

Использование потенциала ИТ и данных для прогнозирования и управления ликвидностью

Презентация в малой группе

Турция

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:

Поступления:

- Налоговые доходы (НДС, частное потребление, подоходный, на прибыль, таможенные сборы и др.)
- Неналоговые доходы
- Доли доходов казначейства
- Дивиденды от ГП и других государственных организаций
- Процентный доход на ЕКС
- Иные разовые поступления (продажа активов, приватизация)
- Иные доходы.

Платежи:

- Расходы на персонал (зарботная плата)
- Взносы на социальное страхование
- Компенсация операционных убытков ГП
- Платежи центрального правительства (трансферты, текущие расходы, капитальные расходы и т.д.)
- Доли доходов местных органов власти

Потоки финансирования:

- заимствования, обслуживание долга (основная сумма и проценты)

- Основные прогнозируемые показатели: **Совокупные доходы и расходы, основной баланс денежных средств, денежная позиция, потребности в финансировании/избыток средств.**
- Временная детализация прогноза **Ежедневно, ежемесячно, ежегодно**
- Периодичность обновления и переноса на следующий период **Ежедневно**

2. Данные и модели, используемые для прогнозирования ликвидности



- **Данные, используемые для прогнозирования ликвидности:** Исторические денежные потоки на основе кластеризации и моделей расходов (метод скользящего среднего), запросы на денежные средства, бюджетные показатели, доходы и ассигнования, разовые показатели, потребности в финансировании, исторические взаимосвязи между денежными средствами и бюджетными показателями, макроэкономические показатели, эффективность работы учреждений.
- **Источники данных:** Правительственные системы/порталы, соответствующие подразделения, занимающиеся распределением средств, информация, предоставляемая министерствами и ведомствами.
- **Где хранятся данные?**
- Excel, новая информационная система по управлению ЕКС, информационная система сбора доходов, ИСУГФ
- **Требуют ли данные очистки/корректировки?** Да
- **ПО, используемое для прогнозирования ликвидности** Excel и подобные программы общего назначения
- **Модель (модели), используемые для прогнозирования ликвидности** Ручное прогнозирование, прогнозирование на основе Excel, прогнозирование на основе ИИ (в процессе разработки), индивидуально разработанная формула прогнозирования для каждого учреждения.

3. Планы на будущее и вызовы



- ❑ **Аспекты управления ликвидностью и прогнозирования, требующие улучшения**
 - ❑ Переход от файлов Excel к информационным системам
 - ❑ Улучшение автоматизации сбора и консолидации данных
 - ❑ Расширенная визуализация и панели мониторинга ликвидности на основе КПЭ
 - ❑ Более надежная обратная связь между прогнозами, исполнением и измерением результативности и эффективности
- ❑ **Планы по дальнейшей автоматизации функций управления ликвидностью и прогнозирования (включая использования передовых ИТ, например, ИИ)**
 - ❑ Прогнозирование ликвидности с использованием ИИ
- ❑ **Ключевые вызовы**
 - ❑ Фрагментированные данные в различных системах и учреждениях
 - ❑ Высокая зависимость от электронных таблиц Excel, обеспечивающих гибкость
 - ❑ Проблемы с качеством, полнотой и своевременностью данных

СПАСИБО!

