

**Комментарий заместителя директора
Департамента денежно-кредитной политики НБ РК
Дениса Чернявского об экономическом исследовании**

Национальный Банк Казахстана опубликовал экономическое исследование «Построение большой байесовской векторной авторегрессионной модели для Казахстана».

Цель работы – оценка эффективности применения байесовских векторных авторегрессионных моделей (BVAR-моделей) в прогнозировании макроэкономических показателей Казахстана. Поиск оптимальных параметров оцениваемой BVAR-модели проходил на основе точности прогнозов на тестовой выборке. Результатом этого стало эмпирическое подтверждение целесообразности применения данных моделей для Казахстана в сравнении с более простыми аналогами.

Работа содержит исходный код, который позволяет воссоздать модели и стимулирует дальнейшую дискуссию по анализу и прогнозированию макроэкономических показателей.

Проведение исследований – это неотъемлемая часть политики инфляционного таргетирования, которое призвано усилить аналитический инструментарий при принятии решений по денежно-кредитной политике. Публикация исследований также способствует прозрачности и открытости Национального Банка, снижая информационную асимметрию.

Подробнее: <https://nationalbank.kz/ru/news/issledovaniya>