

پژوهشکده پولی و بانکی  
بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران



# گزارش ماهانه پیش بینی تورم

آبان ماه ۱۳۹۳

MBRI-PR-93022

گزارش ادواری

آذر ۹۳

[www.mbri.ac.ir](http://www.mbri.ac.ir)



پژوهشکده پولی و بانکی  
بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران

پژوهشکده پولی و بانکی

بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران

تهران: میدان آرژانتین، ابتدای بزرگراه آفریقا، پلاک ۱۰

کدپستی: ۱۵۱۴۹۴۷۱۱۱ صندوق پستی: ۷۹۴۹-۱۵۸۷۵

[www.mbri.ac.ir](http://www.mbri.ac.ir)

- دیدگاه و نظرات ارائه شده در این مقاله متعلق به نویسندگان بوده و لزوماً نظر پژوهشکده پولی و بانکی را منعکس نمی کند.
- کلیه حقوق مادی و معنوی این اثر متعلق به پژوهشکده پولی و بانکی می باشد، لیکن استفاده از نتایج این مقاله با ذکر منبع بلامانع است.



## گزارش ماهانه پیش بینی تورم آبان ماه ۱۳۹۳

در تهیه این شماره از گزارش، شاخص قیمت تولیدکننده، ۱۲ گروه اصلی شاخص قیمت مصرف‌کننده، متغیرهای مربوط به ۸ گروه اصلی شاخص قیمت تولیدکننده، قیمت سکه، نرخ ارز (دلار) در بازار آزاد، نوسانات نرخ ارز (دلار) در بازار آزاد<sup>۱</sup>، پایه پولی، حجم پول و نقدینگی به عنوان متغیرهایی که برای پیش‌بینی تورم حاوی اطلاعات هستند در جعبه ابزار پیش‌بینی تورم مورد استفاده قرار گرفته است. داده‌های مذکور با تواتر ماهانه از ۱۳۶۹:۱ تا ۱۳۹۳:۷ مورد استفاده قرار گرفته‌اند.<sup>۲</sup> همچنین با استفاده از دو متغیر مجازی، اثرات اجرای فازهای اول و دوم هدفمندی یارانه‌ها و همچنین تغییر پارادایم دولت یازدهم کنترل شده است.

در این گزارش، اثرات فصلی تورم حذف شده و آنچه که پیش‌بینی می‌شود تورم فصلی‌زدایی شده است. با این هدف که پیش‌بینی دقیق‌تری از تورم ارائه شود، نتایج حاصل از ۵۱۲ پیش‌بینی که با مدل‌ها و ترکیبات مختلف متغیرهای توضیح دهنده تولید شده‌اند، باهم ترکیب می‌شوند.

۱- منظور از نوسانات ارز، انحراف معیار نرخ ارز (دلار) روزانه در بازار آزاد است.

۲- آمارهای مربوط به کل‌های پولی در بازه زمانی ماه اول ۱۳۶۹ تا خرداد ۱۳۹۳ مورد استفاده قرار گرفته است.



## فهرست گزارش‌های پژوهشی

عنوان	کد گزارش	نویسنده / نویسندگان
<b>گزارش‌های پژوهشی در سال ۱۳۹۳</b>		
گزارش فصلی تولید صنعتی ایران (تابستان ۱۳۹۳)	MBRI-PR-93021	سجاد ابراهیمی
شکست بازار اعتبارات	MBRI-PP-93020	فرهاد نیلی و امینه محمودزاده
سیستم حسابه‌های ادغام شده محیط زیستی و اقتصادی ایران (حساب اقماری محیط زیست ایران (SEEAIRAN))	MBRI-RR-93019	ابوالفضل خاوری نژاد
بررسی اثرات دور اول و دوم تحولات اقتصاد کلان بر ترازنامه بانک‌ها	MBRI-PN-93018	هادی حیدری
گواهی سپرده مدت‌دار سرمایه‌گذاری خاص: کاستی‌ها و راه‌حل‌ها	MBRI-PN-93017	رسول خوانساری، ماندانا طاهری، حمید زمان‌زاده
پیش‌بینی تورم ایران با استفاده از منحنی فیلیپس	MBRI-WP-93016	سید مهدی برکچیان، سعید بیات، هومن کرمی
چرخه‌های تجاری و اعتباری	MBRI-PP-93015	فرهاد نیلی و امینه محمودزاده
ارتباط پول و قیمت: با تمرکز بر اجزای شاخص قیمت مصرف‌کننده	MBRI-PP-93014	رامین مجاب
ارزیابی پویایی صنعت بانکداری ایران با تأکید بر رقابت‌پذیری	MBRI-PN-93013	اعظم احمدیان
هدف‌گذاری تورم؛ لزوم اعمال و پیش‌شرط‌های اساسی	MBRI-PN-93012	ایلناز ابراهیمی
ضرورت بازسازی چارچوب ارتباطی بانک مرکزی	MBRI-PP-93011	مریم همتی
کنترل اثرات ناپایداری و شکست ساختاری تورم با مدل‌های غیرخطی و زمان‌متغیر	MBRI-WP-93010	سید مهدی برکچیان، سعید بیات، هومن کرمی
راهکاری در جهت تقویت رعایت اصول شریعت در قراردادهای بانکی	MBRI-PN-93009	وهاب قلیچ و فرشته ملاکریمی
ارزیابی سرمایه بانک‌ها بر اساس استانداردهای بین‌المللی	MBRI-PN-93008	زهرا خوشنود و مرضیه اسفندیاری
پیش‌بینی تورم ایران با استفاده از عوامل مشترک اجزای شاخص قیمت کالاها و خدمات	MBRI-WP-93007	سید مهدی برکچیان، سعید بیات، هومن کرمی
وضعیت صنایع در دوره‌های رونق و رکود	MBRI-PN-93006	مجید عینیان
ارزیابی وضعیت مطالبات غیرجاری در نظام بانکی ایران و مقایسه آن با سایر کشورها	MBRI-PN-93005	لیلا محرابی
معرفی روش‌های تأمین مالی اسلامی در کشورهای مختلف	MBRI-PN-93004	لیلا محرابی
سپر سرمایه مخالف چرخه سندی از جمله اسناد توافق‌نامه سرمایه‌بال سه	MBRI-PP-93003	زهرا خوشنود
آسیب‌شناسی بازار بین‌بانکی ربالی در ایران با تأکید بر ابعاد فقهی	MBRI-PP-93002	رسول خوانساری
اثر پسماند جانشینی پول در ایران	MBRI-RR-93001	سامان قادری
<b>گزارش‌های پژوهشی در سال ۱۳۹۲</b>		
ضرورت بازسازی چارچوب ارتباطی بانک مرکزی	MBRI-9228	مریم همتی
استقلال بانک مرکزی؛ گام نخست در پیشبرد اهداف سیاست‌گذاری پولی	MBRI-9227	مریم همتی
تأثیر نوسانات متغیرهای کلان اقتصادی بر مطالبات غیرجاری بخش بانکی؛ رهیافت اقتصادسنجی	MBRI-9226	حامد عادل نیک
اثرات پویای حجم کل بدهی‌ها بر بخش واقعی اقتصاد ایران (۱۳۶۰-۱۳۹۰) و ارزیابی آن به عنوان سازوکار هشداردهنده وقوع بحران مالی	MBRI-9225	احمدعلی رضایی
ارزیابی عملکرد بانک‌ها در سید داری، بدهی، سود و زیان در سال‌های ۱۳۹۱-۱۳۹۲	MBRI-9224	اعظم احمدیان
تحلیل سهم از بازار بانک‌ها (۱۳۹۰-۱۳۹۱)	MBRI-9223	اعظم احمدیان
ارزیابی شاخص‌های سلامت بانکی، در بانک‌های ایران (۱۳۹۰-۱۳۹۱)	MBRI-9222	اعظم احمدیان
تجربه بانک‌های توسعه‌ای در بحران اقتصادی جهان و تحولات پس‌انداز و سرمایه‌گذاری در اقتصاد جهانی	MBRI-9221	لیلا محرابی
وضعیت آماری موسسات مالی اسلامی برتر در جهان (با تأکید بر نقش بانک‌های ایرانی)	MBRI-9220	وهاب قلیچ، لیلا محرابی
پایداری تورم و عوامل موثر بر آن در اقتصاد ایران	MBRI-9219	حجت تقی‌لو
مالیات تورمی در ترازوی عدالت	MBRI-9217	دکتر محمداسماعیل توسلی و وهاب قلیچ
مدیریت ثروت اسلامی	MBRI-9216	رسول خوانساری، رضا یارمحمدی
بررسی دیدگاه‌های فقهی پیرامون مسأله جبران کاهش ارزش پول	MBRI-9215	فرشته ملاکریمی
تحلیل عاملی نسبت‌های مالی بنگاه‌های صنعتی پذیرفته‌شده در بورس اوراق بهادار تهران	MBRI-9214	ماندانا طاهری، فرهاد نیلی
صکوک کوتاه‌مدت و کاربردهای آن در بانکداری و مالی اسلامی	MBRI-9213	رسول خوانساری، حسین میسمی، لیلا محرابی
جعبه ابزار پیش‌بینی تورم در اقتصاد ایران	MBRI-9212	سید مهدی برکچیان، سعید بیات، هومن کرمی
محاسبه سود قطعی سپرده‌گذاران در بانکداری بدون ربا	MBRI-9211	حسین میسمی
ارزیابی عملکرد صنعت بانکداری در ایران (مقایسه سال‌های ۱۳۸۹ و ۱۳۹۰)	MBRI-9210	اعظم احمدیان
نگاهی به چارچوب قانونی، نهادی و نظارتی ورشکستگی بانک	MBRI-9209	حمید قنبری



پژوهشکده پولی و بانکی  
بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران

نویسنده / نویسندگان	کد گزارش	عنوان
اعظم احمدیان	MBRI-9208	تحلیل شاخص‌های عملکرد شبکه بانکی در تأمین مالی تولید
مصعب عبدالهی آرانی	MBRI-9207	بسترهای تشکیل منطقه بهینه پولی بین کشورهای سازمان همکاری اقتصادی (اگو)
حسین میسمی	MBRI-9206	حاکمیت شرکتی، نظارت و مقررات احتیاطی در موسسات مالی اسلامی: گزارش پنجمین روز مدرسه زمستانه بانکداری اسلامی
وهاب قلیچ	MBRI-9205	استانداردهای حسابداری و حسابرسی در موسسات مالی اسلامی: گزارش چهارمین روز مدرسه زمستانه بانکداری اسلامی
لیلا محرابی	MBRI-9204	مدیریت دارایی و بدهی در بانک‌های اسلامی: گزارش سومین روز مدرسه زمستانه بانکداری اسلامی
رسول خوانساری	MBRI-9203	مدیریت ریسک در بانک‌های اسلامی: گزارش دومین روز مدرسه زمستانه بانکداری اسلامی
فرشته ملاکریمی	MBRI-9202	اصول و مقررات شرعی در معاملات و تأمین مالی: گزارش اولین روز مدرسه زمستانه بانکداری اسلامی
حسین میسمی	MBRI-9201	تورم و جبران کاهش ارزش پول از دیدگاه اسلامی: گزارش هفتمین جلسه نقد پژوهش‌های بانکداری و مالی اسلامی
<b>گزارش‌های پژوهشی در سال ۱۳۹۱</b>		
حسین میسمی	MBRI-9111	پولی کردن کسری بودجه از منظر اقتصاد اسلامی: گزارش ششمین جلسه نقد پژوهش‌های بانکداری و مالی اسلامی
فرشته ملاکریمی	MBRI-9110	مجموعه روایات ربا(بخش اول)
فرشته ملاکریمی	MBRI-9109	بررسی فقهی و حقوقی وثایق بانکی
فرهاد نیلی و مرضیه اسفندیاری	MBRI-9108	عوامل مؤثر بر استفاده خانوارهای شهری از انواع خدمات مالی
زهره خوشنود	MBRI-9107	ضرورت معرفی رهنمود جدیدی در مدیریت ریسک نقدینگی با توجه به تحولات سیستم مالی در ایران
لیلا محرابی	MBRI-9106	ساختار بانکداری اسلامی در کشورهای اسلامی: نمونه موردی کشور مالزی
حسین میسمی	MBRI-9105	مفهوم‌شناسی ربا و بهره
وهاب قلیچ	MBRI-9104	تورق چیست؟
لیلا محرابی	MBRI-9103	چشم‌انداز اقتصاد اسلامی بر بحران مالی جهانی
لیلا محرابی	MBRI-9102	وضعیت بانکداری اسلامی در کشورهای منطقه MENA
ایلناز ابراهیمی	MBRI-9101	بحران یورو؛ ریشه‌های پیدایش و سناریوهای آینده
<b>گزارش‌های پژوهشی در سال ۱۳۹۰</b>		
حسین قضاوی، حسین بازمحمدی	MBRI-9008	عملیات بازار باز در چارچوب بانکداری بدون ربا (تابستان ۱۳۹۰)
فرهاد نیلی	MBRI-9007	کتاب‌شناسی اقتصاد ریاضی (پاییز ۱۳۹۰)
سید صفدر حسینی	MBRI-9006	بر آورد قدرت بازاری در شبکه بانک‌های دولتی ایران (بهار ۱۳۹۰)
ابوالفضل اکرمی، پیمان قربانی	MBRI-9005	جنبه‌های اساسی تغییر واحد پول ملی؛ تجربه ونزوئلا (تابستان ۱۳۹۰)
حسین معصومی، محمد روشن‌دل	MBRI-9004	اصول اساسی اثربخشی نظام‌های بیمه سپرده (تابستان ۱۳۹۰)
زهره سلطانی، زهره خوشنود، طاهره اکبری آلاشتی	MBRI-9003	ساز و کارهای تأمین مالی شرکت‌های کوچک و متوسط (بهار ۱۳۹۰)
وهاب قلیچ	MBRI-9002	بانکداری اخلاقی در جهان (بهار ۱۳۹۰)
حسین قضاوی	MBRI-9001	مالیات تورمی دلار (بهار ۱۳۹۰)
<b>گزارش‌های پژوهشی در سال ۱۳۸۹</b>		
علی حسن‌زاده، اعظم احمدیان	MBRI-8911	بورس اوراق بهادار در ایران و برخی کشورهای منتخب
امیر حسین امین آزاد، حسین معصومی	MBRI-8910	قانون بانک مرکزی فدراسیون روسیه
مهدی منجمی	MBRI-8909	سیاست‌های پولی و قیمت نفت
هادی حیدری، زهرا زواریان، ایمان نوربخش	MBRI-8908	مدیریت نقدینگی و جوه نقد صندوق شعب با استفاده از مدل انتشار
لیلا محرابی	MBRI-8907	مصوبه تشکیل مراکز خدمات سرمایه‌گذاری استانی
مهشید شاهچرا	MBRI-8906	بررسی برنامه پنجم توسعه کشور
طاهره اکبری آلاشتی	MBRI-8905	آیین‌نامه اجرایی حمایت از صادرکنندگان خدمات فنی و مهندسی
ترانگ بوی، تامیم بایومی، مترجم: سوفی بیگلری	MBRI-8904	اثر خارجی بحران‌های مالی آمریکا و انگلستان بر دیگر نقاط جهان
پرستو شجری	MBRI-8903	نقش یوان در موفقیت تجاری چین
مجید صامتی، سعید دانی کریم زاده، لیلا نیلفروشان	MBRI-8902	ادوار تجاری و آزمون علیت گرنجر
حسین میسمی، محسن عبدالهی، مهدی قائمی‌اصل	MBRI-8901	امکان‌سنجی فقهی-اقتصادی استفاده از نهاد وقف در تأمین مالی خرد اسلامی



پژوهشکده پولی و بانکی

بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران

تهران: میدان آرژانتین، ابتدای بزرگراه آفریقا، پلاک ۱۰  
کدپستی: ۱۵۱۴۹۴۷۱۱۱ صندوق پستی: ۷۹۴۹-۱۵۸۷۵

[www.mbri.ac.ir](http://www.mbri.ac.ir)