



Использование потенциала ИТ и данных для прогнозирования и управления ликвидностью

Группа 3

Страны: Азербайджан, Казахстан, Кыргызстан, Молдова, Туркменистан

Совместное заседание рабочих групп КС по управлению ликвидностью и использованию ИТ в деятельности казначейства

г. Бухарест, Румыния. 19 февраля 2026 г.

1. Современная практика прогнозирования ликвидности

	Азербайджан	Казахстан	Кыргызстан	Молдова	Туркменистан
Предмет и охват прогноза	Остаток на ЕКС	Ликвидность респ. бюджета	Остаток на ЕКС	Доходы, расходы и источники финансирования	Прогноз остатка на ЕКС
Основные показатели	<i>Остаток на ЕКС, доходы, расходы</i>	Доходы, расходы, бюджетные кредиты, дефицит, займы, поступления	Ресурсы респ. Бюджета	По госбюджету - Налоговые и неналоговые доходы - Кассовые расходы - Источники финансирования Остаток на ЕКС прогнозируется отдельно (он шире)	Остаток средств Поступления доходов (налог) Планируемые расходы (заявки на оплату) Исполненные платежи
Детализация прогноза	<i>1 день – 3 мес.</i>	Ежедневный, ежемесячный, квартальный, ежегодный	Месяц (план-прогноз)	Годовой прогноз, месячный (с детализацией по неделям и дням)	Ежедневно 7-14 дней 1-3 мес
Частота обновления и продления	<i>Еженедельно краткоср. прогноз</i>	<i>Ежедневно</i>	По мере необходимости	Годовой – min ежемесячно, месячный - ежедневно	ежедневно

2. Данные и модели, используемые для прогнозирования ликвидности



		Азербайджан	Казахстан	Кыргызстан	Молдова	Туркменистан
Источник	ИСУГФ	+ (истор. данные, прогноз бюджета, в т.ч. по налоговым доходам)	ИИСК	+ (факт. остатки) + прогнозы ведомств по расходам в ИС Казна бюджет	+	TMS
	Другие ГИС		Ком госдоходов, комитет госимущества		Налог. и тамож. служба	интеграция с данными налоговой и таможенной служб Xroad
	Иное		Департамент госзаимствования, налог. и тамож. за-ва, Министерство труда и соцзащиты		РБС, Управление госдолга	
Очистка, обработка данных	<i>Еженед. обновление прогноза +/-</i>	Требуется очистка/корректировка данных	Нет	Нет	Корректировки с учетом факт. данных	
Используемое ПО	Excel	Excel	Excel	Excel	Excel	TMS модуль прогнозирования
Используемые модели	Детерминированная кассово-расчетная модель (1 сценарий)	Нет спец. модели	3 сценария (оптимистический, пессимист., планируемый)			Корреляционно-регрессионный анализ

3. Направления совершенствования и вызовы



- ❑ **Направления совершенствования прогнозирования и управления ликвидностью**
 - ❑ *Повышение качества данных и своевременности их получения*
 - ❑ *Повышение точности краткосрочного прогнозирования (Молдова)*
 - ❑ *КЗ: Единый модуль прогнозирования с автоматическим сбором и сверкой данных, мониторингом в режиме реального времени, контроль отклонений, ИИ (до 2029 г.)*
 - ❑ *Минимизация человеческого фактора*
- ❑ **Как интеграция ИСУГФ с другими государственными информационными системами может поддерживать принятие решений в сфере управления ликвидностью?**
- ❑ Интеграция данных в едином контуре
- ❑ Интеграция с другими системами позволит повысить оперативность получения данных, стандартизация данных
- ❑ **Каковы основные вызовы, связанные с переходом к решениям, основанным на данных, в сфере управления ликвидностью?**
- ❑ Изменения нормативно-правовой базы, необходимость в прогнозировании новых категорий (показателей)
- ❑ Качество данных, их фрагментация, интеграция систем и ограниченным использованием риск-ориентированных и автоматизированных подходов.
- ❑ Точность прогнозирования, отсутствие раннего выявления рисков
- ❑ Устаревание ИСУГФ (достижение пределов возможностей системы)
- ❑ Прогнозы часто строятся по базовому сценарию без оценки рисков и альтернативных траекторий.
- ❑ Высокая зависимость от ручных инструментов (Excel)
- ❑ Неопределенность по объему и срокам поступления внешних и внутренних заимствований

Спасибо за внимание!

