

Аннотации к докладам конференции

“Финансовый рынок в условиях перемен: вызовы, ресурсы, решения”

Секция 2. Макроэкономическое моделирование

Сергей Иващенко, экономический советник, СЗГУ, Банк России; с.н.с. ИПРЭ (РАН) –

Оценка эффекта переноса валютного курса на цены в условиях структурных сдвигов

Структурный разрыв 2022 затронул многие закономерности, однако число наблюдений после него недостаточно для их выявления методами классической эконометрики. Предложен подход на основе BVAR моделей, позволяющий идентифицировать произошедшие изменения. Сделаны обобщения для нелинейных форм BVAR модели. Заметную роль играет мера эффекта переноса и аккуратность учета неопределенности оценок параметров. В среднем эффект переноса для шока валютного курса с учетом косвенных эффектов немного уменьшился, при заметном изменении соотношения прямых и косвенных эффектов.