



ИНФОРМАЦИОННОЕ СООБЩЕНИЕ

3 ноября 2017 года

О публикации экономического исследования «Система селективно-комбинированного прогноза инфляции (SSCIF): выбор оптимальной техники прогнозирования динамики потребительских цен в условиях структурного шока (на примере Казахстана)»

Национальный Банк Республики Казахстан на своем официальном интернет-ресурсе www.nationalbank.kz в разделе «Денежно-кредитная политика» опубликовал экономическое исследование «Система селективно-комбинированного прогноза инфляции (SSCIF): выбор оптимальной техники прогнозирования динамики потребительских цен в условиях структурного шока (на примере Казахстана)».

Согласно полученным результатам, Департамент исследований и статистики Национального Банка Республики Казахстан предлагает модификацию «классической» техники комбинированного прогнозирования (Bates, Granger, 1969) путем развития селективного комбинирования прогнозов инфляции Казахстана. Система селективно-комбинированного прогноза инфляции, или SSCIF – the System of Selective Combined Inflation Forecast применяется в НБРК в качестве основного инструмента краткосрочного прогнозирования инфляционных процессов в Казахстане с октября 2016 года. Данная система стала результатом эволюции множества предыдущих модельных техник предсказания инфляции, которые разрабатывались и применялись НБРК с момента перехода на режим инфляционного таргетирования. SSCIF включает четыре класса моделей (авторегрессия с линейным трендом, случайное блуждание, множественная линейная факторная регрессия и байесовская векторная авторегрессия), 78 переменных и более 200 уравнений. Также SSCIF интегрирована в систему анализа и прогнозирования для принятия решения по денежно-кредитной политике НБРК и применяется как в период проведения прогнозного раунда в блоке краткосрочного прогнозирования инфляции, так и в межпрогнозные периоды. Одним из немаловажных преимуществ SSCIF является возможность построения сценарных прогнозов инфляции, исходя из предположений динамики различных экзогенных факторов, как цена на нефть, номинальный обменный курс тенге, объем денежной массы и др. На основании полученных эмпирических результатов проиллюстрировано преимущество селективного комбинирования в сравнении с «классическим» подходом в части получения более точных и устойчивых вне-выборочных прогнозов инфляции.

Более подробную информацию можно получить по телефону:

+7 (727) 270 45 85

e-mail: press@nationalbank.kz

www.nationalbank.kz