

Использование потенциала ИТ и данных для прогнозирования и управления ликвидностью

Презентация в малой группе

Венгрия

Андраш Рез

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:** Бюджетные доходы и расходы, прочие денежные потоки, связанные с ЕКС и операциями по управлению долгом и ликвидностью.
- ❑ **Основные прогнозируемые показатели:**
 - ❑ *НДС, подоходный налог, поступления бюджетных учреждений и глав бюджетов, доходы от ЕС, процентные доходы, прочие бюджетные доходы, взносы на социальное обеспечение;*
 - ❑ *Семейные пособия, расходы бюджетных учреждений и глав бюджетов, расходы, связанные с ЕС, процентные платежи, прочие расходы, расходы на социальное обеспечение;*
 - ❑ *Сроки погашения долга, выпуск облигаций и займов, непогашенные суммы казначейских векселей, выпуск розничных долговых обязательств, операции РЕПО, конвертация валютных депозитов, авансы*
- ❑ **Казначейство формирует ежедневный прогноз на 3 месяца**
- ❑ **Прогноз обновляется ежедневно для предоставления фактических данных, а более общие обновления происходят дважды в неделю, когда Казначейство направляет прогноз в агентство по управлению государственным долгом. Прогноз на 3 месяца обновляется раз в месяц.**

2. Данные и модели, используемые для прогнозирования ликвидности



- ❑ **Данные, используемые для прогнозирования ликвидности:** данные поступают от ответственных подразделений Государственного казначейства, Министерства национальной экономики и Агентства по управлению долгом
- ❑ **Источники данных:** В основном данные других департаментов Казначейства хранятся в хранилище данных, а данные Министерства национальной экономики и Агентства по управлению долгом поступают в формате Excel
- ❑ **Где хранятся данные?**
 - ❑ Как правило, данные вносятся вручную, они не структурированы
- ❑ **Обычно данные не нуждаются в очистке или корректировке, лишь в редких случаях.**
- ❑ **Для прогнозирования ликвидности используется Excel**
- ❑ **В настоящее время специальные модели для прогнозирования ликвидности не используются**

3. Планы на будущее и вызовы



- ❑ **Аспекты управления ликвидностью и прогнозирования, требующие улучшения**
 - ❑ В настоящее время используется Excel, необходимо разработать модели для прогнозирования ликвидности.
 - ❑ Необходимы автоматизация и визуализация для более эффективного использования имеющихся данных.
- ❑ **Планы по дальнейшей автоматизации функций управления ликвидностью и прогнозирования (включая использования передовых ИТ, например, ИИ)**
 - ❑ Начали разрабатывать системы прогнозирования с использованием моделей и автоматизации, выходящих за рамки Excel. SAS (Viya, Guide), Python.
 - ❑ В настоящее время изучаем методологию, используемую МНБ (Центральным банком) и другими странами (странами ПЕМПАЛ).
- ❑ **Ключевые вызовы**
 - ❑ Использование ИИ в прогнозировании, управление большим количеством разовых транзакций, а также использование данных за прошлые и текущий годы при прогнозировании

СПАСИБО!

