

Использование потенциала ИТ и данных для прогнозирования и управления ликвидностью

Презентация в малой группе

Северная Македония

Виктория Христовска Димовска

Совместное заседание Рабочей группы по управлению и прогнозированию ликвидности и Рабочей группы по использованию ИТ в казначейских операциях
Бухарест, Румыния. 18 февраля 2026 г.

1. Современная практика прогнозирования ликвидности



- ❑ **Предмет и охват прогноза ликвидности:** бюджет центрального правительства, бюджеты фондов социального страхования
- ❑ **Основные прогнозируемые показатели:** налоговые доходы, взносы на социальное страхование, иные доходы, расходы
- ❑ **Временная детализация прогноза**
- ❑ **Периодичность обновления и переноса на следующий период**
 - ❑ ежемесячно
 - ❑ еженедельно
 - ❑ ежедневно

2. Данные и модели, используемые для прогнозирования ликвидности



- ❑ Данные, используемые для прогнозирования ликвидности: доходы и расходы бюджета центрального правительства
- ❑ Источники данных: Информационная система казначейства (TRIS), исторические данные, данные других структурных подразделений
- ❑ Где хранятся данные?
 - ❑ *TRIS*
- ❑ Требуют ли данные очистки/корректировки? Да
- ❑ ПО, используемое для прогнозирования ликвидности
- ❑ Модель (модели), используемые для прогнозирования ликвидности /

3. Планы на будущее и вызовы



- ❑ **Аспекты управления ликвидностью и прогнозирования, требующие улучшения**
 - ❑ *Повышение эффективности*
 - ❑ *Прозрачность*
 - ❑ *Устойчивость в управлении государственными расходами*
- ❑ **В рамках Программы реформы государственных финансов начат проект по внедрению интегрированной системы управления государственными финансами.**
- ❑ **Проект стартовал в конце 2018 года в сотрудничестве с экспертами Всемирного банка.**
- ❑ **Завершен процесс картирования процессов и показателей в области платежей.**
- ❑ **Такая система обеспечит эффективную и результативную работу как Министерства финансов, так и всех пользователей бюджета за счет интеграции процессов.**

СПАСИБО!

