

# КОЛИЧЕСТВЕННЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ ДЕНЕЖНО-КРЕДИТНЫХ ОПЕРАЦИЙ

---

**ПРЕДПОЛАГАЕМЫЕ ДАТЫ ПРОВЕДЕНИЯ:** 8-12 декабря 2025 года

**ЦЕЛЕВАЯ АУДИТОРИЯ** | Сотрудники младшего и среднего звена центральных банков, задействованные в области денежно-кредитной политики, ее осуществлении, и использовании количественных инструментов в этих областях. Участники должны иметь опыт в области операций центрального банка, финансовых рынках, а также иметь базовые знания количественных методов.

**ОПИСАНИЕ** | Этот пятидневный семинар поможет участникам освоить практические навыки применения передовых количественных инструментов для осуществления денежно-кредитной политики. Благодаря интерактивным сессиям и практическим упражнениям они укрепят свою способность содействовать принятию решений по мерам политики. В рамках семинара будут представлены передовые статистические методы для оценки и внедрения правил валютных интервенций на основе риск-ориентированного подхода, а также для проведения стресс-тестирования баланса центрального банка, его прибыли и убытков. В рамках курса рассматриваются следующие темы:

1. **Стресс-тест баланса центрального банка (CBST):** оценка и прогнозирование статей баланса центрального банка и анализ рисков ликвидности и платежеспособности в рамках различных сценариев.
2. **Модель VaR для валютных интервенций (ВИ) с использованием индекса глубины рынка:** применение методов модели VaR для валютных интервенций на неглубоких рынках.
3. **Прогнозирование ликвидности:** разработка моделей для прогнозирования краткосрочных потребностей в ликвидности.
4. **Модели «стрижек»:** понимание основ «стрижек» для кредитования под залог, включая ЭПЛ и регулярные операции денежно-кредитной политики.
5. **Коммуникации с помощью NLP (Обработка естественного языка):** краткий обзор инструментов NLP для анализа настроений участников рынка и определения стратегий коммуникаций.

**ЦЕЛИ** | По окончании семинара участники научатся:

- Понимать основы и принципы применения этих инструментов для формирования политики центрального банка и ее осуществления.
- Анализировать результаты и отчеты, подготовленные с помощью количественных инструментов, для внутреннего обсуждения и принятия решений.

**ЯЗЫК** | Семинар проводится на английском языке с синхронным переводом на русский язык.