

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

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