

Прикладная эконометрика, 2021, т. 64, с. 5–22.

Applied Econometrics, 2021, v. 64, pp. 5–22.

DOI: 10.22394/1993-7601-2021-64-5-22

А. М. Кириллов<sup>1</sup>

## Исследование пространственной автокорреляции: случай российской региональной инфляции

С применением статистики APLE (*approximate profile likelihood estimator*) тестируется гипотеза о существовании пространственной автокорреляции инфляционных процессов в регионах России. Обсуждается использование APLE в качестве альтернативы индексу Морана. Применяемые показатели модифицированы для панельной структуры данных. Используются временные ряды индекса потребительских цен продовольственных, непродовольственных товаров, услуг и совокупной потребительской корзины. Гипотеза о существовании пространственной автокорреляции региональных инфляционных процессов подтверждается на горизонте исследования.

**Ключевые слова:** региональная инфляция; индексы потребительских цен; пространственная автокорреляция; APLE; индекс Морана; регионы России.

**JEL classification:** C21.

### Введение

Инфляция является одной из ключевых тем макроэкономического анализа в силу своего влияния на поведение экономических агентов — работодателей, работников, инвесторов. В первом случае это происходит через затраты на производство, во втором — через реальный доход, реальную заработную плату, а в третьем — через реальную доходность вложений. Влияние инфляции на экономику обычно находится в непосредственном фокусе внимания монетарных властей, а их усилия, направленные на борьбу с инфляцией, стабилизацию ее уровня в пределах умеренных значений и минимизацию последствий реализующихся инфляционных шоков, формируют благоприятную среду для долгосрочного планирования экономическими агентами своей деятельности и принятия решений. Так, большинство центральных банков мира в качестве претворяемой в жизнь кредитно-денежной политики используют инфляционное таргетирование (Юдаева, 2014). Центральный Банк России не является исключением из правил: с 2014 г. он осуществляет таргетирование уровня инфляции, выраженного количественно *индексом потребительских цен* (ИПЦ), в соответствии с целевым значением 4% в годовом выражении.

В отечественной литературе есть две пересекающиеся области, связанные с вопросом инфляции: изучение детерминант инфляционного процесса и его прогнозирование. Например, в работах (Кудрин, 2007, 2009) анализируется историческая динамика инфляции в России

<sup>1</sup> Кириллов Андрей Михайлович — АО «АЛЬФА-БАНК»; akirilov@nes.ru, amkirilov@alfabank.ru