

*ЦЫПЛАКОВ А.А. Построение индекса базовой инфляции для России. Москва EERC, 2004 — 36 с*

*В данной работе исследуется возможность построения индекса цен (индекса "базовой инфляции") для России, который бы более подходил для оценки денежной политики, чем индекс потребительских цен. Этот индекс получен применением к российским данным метода усеченного среднего, который рассматривает данные в разрезе определенного момента (cross-section). Мы выяснили, что одномоментные распределения приростов отдельных цен имеют существенно утяжеленные хвосты. В этой ситуации обычное выборочное среднее не является хорошей оценкой центральной тенденции с точки зрения эффективности и робастности. Отсечение 50-100% наблюдений приводит к большому выигрышу в эффективности. Кроме того, показано, что усеченное среднее является менее волатильным чем официальный индекс потребительских цен.*

## СОДЕРЖАНИЕ

<b>ОСНОВНЫЕ ПРЕДПОСЫЛКИ И ВЫВОДЫ</b>	<b>5</b>	
<b>1. КОНЦЕПЦИЯ БАЗОВОЙ ИНФЛЯЦИИ</b>	<b>7</b>	
<b>2. ДАННЫЕ</b>	<b>10</b>	
<b>3. ПОСТРОЕНИЕ ИНДЕКСОВ БАЗОВОЙ ИНФЛЯЦИИ</b>		<b>11</b>
31 Предварительные соображения	11	
32 Подготовка данных	15	
33 Основные вычисления	19	
3 4 Характеристики измерителей базовой инфляции		26
<b>4. ВЫВОДЫ</b>	<b>32</b>	
<b>СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ</b>	<b>35</b>	