**Более детальный обзор статей**

1. Stock, J. H., & Watson, M. W. (2007). "Why Has U.S. Inflation Become Harder to Forecast?"
   1. Методы прогнозирования инфляции.   
      В своей работе Сток и Уотсон исследуют, почему прогнозирование инфляции в США стало сложнее в последние десятилетия. Авторы используют традиционные эконометрические модели, такие как ARIMA (авторегрессионные интегрированные модели скользящего среднего) и векторные авторегрессии (VAR), чтобы понять динамику инфляции. Они анализируют временные ряды инфляционных данных, охватывающие несколько десятилетий, и исследуют, как изменения в макроэкономической политике и глобальные экономические шоки повлияли на точность прогнозов. Одним из ключевых методов, примененных в статье, является использование факторных моделей, которые позволяют выделить скрытые факторы, влияющие на инфляцию, из большого количества экономических переменных.
   2. Основные выводы и результаты  
      Основные выводы исследования указывают на то, что традиционные модели прогнозирования стали менее точными из-за увеличения волатильности и непредсказуемости макроэкономической среды. Сток и Уотсон подчеркивают, что точность прогнозов значительно снизилась после 1980-х годов, что они связывают с изменениями в монетарной политике Федеральной резервной системы и с глобализацией, которая увеличила влияние внешних экономических шоков. Авторы также отмечают, что инфляционные ожидания и их управление становятся все более важными факторами для успешного прогнозирования. В результате своей работы они пришли к выводу, что для улучшения точности прогнозов инфляции необходимо учитывать более широкий спектр экономических переменных и использовать новые модели, способные адаптироваться к быстроменяющимся экономическим условиям.
2. Atkeson, A., & Ohanian, L. E. (2001). "Are Phillips Curves Useful for Forecasting Inflation?"
   1. Методы прогнозирования инфляции.  
      В данной статье авторы анализируют эффективность использования кривой Филлипса для прогнозирования инфляции в США. Кривая Филлипса традиционно связывает уровень инфляции с уровнем безработицы, предполагая, что между ними существует обратная зависимость. Аткинсон и Оханиан исследуют исторические данные, чтобы оценить, насколько хорошо кривая Филлипса может предсказать инфляцию, особенно в условиях меняющейся экономической среды. Для этого они используют эмпирические методы, включая регрессионный анализ, чтобы определить, как различные макроэкономические переменные, такие как безработица и инфляционные ожидания, влияют на инфляцию.
   2. Основные выводы и результаты  
      Основные выводы исследования показывают, что кривая Филлипса имеет ограниченную полезность для прогнозирования инфляции в современных условиях. Авторы обнаружили, что связь между безработицей и инфляцией стала менее стабильной и предсказуемой, особенно в периоды экономических шоков и изменений в политике. Они подчеркивают, что хотя кривая Филлипса может дать некоторые указания на инфляционные тенденции, надежность таких прогнозов снижается из-за влияния других факторов, таких как глобализация и изменения в инфляционных ожиданиях. В заключении авторы предлагают, что для более точного прогнозирования инфляции необходимо использовать более комплексные модели, которые включают в себя дополнительные экономические переменные и учитывают динамические изменения в экономике.
3. Ang, A., Bekaert, G., & Wei, M. (2007). "Do macro variables, asset markets, or surveys forecast inflation better?"
   1. Методы прогнозирования инфляции.  
      В этой статье авторы анализируют три различных подхода к прогнозированию инфляции: макроэкономические переменные, данные с финансовых рынков и данные опросов. Каждый из этих подходов имеет свои преимущества и ограничения, и цель исследования состоит в том, чтобы определить, какой из них предоставляет наиболее точные прогнозы инфляции. Для этого Энг, Бекарт и Вей проводят эмпирический анализ, используя набор данных, включающий макроэкономические индикаторы (такие как ВВП и уровень безработицы), рыночные данные (например, доходности облигаций и фондовые индексы) и результаты опросов, отражающих инфляционные ожидания экономических агентов. Они применяют регрессионные модели и методы временных рядов для оценки предсказательной мощности каждого подхода.
   2. Основные выводы и результаты  
      Исследование показало, что данные опросов об инфляционных ожиданиях часто оказываются более точными в краткосрочном прогнозировании инфляции по сравнению с макроэкономическими переменными и рыночными данными. Авторы объясняют это тем, что опросы могут более эффективно учитывать текущие ожидания и настроения экономических агентов, которые непосредственно влияют на инфляцию. В то же время, для среднесрочного и долгосрочного прогнозирования инфляции рыночные данные и макроэкономические переменные также играют важную роль. В результате авторы заключают, что наиболее точные прогнозы инфляции можно получить, комбинируя информацию из всех трех источников. Это позволяет учесть как текущие ожидания, так и фундаментальные экономические условия, влияющие на инфляцию в долгосрочной перспективе.
4. Groen, J. J. J., & Kapetanios, G. (2016). "Revisiting useful approaches to forecasting US inflation."
   1. Методы прогнозирования инфляции.  
      В своей статье Гроен и Капетаниос исследуют использование методов, основанных на больших данных и факторных моделях, для прогнозирования инфляции в США. Авторы утверждают, что традиционные модели, такие как ARIMA и VAR, могут быть улучшены за счет интеграции новых данных и методов. Они используют факторные модели, которые позволяют обрабатывать большое количество экономических переменных с целью выделения скрытых факторов, оказывающих влияние на инфляцию. Этот подход включает анализ высокочастотных финансовых данных и других индикаторов, которые могут помочь в более точном прогнозировании инфляции. Авторы также применяют регуляризацию и другие методы машинного обучения для оптимизации моделей и улучшения их предсказательной мощности.
   2. Основные выводы и результаты  
      Исследование показало, что использование больших данных и факторных моделей значительно улучшает точность прогнозирования инфляции в США. Гроен и Капетаниос обнаружили, что включение высокочастотных данных позволяет более оперативно реагировать на изменения в экономической среде, что особенно важно в условиях нестабильности. Они также подчеркивают, что факторные модели способны эффективно обрабатывать и извлекать полезную информацию из большого объема данных, что приводит к более точным прогнозам. В заключение авторы делают вывод, что интеграция современных методов обработки данных и факторного анализа открывает новые возможности для повышения точности экономических прогнозов и должна использоваться в сочетании с традиционными подходами для достижения наилучших результатов в прогнозировании инфляции.
5. Koop, G., & Korobilis, D. (2012). "Forecasting inflation using dynamic model averaging."
   1. Методы прогнозирования инфляции.  
      В этой статье Коуп и Коробилис исследуют использование метода динамического усреднения моделей (DMA) для прогнозирования инфляции. DMA представляет собой адаптивный подход, который позволяет моделям изменяться во времени, что особенно важно для прогнозирования в условиях экономической нестабильности. Авторы используют этот метод для анализа временных рядов инфляции, охватывающих различные экономические фазы. DMA позволяет выбирать наиболее подходящие модели или их комбинации в каждый момент времени, что помогает улучшить точность прогнозов. Это достигается за счет постоянного обновления вероятностей моделей на основе новых данных и изменения экономических условий.
   2. Основные выводы и результаты  
      Ключевые результаты исследования показывают, что динамическое усреднение моделей значительно повышает точность прогнозов инфляции по сравнению с традиционными статическими подходами. Коуп и Коробилис обнаружили, что метод DMA позволяет более гибко адаптироваться к изменениям в экономической среде, что приводит к улучшению предсказательной мощности моделей, особенно в условиях высокой волатильности. Авторы также подчеркивают, что использование DMA позволяет эффективно учитывать разнообразие факторов, влияющих на инфляцию, и быстро реагировать на новые данные. В заключение они делают вывод, что динамическое усреднение моделей является перспективным инструментом для экономистов, стремящихся улучшить прогнозирование инфляции и других макроэкономических показателей в условиях неопределенности.
6. Medeiros, M. C., Vasconcelos, G. F. R., Veiga, Á., & Zilberman, E. (2021). "Forecasting inflation in a data-rich environment: The benefits of machine learning methods."
   1. Методы прогнозирования инфляции.  
      В своей работе Медейрос и коллеги исследуют использование методов машинного обучения для прогнозирования инфляции в среде, богатой данными. Авторы подчеркивают, что традиционные эконометрические модели могут быть ограничены в способности обрабатывать и анализировать большие объемы данных, которые становятся все более доступными. Они применяют различные алгоритмы машинного обучения, такие как метод опорных векторов, деревья решений и случайные леса, чтобы оценить их эффективность в прогнозировании инфляции. Эти методы позволяют извлекать скрытые зависимости из данных и учитывать нелинейные отношения между переменными, что может быть особенно полезно в условиях высокой изменчивости экономической среды.
   2. Основные выводы и результаты  
      Результаты исследования показывают, что методы машинного обучения значительно улучшают точность прогнозирования инфляции по сравнению с традиционными подходами. Медейрос и его коллеги обнаружили, что алгоритмы машинного обучения способны лучше адаптироваться к изменяющимся экономическим условиям и учитывать широкий спектр факторов, влияющих на инфляцию. Они подчеркивают, что использование больших данных в сочетании с мощными инструментами анализа, предлагаемыми машинным обучением, открывает новые возможности для повышения точности экономических прогнозов. В заключение авторы делают вывод, что интеграция машинного обучения в процесс прогнозирования инфляции является перспективным направлением, которое может значительно улучшить качество экономических прогнозов и поддержать принятие более обоснованных политических решений.
7. Smalter Hall, A., & McKelvey, R. D. (2012). "Forecasting Inflation: The Role of Structural Breaks and Model Uncertainty."
   1. Методы прогнозирования инфляции.  
      В своей статье Смолтер Холл и МакКелви исследуют влияние структурных сдвигов и неопределенности модели на прогнозирование инфляции. Они подчеркивают, что структурные изменения в экономике, такие как изменения в политике центрального банка или глобальные экономические шоки, могут существенно влиять на точность традиционных моделей прогнозирования, таких как ARIMA и VAR. Авторы применяют подходы, учитывающие структурные сдвиги, чтобы улучшить прогнозирование инфляции. Они используют модели, которые включают переменные, отражающие возможные изменения в экономической политике и структуре, а также рассматривают различные сценарии для моделирования неопределенности.
   2. Основные выводы и результаты  
      Исследование показало, что учет структурных сдвигов и неопределенности модели значительно улучшает точность прогнозов инфляции. Смолтер Холл и МакКелви обнаружили, что модели, которые игнорируют возможные структурные изменения, часто переоценивают или недооценивают инфляцию, что приводит к ошибкам в прогнозах. Они также подчеркивают важность использования нескольких моделей и сценариев для учета неопределенности, что позволяет более гибко адаптироваться к изменениям в экономической среде. В заключение авторы делают вывод, что для достижения более точных прогнозов инфляции необходимо учитывать как структурные сдвиги, так и неопределенность модели, что может помочь экономистам и политикам принимать более обоснованные решения в условиях изменяющейся экономической среды.
8. Stock, J. H., & Watson, M. W. (2003). "Forecasting Output and Inflation: The Role of Asset Prices."
   1. Методы прогнозирования инфляции.  
      В этой статье Сток и Уотсон исследуют, как цены на активы могут быть использованы для прогнозирования инфляции и экономического роста. Авторы рассматривают различные классы активов, включая акции, облигации и недвижимость, и анализируют их способность предсказывать изменения в экономической активности и инфляции. Они используют модели временных рядов, чтобы изучить взаимосвязь между динамикой цен на активы и макроэкономическими переменными. Одним из ключевых методов, применяемых в исследовании, является анализ коэффициентов, которые связывают изменения в ценах на активы с будущими изменениями в инфляции и ВВП.
   2. Основные выводы и результаты  
      Результаты исследования показывают, что цены на активы содержат полезную информацию для прогнозирования инфляции и экономического роста, особенно в краткосрочной и среднесрочной перспективе. Сток и Уотсон обнаружили, что изменения в ценах на активы часто предшествуют изменениям в инфляции и экономической активности, что позволяет использовать их в качестве ранних индикаторов. Авторы подчеркивают, что включение данных о ценах на активы в модели прогнозирования может значительно улучшить их точность. Кроме того, они отмечают, что хотя влияние цен на активы может варьироваться в зависимости от экономических условий, их использование в качестве части интегрированного подхода к прогнозированию может предложить ценные инсайты для экономистов и политиков. В заключение авторы делают вывод, что цены на активы играют важную роль в прогнозировании макроэкономических показателей и должны учитываться в экономических моделях.
9. Golosov, M., & Lucas, R. E. Jr. (2007). "Menu Costs and Phillips Curves."
   1. Методы прогнозирования инфляции.  
      В своей статье Голосов и Лукас исследуют влияние издержек изменения цен (menu costs) на динамику инфляции и кривую Филлипса. Они разрабатывают теоретическую модель, которая учитывает издержки, связанные с изменением цен, и анализируют, как эти издержки влияют на поведение фирм в отношении ценообразования. Модель предполагает, что из-за издержек изменения цен фирмы не всегда реагируют на изменения в спросе или издержках немедленно, что приводит к ценовой ригидности и влияет на общую динамику инфляции. Авторы используют эту модель для анализа того, как издержки изменения цен могут объяснить наблюдаемые эмпирические закономерности в данных о ценах и инфляции.
   2. Основные выводы и результаты  
      Исследование Голосова и Лукаса показывает, что издержки изменения цен имеют значительное влияние на формирование кривой Филлипса и на поведение инфляции. Они обнаружили, что из-за этих издержек цены не всегда мгновенно адаптируются к макроэкономическим изменениям, что приводит к более плавной реакции инфляции на изменения в экономической активности. Это может объяснить, почему кривая Филлипса не всегда демонстрирует четкую и стабильную связь между инфляцией и безработицей. Авторы делают вывод, что учет издержек изменения цен является важным для понимания инфляционной динамики и может помочь в разработке более точных моделей прогнозирования инфляции. Они также подчеркивают, что такие модели могут быть полезны для экономистов и политиков, стремящихся понять и управлять инфляционными процессами в экономике.
10. Hendry, D. F., & Hubrich, K. (2011). "Combining disaggregate forecasts or combining disaggregate information to forecast an aggregate."
    1. Методы прогнозирования инфляции.  
       В своей работе Хендри и Хубрих исследуют, как использование дезагрегированных данных может улучшить прогнозирование агрегированных экономических показателей, таких как инфляция. Авторы рассматривают два подхода: первый — это комбинирование прогнозов, полученных для отдельных компонентов, чтобы получить общий прогноз, и второй — использование дезагрегированной информации для построения прогнозов агрегированных показателей. Они применяют статистические методы, такие как взвешенное усреднение прогнозов и модели временных рядов, чтобы оценить, какой из подходов дает более точные результаты. Их анализ сосредоточен на данных, связанных с инфляцией, где дезагрегированные компоненты могут включать цены на отдельные товары и услуги.
    2. Основные выводы и результаты  
       Исследование показывает, что использование дезагрегированной информации может значительно повысить точность прогнозирования агрегированных показателей, таких как инфляция. Хендри и Хубрих обнаружили, что комбинирование прогнозов на уровне компонентов часто приводит к более точным оценкам, чем использование только агрегированных данных. Они также подчеркивают, что дезагрегированная информация помогает лучше понять структуру и источники инфляции, что может быть полезно для разработки более целенаправленной экономической политики. Авторы делают вывод, что интеграция дезагрегированных данных в процесс прогнозирования предоставляет ценные преимущества и должна рассматриваться как важный инструмент для экономистов и политиков, стремящихся к более точному и детальному пониманию экономических процессов.
11. Svensson, L. E. O. (1997). "Inflation forecast targeting: Implementing and monitoring inflation targets."
    1. Методы прогнозирования инфляции.  
       В статье Ларс Э. О. Свенссон рассматривает концепцию инфляционного таргетирования, которое используется центральными банками для управления денежно-кредитной политикой и контроля инфляции. Этот подход включает прогнозирование будущей инфляции и корректировку денежно-кредитной политики, чтобы достичь определенных инфляционных целей. Свенссон подчеркивает важность использования надежных моделей прогнозирования инфляции, таких как модели временных рядов и эконометрические модели, для оценки будущих уровней инфляции. Он также обсуждает необходимость регулярного мониторинга и пересмотра инфляционных прогнозов, чтобы обеспечить их актуальность и точность в условиях меняющейся экономической среды.
    2. Основные выводы и результаты  
       Основные выводы статьи заключаются в том, что инфляционное таргетирование является эффективным инструментом для достижения макроэкономической стабильности и контроля инфляции. Свенссон утверждает, что ясные и прозрачные инфляционные цели помогают укрепить доверие к денежно-кредитной политике и улучшить координацию ожиданий экономических агентов. Он также отмечает, что успешное инфляционное таргетирование требует наличия четких механизмов отчетности и прозрачности действий центрального банка, которые поддерживают доверие общественности и повышают эффективность политики. В заключение Свенссон делает вывод, что инфляционное таргетирование, подкрепленное надежными прогнозами и мониторингом, предлагает устойчивый способ управления инфляцией и содействия экономическому росту.
12. Cogley, T., & Sargent, T. J. (2005). "Drifts and volatilities: Monetary policies and outcomes in the post WWII US."
    1. Методы прогнозирования инфляции.  
       В своей работе Когли и Сарджент исследуют динамику инфляции и экономических показателей в США после Второй мировой войны с акцентом на изменения в монетарной политике и их последствия. Они используют байесовский анализ временных рядов для оценки изменений в трендах и волатильности инфляции и других макроэкономических переменных. Этот подход позволяет авторам учитывать структурные изменения и неопределенность в моделировании динамики инфляции. Байесовский подход предоставляет гибкость для адаптации к изменениям в данных и позволяет интегрировать экспертные суждения с эмпирическими данными.
    2. Основные выводы и результаты
13. Faust, J., Rogers, J. H., & Wright, J. H. (2003). "Exchange rate forecasting: The errors we've really made."
    1. Методы прогнозирования инфляции.
    2. Основные выводы и результаты
14. Gordon, R. J. (2013). "The Phillips Curve is Alive and Well: Inflation and the NAIRU During the Slow Recovery."
    1. Методы прогнозирования инфляции.
    2. Основные выводы и результаты
15. Makridakis, S., & Hibon, M. (2000). "The M3-Competition: results, conclusions, and implications."
    1. Методы прогнозирования инфляции.
    2. Основные выводы и результаты
16. Orphanides, A., & van Norden, S. (2002). "The unreliability of output gap estimates in real time."
    1. Методы прогнозирования инфляции.
    2. Основные выводы и результаты
17. Christoffersen, P. F., & Diebold, F. X. (1998). "Cointegration and long-horizon forecasting."
    1. Методы прогнозирования инфляции.
    2. Основные выводы и результаты
18. Sims, C. A., & Zha, T. (2006). "Were there regime switches in US monetary policy?"
    1. Методы прогнозирования инфляции.
    2. Основные выводы и результаты
19. Rossi, B., & Sekhposyan, T. (2010). "Have economic models' forecasting performance for US output growth and inflation changed over time, and when?"
    1. Методы прогнозирования инфляции.
    2. Основные выводы и результаты