



Использование потенциала ИТ и данных для прогнозирования и управления ликвидностью

Презентация в малой группе

Республика Казахстан

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

Охват

Охват прогноза

Ликвидность Республиканского бюджета

Полный охват

Горизонт

Горизонт прогнозирования

Ежедневный

Ежемесячный

Ежеквартальный

Ежегодный

Показатели

Основные показатели

Доходы, расходы, бюджетные кредиты, дефицит, займы, поступления и т.д.

Доходы

Расходы

Кредиты

Обновление

Обновление прогноза

Ежедневное обновление данных для актуальности прогнозов

 Ежедневно



2. Данные и модели, используемые для прогнозирования ликвидности



Источники данных

Информационные системы ведомств:

- > КГД МФ РК – Комитет государственных доходов
- > КГИП МФ РК – Комитет гос. имущества и приватизации
- > ДГЗ МФ РК – Департамент гос. заимствования
- > ДНТЗ МФ РК – Департамент налог. и таможенного законодательства
- > МТСЗН РК – Министерство труда и соц. защиты РК



Хранение данных

ИИСК и информационные системы ведомств

☁ Не централизованное хранилище



Подготовка данных

Требуется очистка и корректировка данных

⚙ Предварительная обработка



Текущее состояние

❌ Специализированное программное обеспечение отсутствует

❌ Формализованные модели прогнозирования отсутствуют



3. Планы на будущее и ключевые вызовы

Текущее состояние

- Разрозненные данные
- Ручная консолидация информации
- Выявление кассовых разрывов после возникновения
- Отсутствие единого модуля прогнозирования
- Разные подходы к расчетам

Планируемая модель

- ✓ Единый модуль прогнозирования
- ✓ Централизованный мониторинг ликвидности
- ✓ Автоматический сбор и сверка данных
- ✓ Мониторинг в режиме реального времени
- ✓ Прогноз на основе планов и фактов
- ✓ Контроль отклонений
- ✓ Ранние уведомления о рисках
- ✓ Интеграция данных в едином контуре
- ★ Интеллектуальное прогнозирование (ИИ)

Ключевые вызовы



Точность прогнозирования



Раннее выявление рисков



Снижение ручных операций



Поддержка решений



Спасибо за внимание

Республика Казахстан

Развитие системы Казначейства

Бухарест, Румыния · 18 февраля 2026 г.