

**Помогают ли высокочастотные данные в прогнозировании российской инфляции?**

**Научный руководитель – Фокин Никита Денисович**

*Третьяков Дмитрий Витальевич*

*Студент (бакалавр)*

Российская академия народного хозяйства и государственной службы при Президенте Российской Федерации, Экономический факультет, Москва, Россия

*E-mail: dmtretyakov67@gmail.com*

В связи с тем, что в конце 2014-го года Центральный Банк совершил переход к новому для России режиму монетарной политики - режиму инфляционного таргетирования, задача прогнозирования темпов инфляции стала как никогда актуальной. В новом режиме денежно-кредитной политики Банку России важно, как можно быстрее и точнее оценивать будущие темпы инфляции, чтобы максимально оперативно принимать меры по возвращению инфляции к целевому уровню. Кроме того, для проведения эффективной денежно-кредитной политики, население должно обладать доверием к действиям монетарных властей и осознавать будущую динамику инфляции. Таким образом, Центральному Банку для управления инфляционными ожиданиями экономических агентов необходимо активно использовать информационный канал, публикуя точные прогнозы темпа роста потребительских цен.

Целью данной работы является построение модели для наукастинга, а также краткосрочного прогнозирования темпа российской инфляции с использованием высокочастотных данных. Их использование при построении моделей для прогнозирования весьма перспективно, так как такой подход позволяет использовать на порядок больше информации о динамике макроэкономических показателей. В работе показано, что используемая MIDAS-модель, в которой участвуют ряды недельной частоты по номинальному обменному курсу рубля к доллару, ставке межбанковского кредитования M1ACR, а также ценам на нефть, имеет более точный прогноз месячной инфляции по сравнению с несколькими базовыми моделями, в которых используются лишь низкочастотные, то есть месячные данные.