

Использование потенциала ИТ и данных для прогнозирования и управления ликвидностью

Презентация в малой группе

Страна: Азербайджан

Докладчик: Турал Аббасов – Начальник департамента по
исполнению и учету кассовых операций

Совместное заседание Рабочей группы по управлению и прогнозированию ликвидности и Рабочей группы по
использованию ИТ в казначейских операциях

Бухарест, Румыния. 18 февраля 2026 г.

Вводная часть.

Ситуация в Азербайджане:



1

В Азербайджане все платежи производятся своевременно, благодаря эффективному управлению бюджетом и наличию достаточных денежных средств. Не было случаев просроченных платежей из-за нехватки ликвидности, что подтверждает показатель «Доля (%) платежей, не произведенных в срок», который фактически отсутствует. Таким образом, финансовое управление обеспечивает стабильное выполнение всех обязательств.

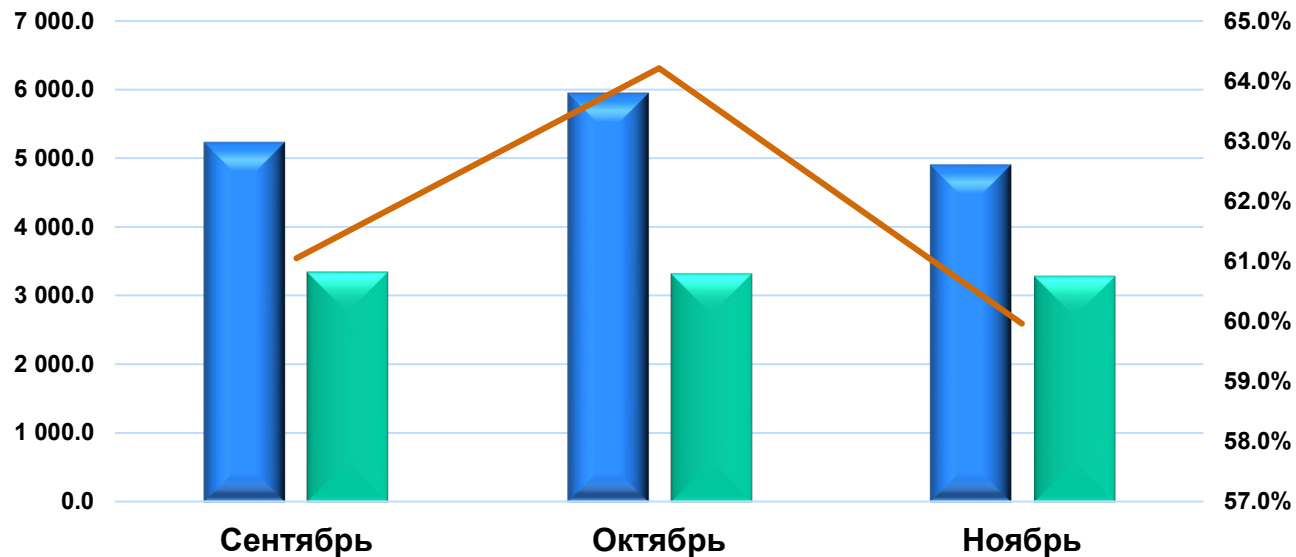
2

Казначейство Азербайджана не прибегает к заимствованиям у Центрального банка для финансирования текущих обязательств, так как бюджет страны обеспечивает необходимую ликвидность. Поэтому показатель «Соотношение непогашенных авансов или заимствований у Центрального банка и общих ежемесячных расходов» также не применяется.

Вводная часть.

Охват ЕКС:

Охват ЕКС (млн. манат)



- А. Остатки денежных средств на ЕКС под контролем Казначейства и доступные для выполнения обязательств (в национальной валюте)*
- В. Общая сумма прочих остатков средств органов государственного управления в банковской системе (в национальной валюте)**
- С. = $A/(A+B) \times 100$ процентов

В течение трех месяцев видна стабильность остатков на ЕКС на уровне около 5300 млн манат.

Значение категории В также показывает стабильные значения в пределах 3200 - 3300 млн манат.

Покрывание ЕКС (С) остается практически неизменным, около 61.7%, что говорит о стабильности контроля и использования средств.

1. Современная практика прогнозирования ликвидности



□ Предмет и охват прогноза ликвидности:

Прогнозирование движения денежных средств **Единого казначейского счета (ЕКС)**

□ Основные прогнозируемые показатели:

Остаток средств на ЕКС

□ Временная детализация прогноза

Горизонт прогнозирования: от **1 дня до 3 месяцев**

□ Периодичность обновления и переноса на следующий период

Еженедельное обновление краткосрочного прогноза

Корректировка квартального прогноза

2. Данные и модели, используемые для прогнозирования ликвидности



- **Данные, используемые для прогнозирования ликвидности:**

- **Источники данных:**

Плановые и фактические данные по доходам и расходам

Кассовое исполнение бюджета

- **Где хранятся данные?**

Исторические данные для расчета хранятся в централизованных информационных системах.

- **Требуют ли данные очистки/корректировки?**

Еженедельно осуществляется обновление/ корректировка данных.

- **ПО, используемое для прогнозирования ликвидности**

Excel используется как расчетная модель для формирования прогноза ликвидности.

- **Модель (модели), используемые для прогнозирования ликвидности**

Прогноз ликвидности ЕКС формируется на основе детерминированной кассово-поточковой модели, реализованной в Excel

3. Планы на будущее и вызовы



❑ **Аспекты управления ликвидностью и прогнозирования, требующие улучшения**

Государственное казначейство использует прогнозирование остатков и движения средств на Едином казначейском счёте (ЕКС) на основе текущих планов бюджета, анализа остатков и ожидаемых поступлений и расходов

❑ **Планы по дальнейшей автоматизации функций управления ликвидностью и прогнозирования (включая использования передовых ИТ, например, ИИ)**

❑ Использование современных моделей анализа данных и ИИ-инструментов для построения более точных прогнозов, особенно для краткосрочных и среднесрочных периодов.

❑ **Ключевые вызовы**

❑ Основные вызовы прогнозирования ликвидности связаны с качеством данных, интеграцией систем и ограниченным использованием риск-ориентированных и автоматизированных подходов.

❑ Прогнозы часто строятся по базовому сценарию без оценки рисков и альтернативных траекторий.

❑ Высокая зависимость от ручных инструментов (Excel)

СПАСИБО!

