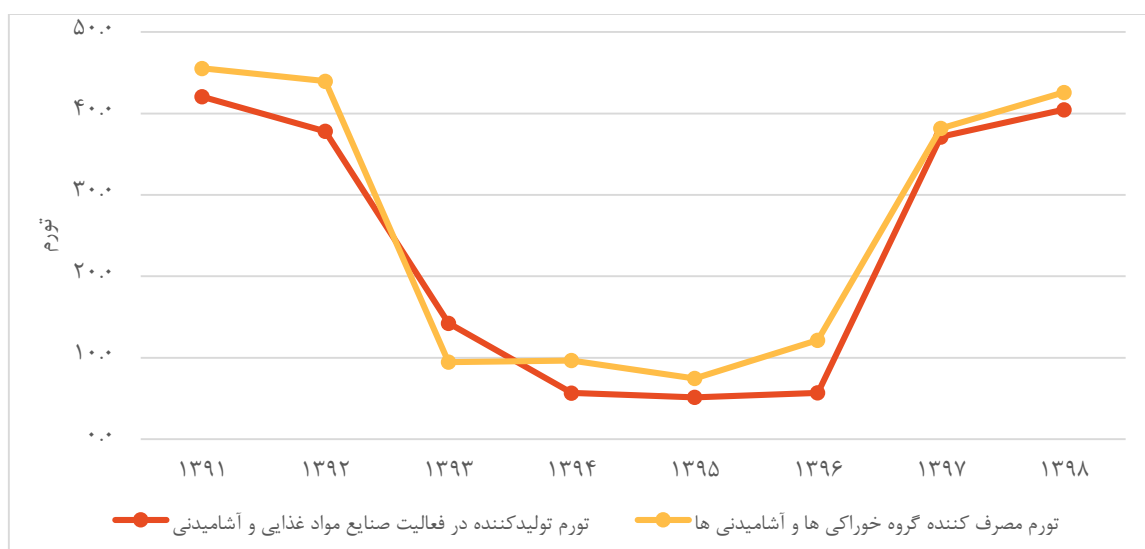
### تحلیل روند بلندمدت تورم در دو بخش تولیدکننده و مصرف کننده:

با توجه به تفاوت‌های ماهوی دو نوع قیمت که به تفصیل توضیح داده شد و اینکه در شاخص قیمت مصرف کننده کالاهای وارداتی مورد مصرف خانوار نیز در محاسبات وارد می‌شود، بررسی‌ها و تطابق‌ها در نگاه اول مبهم و شاید در مواردی ناهماهنگ باشد.

در ادامه این گزارش، به بررسی همبستگی تورم در دو بخش مصرف کننده و تولیدکننده در برخی از گروه‌های کالایی مربوط به مواد غذایی می‌پردازیم. بازه زمانی مورد بررسی شامل اطلاعات سالانه بوده و تحلیل‌ها به رفتار تقریباً یکسان تورم تولیدکننده و مصرف کننده در بلند مدت اشاره دارد.<sup>۱</sup>

رشته فعالیت صنایع مواد غذایی و آشامیدنی یکی از فعالیت‌های بخش صنعت بوده و شامل ۱۶۰ محصول صنعتی می‌باشد. گروه خوراکی‌ها و آشامیدنی‌ها شامل ۱۳۷ قلم در محاسبه شاخص قیمت مصرف کننده دارد. این دو گروه حدود ۷۰ قلم مشترک دارند. هم‌پوشانی سایر اقلام خوراکی شاخص قیمت مصرف کننده با اقلام شاخص قیمت تولیدکننده بخش کشاورزی زیاد است. به منظور مقایسه روند حرکت و میزان همخوانی مسیر حرکت این دو شاخص از میانگین تورم سالانه تولیدکننده و مصرف کننده در گروه‌های کالایی موجود در بخش‌های صنعت و کشاورزی استفاده شده است.

نمودار ۱: مقایسه تورم تولیدکننده صنایع مواد غذایی و آشامیدنی با تورم مصرف کننده گروه خوراکی‌ها و آشامیدنی‌ها

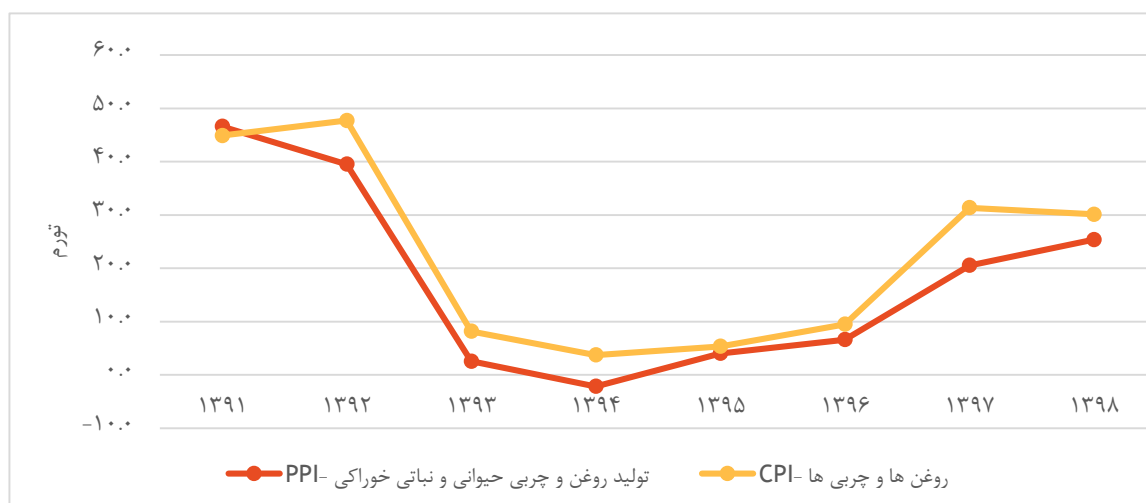


<sup>۱</sup> در تهیه این گزارش از اطلاعات منتشر شده در سایت مرکز آمار ایران ([www.amar.org.ir](http://www.amar.org.ir)) استفاده شده است.

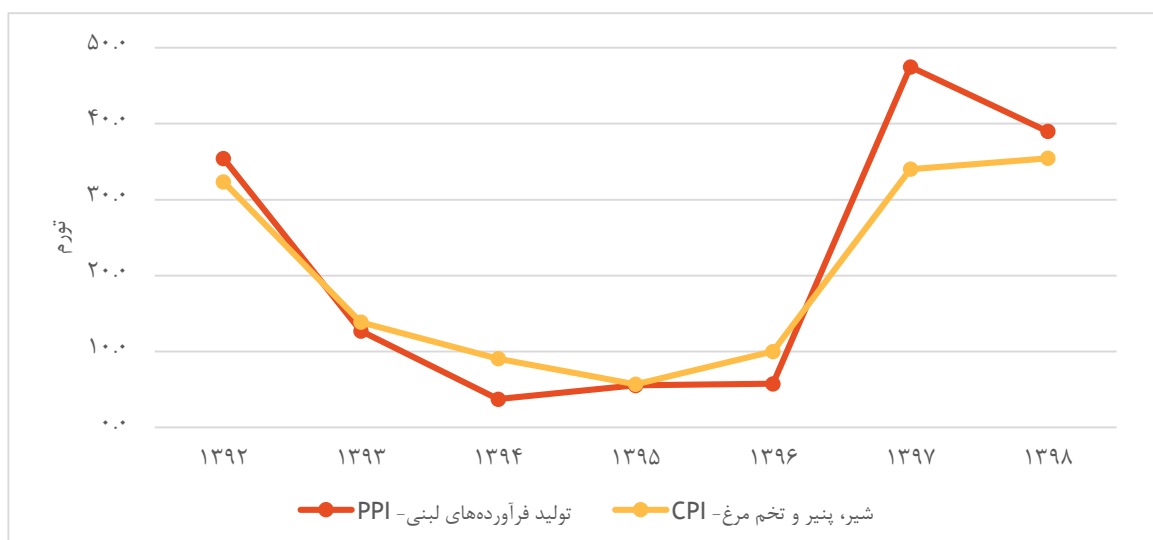
همانطور که در نمودار ۱ مشاهده می‌شود، به دلیل وجود اقلام مشترک بسیار در اطلاعات مورد استفاده در محاسبه تورم دو گروه مورد مقایسه و نیز استفاده از اطلاعات سالانه، رابطه بین دو تورم بسیار مستقیم و همزمان در بازه زمانی ۱۳۹۱-۱۳۹۸ اتفاق افتاده است. در بازه مورد بررسی، به غیر از سال ۱۳۹۳، همواره تورم بخش مصرفی بیشتر از تورم بخش تولیدی بوده است. دلایل این اختلاف را باید در تفاوت‌های ماهوی دو قیمت، ساختار بازارهای اقتصاد کشور، تغییرات در مارژهای واسطه‌گری و حمل و نقل (حاشیه سود دلالی و حمل و نقل)، اثر مستقیم تغییرات نرخ ارز (که در قیمت کالاهای وارداتی تاثیر دارد) سهم کالاهای وارداتی از بازار بخش مصرفی و همچنین یارانه‌هایی که به بخش‌های تولیدی پرداخت می‌شود، جستجو کرد.

همبستگی و همزمانی روند تغییرات تورم را در گروه‌های تفصیلی‌تر، به دلیل بیشتر بودن تعداد اقلام مشترک، بهتر می‌توان مشاهده کرد. همانطور که در نمودارهای زیر نشان داده شده است، جهت و شدت هم حرکتی در برخی گروه‌های کالایی بسیار بالا می‌باشد.

نمودار ۲: مقایسه تورم تولیدکننده روغن و چربی حیوانی و نباتی با تورم مصرف‌کننده گروه روغن‌ها و چربی‌ها

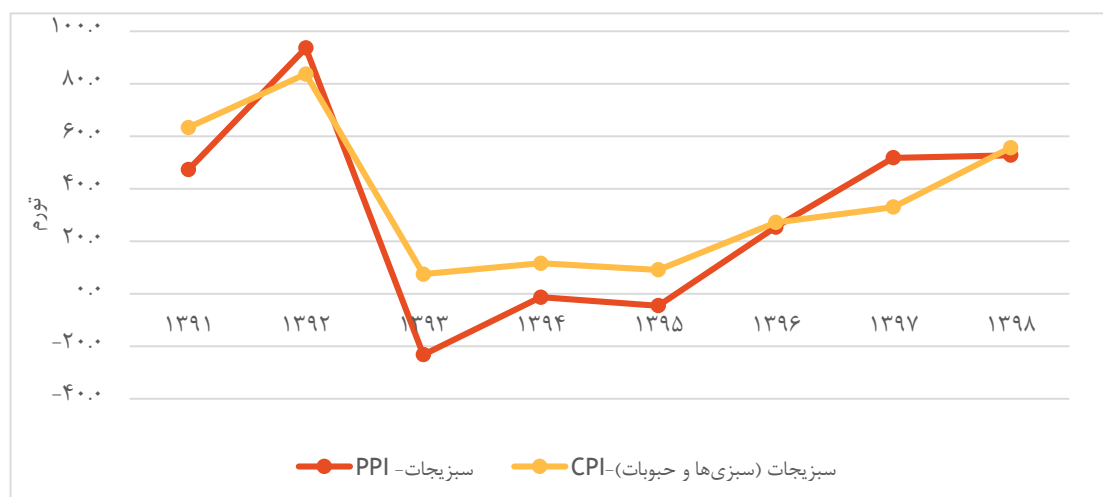


نمودار ۳: مقایسه تورم تولیدکننده فرآورده‌های لبنی با تورم مصرف‌کننده شیر، پنیر و تخم مرغ

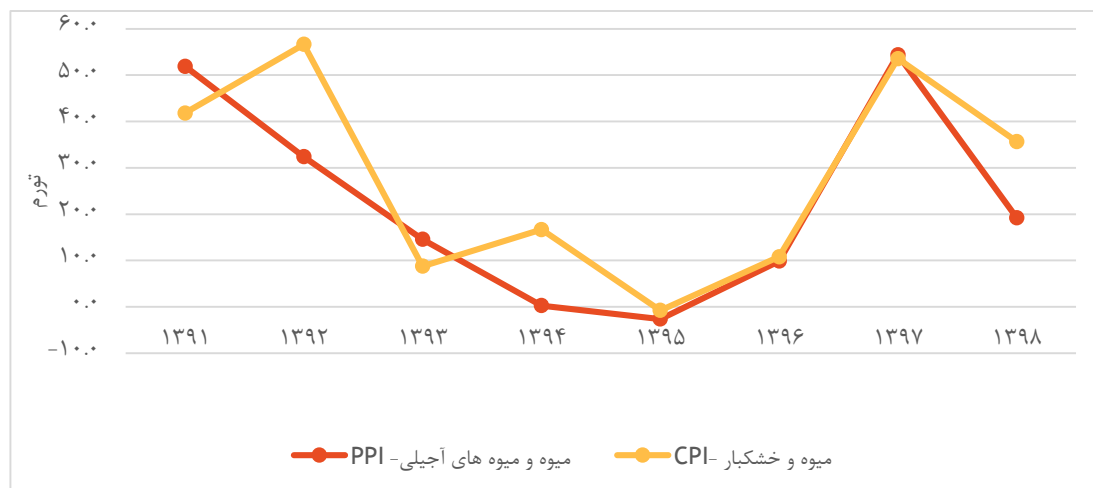


در نمودار ۳ می‌بینیم که در سال ۱۳۹۷ افزایش قیمت‌ها در بخش تولید بسیار پرشتاب‌تر از بخش مصرفی است. با توجه به ماهیت اقلام مورد مقایسه و قابل توجه بودن سهم کالاهای تولید داخل در بخش مصرفی، علت اختلاف به حمایت از بخش مصرفی جهت جلوگیری از کاهش تقاضا برای فرآورده‌های لبنی، تشدید نظارت بر قیمت‌گذاری‌ها در بخش مصرفی و کاهش حاشیه سود تولیدکنندگان اشاره دارد.

نمودار ۴: مقایسه تورم تولیدکننده سبزیجات با تورم مصرف‌کننده سبزیجات



نمودار ۵: مقایسه تورم تولیدکننده میوه و میوه‌های آجیلی با تورم مصرف‌کننده میوه و خشکبار

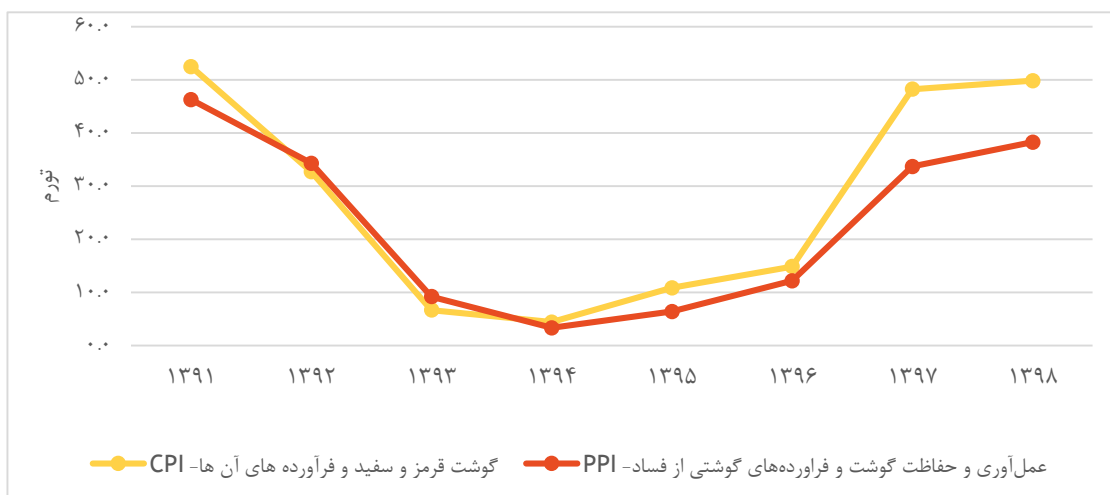


همانطور که در نمودار ۵ مشاهده می‌شود، متوسط تورم دو گروه کالایی مشابه از سال ۱۳۹۱ تا سال ۱۳۹۴ مثبت بوده است ولی شتاب افزایش قیمت‌ها در شاخص قیمت تولیدکننده میوه و میوه‌های آجیلی با کاهش بسیار بالایی همراه است. در بخش مصرف‌کننده شتاب افزایش قیمت‌ها روند نزولی پرنوسانی را در بازه ذکر شده دنبال می‌کند. افزایش نرخ ارز در سال ۱۳۹۱ باعث شده است تا در سال ۱۳۹۲ همچنان در بخش مصرفی، به دلیل وجود اقلام وارداتی، تمایل بازار به کاهش شتاب افزایش قیمت‌ها را نداشته باشیم. مفهوم عبور نرخ ارز که به زمان بر بودن فرآیند تخلیه

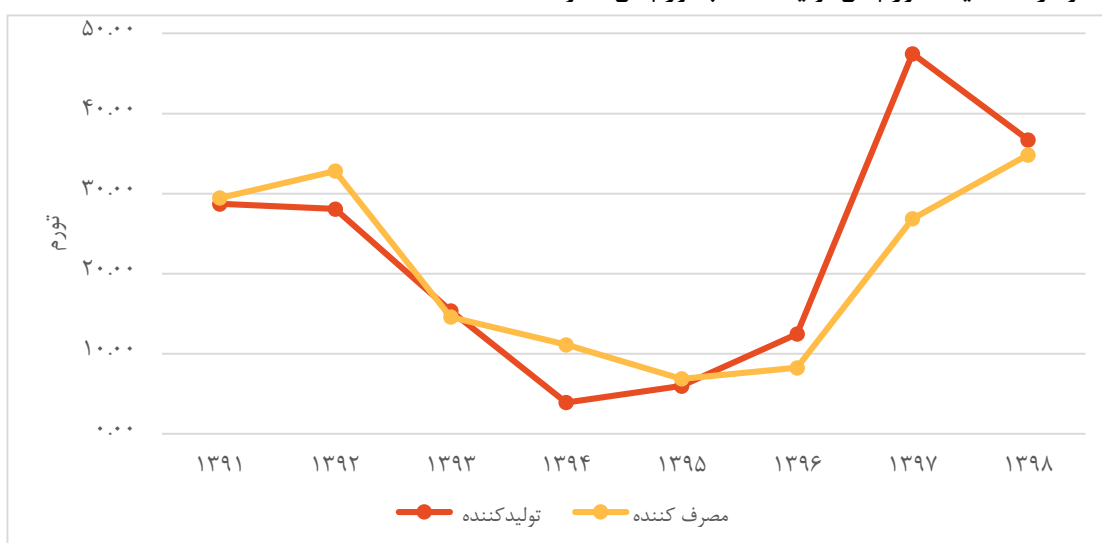


اثرات تغییرات در نرخ ارز تاکید دارد، موکد این مطلب است. از طرفی افزایش صادرات این اقلام، به دلیل افزایش نرخ ارز، نیز می‌تواند دلیل عدم هماهنگی بین تغییرات تورم را در دو بخش مصرفی و تولیدی باشد.

نمودار ۶: مقایسه تورم تولیدکننده پرورش حیوانات و عمل‌آوری و حفاظت گوشت و فرآورده‌های گوشتی با تورم مصرف‌کننده گوشت قرمز و سفید و فرآورده‌های آن



نمودار ۷: مقایسه تورم کل تولیدکننده با تورم کل مصرف‌کننده



در مقایسه نمودار ۷ با نمودارهای قبل که در سطوح گروه کالایی تفصیلی تر ارائه شده‌اند، می‌توان مشاهده کرد هر چند رفتار دو تورم در بلندمدت تقریباً یکسان هست اما شکاف بین تورم تولیدکننده و تورم مصرف‌کننده در زیرگروه‌ها کمتر از شکاف تورمی موجود بین تورم کل تولیدکننده و تورم کل مصرف‌کننده است. در محاسبه تورم کل تولیدکننده و تورم کل مصرف‌کننده کالاها و خدمات متنوع و بسیاری مورد قیمت‌گیری قرار می‌گیرند که تغییرات در قیمت‌ها و انتقال این تغییرات به بازارهای دیگر می‌تواند با تاخیر در بین سال‌های متوالی همراه باشد.

## نتیجه‌گیری:

مکانیسم رفتار تورم تولیدکننده و تورم مصرف‌کننده، در حالت‌های مختلف زمانی کوتاه‌مدت و بلندمدت و همچنین در سطوح سرجمع یا تفصیلی شاخص‌های محاسبه شده، می‌تواند مورد بررسی قرار گیرد. بررسی منحنی‌های تورم در بلندمدت در گروه‌های بسیار تفصیلی و با سهم اشتراک بالای اقلام در دو گروه تولیدکننده و مصرف‌کننده، نشان از روند تقریباً یکسان تغییرات و هم‌جهت بودن این تغییرات به صورت همزمان دارد. به عبارتی رفتار تورم تولیدکننده و تورم مصرف‌کننده در بلندمدت برای گروه‌های کالایی با همپوشانی بسیار بالا و مشابه تا اندازه زیادی یکسان است. همخوانی نتایج حاصل از اجرای دو طرح متفاوت در مرکز آمار ایران برای محاسبه شاخص قیمت تولیدکننده و شاخص قیمت مصرف‌کننده می‌تواند گواه مقبولی از جامعیت و واقع‌گویی اعداد باشد.