

# ПИСЬМО 02.12.21

Добрый день, Константин!

Извините за долгое молчание. Спасибо за материалы, которые вы прислали! Я стал лучше представлять, что позволяют делать SVAR модели.

В прошлогодней работе выпускника МАЕ Артёма Жирохова "The influence of the speed of information dissemination on runs on financial organizations during the 2007-2008 crisis" изучается влияние скорости распространения новостей на длительность набега на банки и вероятность банкротства. Эта идея по-прежнему кажется мне интересной, но в дипломной работе я хотел бы сосредоточиться на другом.

Я подробнее изучил тему "Monetary policy communications", которую мы с вами начали обсуждать, и, в частности, применение методов NLP для анализа коммуникации регуляторов. В приложенном файле я кратко описал основные идеи и техники, которые использовали авторы. Я хотел бы посоветоваться с вами, перспективно ли исследование в этой области. Для вашего удобства оригиналы статей также прикреплены в письме.

На данный момент я нашел лишь одну статью, в которой применяются методы машинного обучения для анализа заявлений и пресс-релизов Центрального банка России. Основным результатом в ней является новый метод построения индекса сложности текста.

В то же время для других стран NLP техники достаточно широко применяются для анализа качества коммуникации. Например, детально изучается динамика обсуждаемых тем, проводится анализ тональности заявлений, оценивается влияние публикаций на рынок акций и на дискурс СМИ. На мой взгляд, можно использовать похожие техники для оценки прозрачности и восприятия коммуникации ЦБ России.

Скажите, пожалуйста, вам удобно будет встретиться или созвониться для обсуждения дальнейших шагов?

С уважением,

Стас Петров