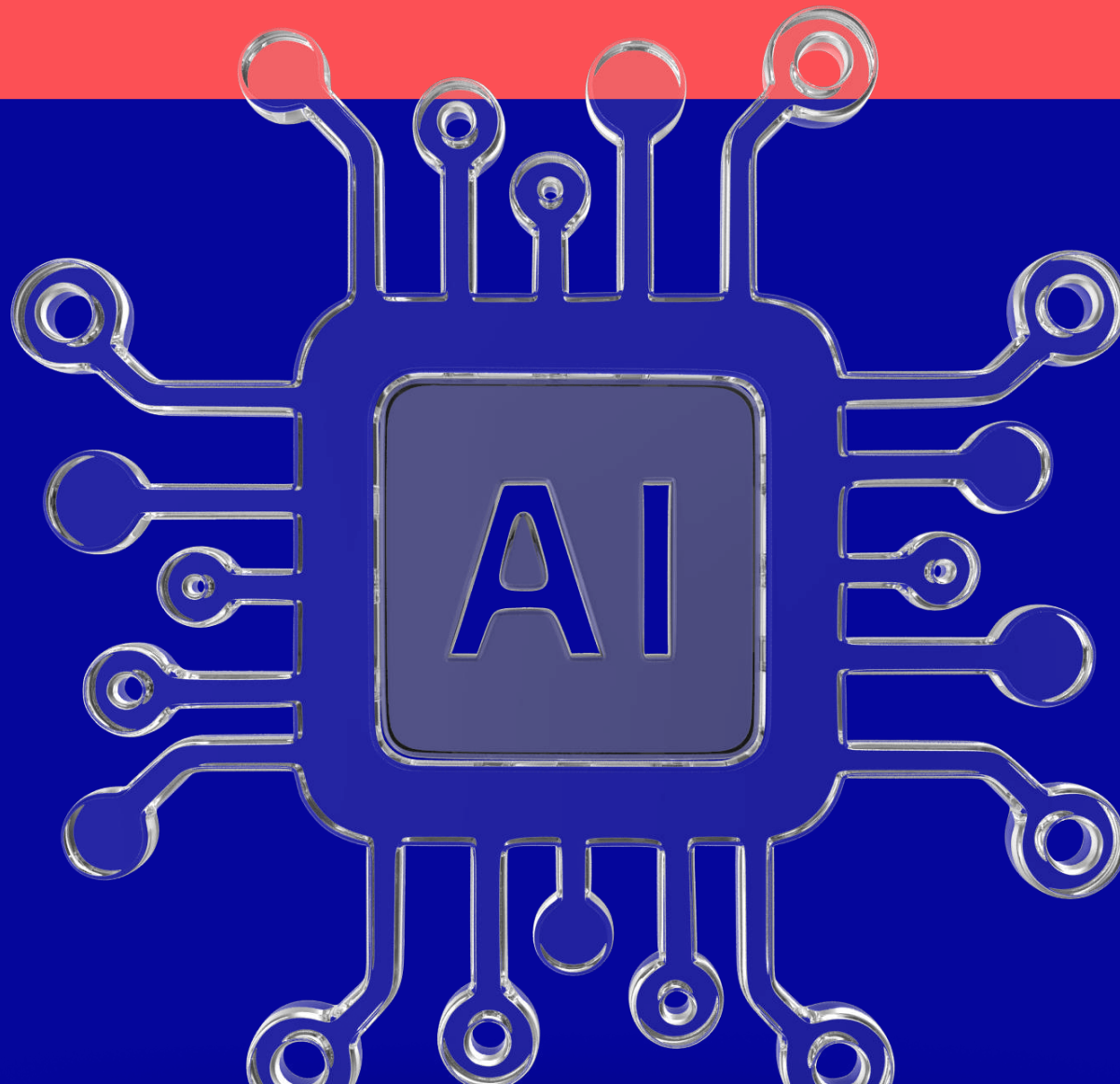


# Филипп Аграчев

руководитель Департамента  
клиентских операций  
на финансовых рынках  
Совкомбанка



# Подготовка Политики хеджирования с помощью ИИ

## Источники:



Методология управления рыночными рисками в нефинансовых компаниях



Устав, регламенты, ковенанты



Корпоративные рамки управления рисками



Финансовая база (выручка, структура долга, валютная структура)



Прогноз денежных потоков



*Ты - эксперт по управлению рисками.  
Задача: на основе методологии НФА  
подготовить политику хеджирования..*

## Результат:

- ✓ Формирует корпоративную политику по стандарту НФА
- ✓ Следует заданной структуре документа: цели, оценка риска, лимиты, методы и инструменты управления, мониторинг
- ✓ Сокращает время подготовки до дней
- ✓ Требует обязательной проверки профильными подразделениями компании

# Курсы валют: Новая реальность

	ЦБ РФ	USDRUBF	Синтетика	СБЕР ПУЛ	USDT	Investing
ЦБ РФ	100%	82%	81%	83%	83%	47%
USDRUBF	82%	100%	98%	99%	87%	45%
Синтетика	81%	98%	100%	97%	87%	43%
СБЕР ПУЛ	83%	99%	97%	100%	88%	43%
USDT	83%	87%	87%	88%	100%	62%
Investing	47%	45%	43%	43%	62%	100%

21-day moving window  
correlation matrix



Большинство сделок ВЭД  
базируется на Российском рынке  
и спреде



Широкие возможности для  
хеджирования локального рынка



Есть ли возможности хеджирования  
спреда с офшором?