



АҚПАРАТТЫҚ ХАБАР

2017 жылғы 3 қараша

«Инфляцияны болжаудың селективтік-біріктірілген жүйесі (SSCIF): құрылымдық проблемалар жағдайында тұтынушылық бағалардың серпінін болжаудың тиімді техникасын таңдау (Қазақстанның үлгісінде)» экономикалық зерттеуін жариялау туралы

Қазақстан Республикасының Ұлттық Банкі өзінің www.nationalbank.kz ресми интернет-ресурсында «Ақша-кредит саясаты» бөлімінде «Инфляцияны болжаудың селективтік-біріктірілген жүйесі (SSCIF): құрылымдық проблемалар жағдайында тұтынушылық бағалардың серпінін болжаудың тиімді техникасын таңдау (Қазақстанның үлгісінде)» экономикалық зерттеуін жариялады.

Алынған нәтижелерге сәйкес Қазақстан Республикасы Ұлттық Банкінің Зерттеулер және статистика департаменті Қазақстан инфляциясының селективтік біріктірілген болжамдарын дамыту арқылы біріктірілген болжаудың «классикалық» техникасын (Bates, Granger, 1969) түрлендіруді ұсынады. ҚРҰБ инфляцияны селективтік-біріктірілген болжау жүйесін немесе SSCIF – the System of Combined Inflation Forecast-ты Қазақстанда инфляциялық процестерді қысқа мерзімді болжаудың негізгі құралы ретінде 2016 жылғы қазаннан бері қолданып келеді. Бұл жүйе инфляцияға болжам жасаудың алдыңғы көптеген модельдік техникалары эволюциясының нәтижесі болды және ҚРҰБ оны инфляциялық таргеттеу режиміне өткен сәттен бастап қолданды. SSCIF модельдердің төрт класынан (желілік трендті авторегрессия, кездейсоқ адасу, көптеген желілік факторлық регрессия және байес векторлық авторегрессиясы), 78 ауыспалыдан және 200-ден аса теңдеуден тұрады. Сонымен бірге SSCIF ҚРҰБ-ның ақша-кредит саясаты жөнінде шешім қабылдауы үшін талдау және болжау жүйесіне интеграцияланды және инфляцияны қысқа мерзімді болжау блогында болжамдық раунд жүргізу кезеңінде де, болжамаралық кезеңдерде де қолданылады. Мұнай бағасы, теңгенің номиналдық айырбастау бағамы, ақша массасының көлемі және басқалары сияқты түрлі экзогендік факторлар серпінінің болжамдарына қарай инфляцияның сценарийлік болжамдарын құру мүмкіндігі SSCIF-тің маңызды артықшылықтарының бірі болып табылады. Алынған эмпирикалық нәтижелер негізінде инфляцияның неғұрлым дәлме-дәл және орнықты таңдаудан тыс болжамдарын алу бөлігінде «классикалық» тәсілмен салыстырғанда селективтік біріктірудің артықшылығы көрсетілген.

Толығырақ ақпаратты мына телефон бойынша алуға болады:

+7 (727) 270 45 85

e-mail: press@nationalbank.kz

www.nationalbank.kz