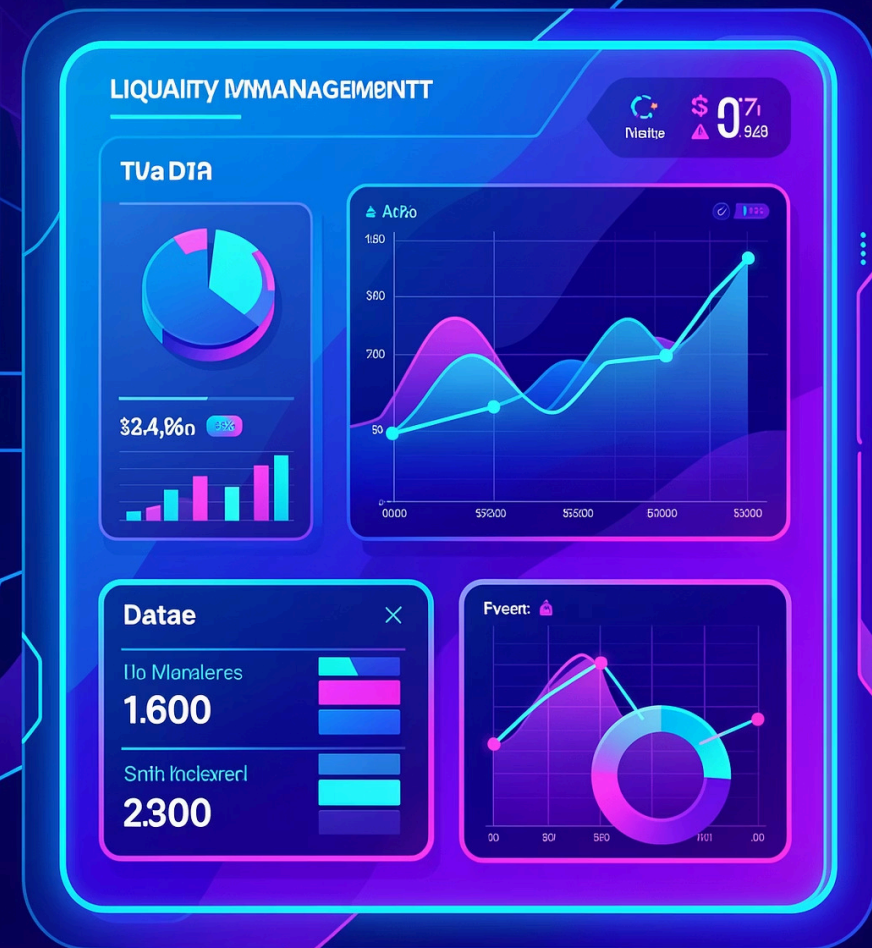


Использование потенциала ИТ и данных для прогнозирования и управления ликвидностью

Страна: Туркменистан

Докладчик: Anvar Muzafarov



Слайд 1 — Современная практика прогнозирования ликвидности

Предмет и охват прогноза ликвидности:

- Прогноз остатка на Едином казначейском счёте
- Контроль поступлений и выплат в реальном времени
- Предотвращение кассовых разрывов

Основные прогнозируемые показатели:

- Остаток средств (данные банка)
- Поступления доходов (данные налоговой системы)
- Планируемые расходы (заявки на оплату в TMS)
- Исполненные платежи

Временная детализация:

- Краткосрочный прогноз: ежедневно / 7–14 дней
- Среднесрочный прогноз: 1–3 месяца

Периодичность обновления:

- Ежедневное обновление
- Оперативное обновление при изменении статусов платежей

Слайд 2 — Данные и модели, используемые для прогнозирования ЛИКВИДНОСТИ

Данные, используемые для прогноза:

- Заявки на оплату (зарплата, прочие расходы) — TMS
- Остатки и движение средств — банк
- Поступления доходов — налоговая система

Источники данных:

- TMS(внутренняя казначейская система)
- Банковская система
- Налоговая информационная система

Где хранятся данные:

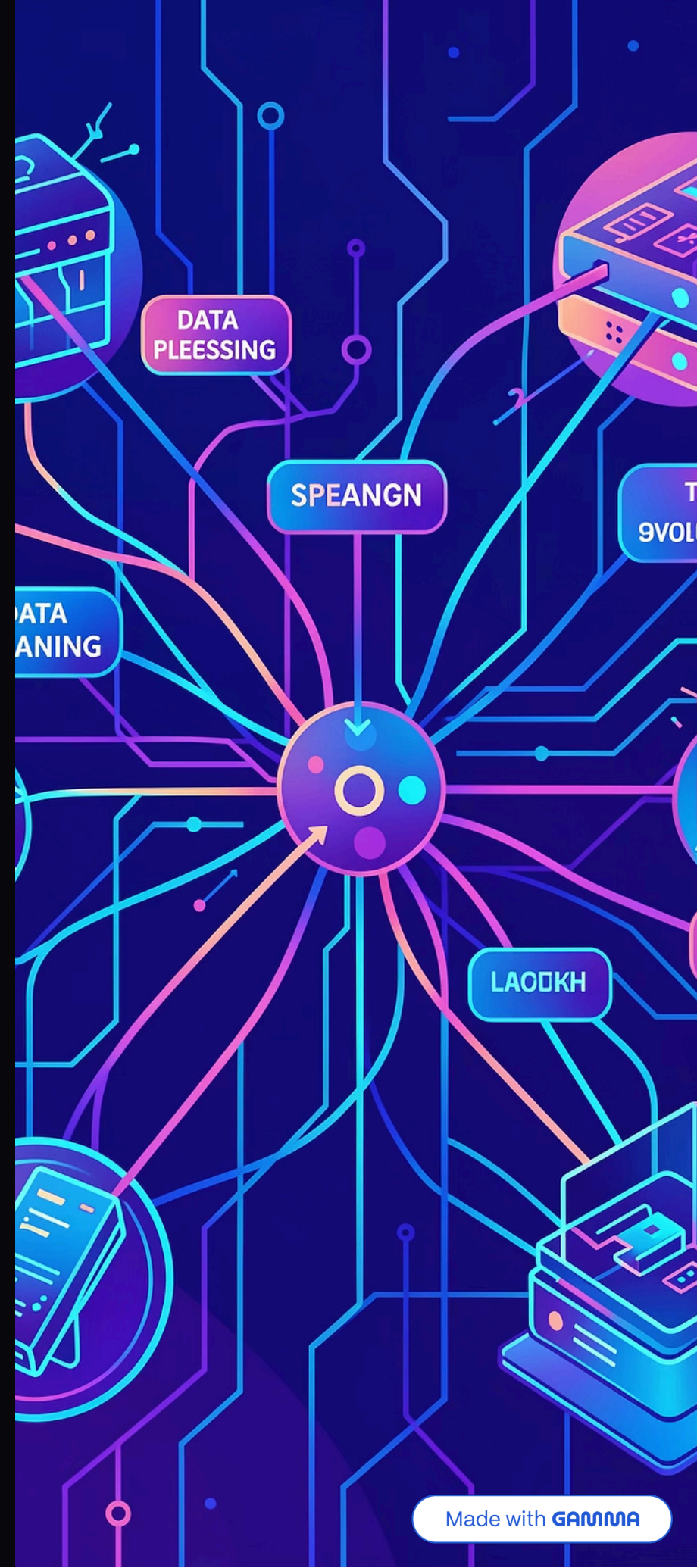
- Центральная база TMS
- Интеграционные сервисы с внешними системами

Требуется ли очистка данных:

- Сверка и сопоставление данных из разных систем
- Проверка корректности классификаторов и статусов

ПО и подход к прогнозированию:

- Использование операционных данных в режиме реального времени
- Формирование календаря будущих выплат
- Сравнение плановых и фактических показателей

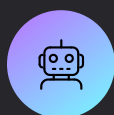


Слайд 3 — Планы на будущее и вызовы



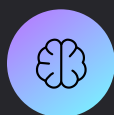
Что требует улучшения:

- Повышение качества и полноты данных
- Расширение источников информации
- Более точные методы прогнозирования



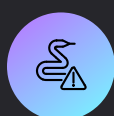
Планы по автоматизации:

- Развитие аналитических панелей (дашбордов)
- Автоматическое выявление кассовых разрывов
- Более глубокая интеграция с государственными системами



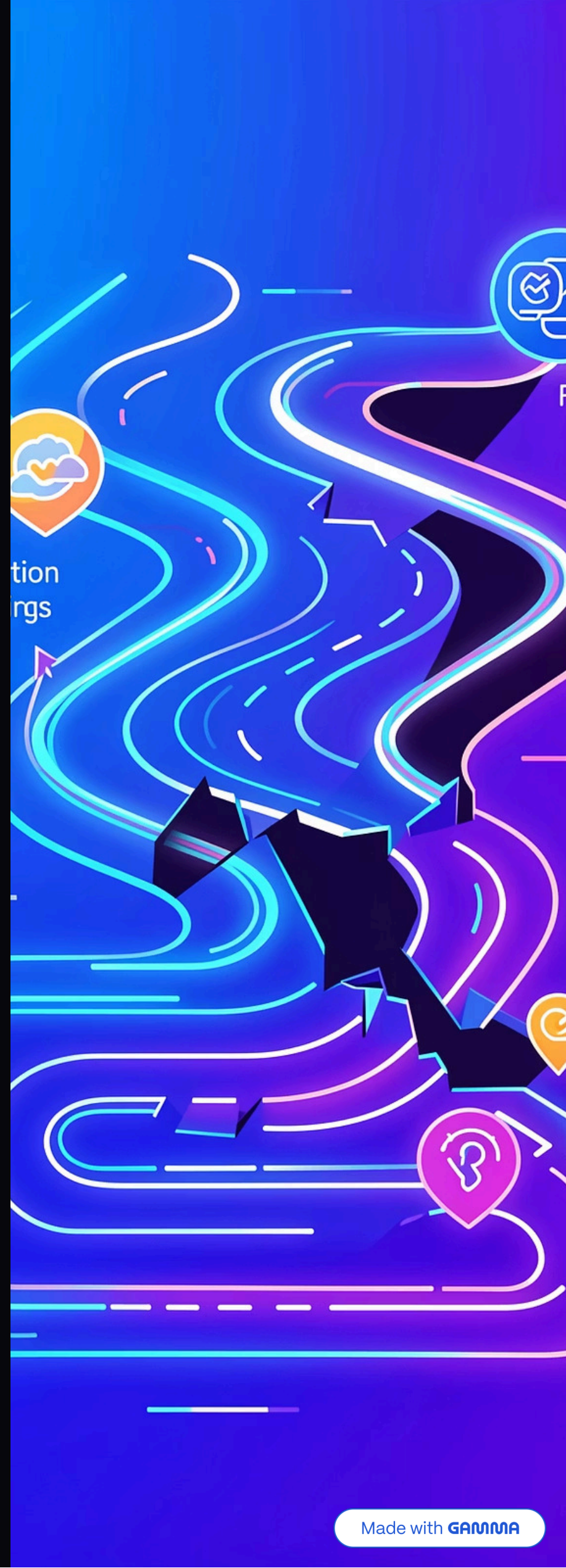
Использование современных ИТ:

- Применение аналитики данных
- Возможное использование ИИ для прогнозирования доходов и расходов



Ключевые вызовы:

- Разнородность данных из разных систем
- Задержки в обновлении информации
- Необходимость точной синхронизации между системами



Спасибо за внимание