

ЕДИНОЕ КАЗНАЧЕЙСКОЕ РЕШЕНИЕ



НОРНИКЕЛЬ

BeringPro

ГЛОБАЛЬНАЯ СИТУАЦИЯ СТИМУЛИРУЕТ КОМПАНИИ ЭФФЕКТИВНЕЕ УПРАВЛЯТЬ ДЕНЕЖНЫМИ РЕСУРСАМИ



Санкции ограничили доступ к дешёвым зарубежным деньгам и повысили риски.



Центробанк поднял ключевую ставку, чтобы сдержать инфляцию.



Рост инфляции увеличил издержки бизнеса и требования по доходности кредитов.

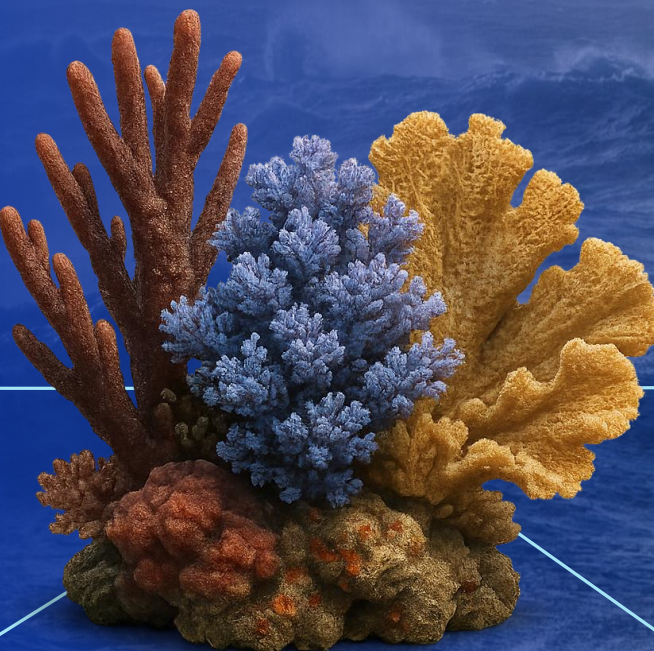


В КОМПАНИИ СОЗРЕЛА ПОТРЕБНОСТЬ К ИЗМЕНЕНИЯМ

Внесистемное моделирование для платёжного календаря:

- плановых дат платежей по группе компаний;
- рекомендаций по конверсиям, внутригрупповым займам, привлечению и покрытию кредитных средств, размещению депозитов;
- сценариев финансовых сделок.

Ручной сбор и трансформация оперативных и исторических данных из разрозненных источников для прогнозирования и стресс-тестирования.



Внесистемное моделирование сценариев финансовых сделок:

- ограничена комбинаторика параметров;
- затруднено формирование отчётности;

Количество параметров в модели прогнозирования ограничено возможностями электронных таблиц.

Стресс-тестирование: реакция на глобальные изменения возможна не чаще 1 раза в месяц.

ДЛЯ ВНЕДРЕНИЯ ИЗМЕНЕНИЙ ТРЕБУЮТСЯ ТЕХНОЛОГИЧНЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ



Управление
ликвидностью



Прогнозирование
казначейских
операций



Управление
финансовыми
сделками



Управление
финансовыми
рисками

ЧТОБЫ

1. Улучшить планирование расходования средств

2. Своевременно выявить финансовые риски

3. Выбрать оптимальные финансовые инструменты
в моменте

4. Быстро реагировать на глобальные изменения

ГДЕ НАЙТИ НУЖНЫЙ ИНСТРУМЕНТ?



Функциональными бизнес-экспертами предоставлены ключевые требования к реализации.

1



Получен ответ от производителей ПО для оценки соответствия функциональным и техническим требованиям.

4



Опрошены крупные вертикально-интегрированные компании и значимые банки об используемых решениях.

5



Собран проектный опыт по реализации решений, закрывающих отдельные требования.

2



Проанализированы возможности санкционных ИТ-продуктов.

3



Изучены мировые практики применения методов и инструментов прогнозирования, сбора данных и оценки достоверности.

6

А ПОДХОДИТ ЛИ ЭТО НАМ?

РЕШЕНИЕ ДОЛЖНО ОБЕСПЕЧИВАТЬ:



Использование модели для прогнозирования показателей выручки, оборотного капитала, денежных потоков от операционной, финансовой и инвестиционной деятельности, налогов, курсов валют и др. параметров



Полноту и оперативность поступления данных из внутренних и внешних источников, включая макропараметры



Структурирование и приведение данных к единому виду



Максимальную автоматизацию процессов управления ликвидностью, финансовыми сделками



Расчет годовых и среднесрочных финансовых прогнозов



Стресс-тестирование ключевых показателей



Понятную и удобную визуализацию результатов

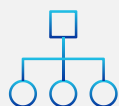


Высокую производительность



ЧТО С ЭТИМ ДЕЛАТЬ?

ПРОВЕРИТЬ*:



Функциональность **управления ликвидностью** и **финансовыми сделками, прогнозирования и управления финансовыми рисками.**



Ограничения по использованию ПО: санкции, производительность, адаптируемость, сертификация, совместимость с текущим ИТ-ландшафтом.



Потенциал развития: наличие опыта и экспертизы на рынке, динамика инвестиций в продукт.

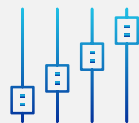


Стоимость владения.

** по методологии Заказчика «Пакеты принятия решений» и методологии BeringPro «IT-Advisory»*

- Custom-разработка
- 1С
- Custis
- Финаксио
- Форсайт
- Др. продукты и разработки класса TMS и EPM

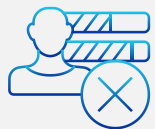
ПРИНИМАЕМ РЕШЕНИЕ



На рынке доступны разрозненные ИТ-продукты для базовой автоматизации отдельных требований.



В нескольких компаниях и банках есть собственные разработки для отдельных функций.



Не найдены решения с встроенной моделью взаимосвязанных финансовых показателей:
прогноз продаж, выручка, оборотный капитал, операционные расходы, налоги, инвестиционная деятельность, финансовая деятельность и др.

РАЗРАБОТАТЬ комплексное решение «ЕДИНОЕ КАЗНАЧЕЙСКОЕ РЕШЕНИЕ»

на базе нескольких доступных на рынке ИТ-продуктов:

- 1С:Управление холдингом
- Форсайт
- FineBI
- ModelRisk

КАКОВ БУДЕТ ДИЗАЙН?

В подходе использованы опыт проектной команды и результаты исследований *



ШАГ 1

Анализ:

- Групповой метод прогнозирования для взаимосвязанных показателей;
- Индивидуальный подход для макропараметров на основе внешних прогнозов.



ШАГ 2

Группировка показателей и выбор подходов:

- Статистические модели временных рядов,
- Эконометричные модели с причинно-следственными связями.



ШАГ 3

Определение перечня параметров методов прогнозирования для повышения точности расчетов прогнозов.

* mdpi.com, economy.spbstu.ru, hse.ru, mckinsey.com, stats.stackexchange.com, openknowledge.worldbank.org, datacamp.com и др.

ЧТО ПРЕОДОЛЕЛИ...

#распределения_подобрать

#витрин_нет

#панели_достроить

#аналитик_не_хватает

#система_зависла

#определить_источники_данных

#глубина_данных_для_горизонта

#обновления_Cbonds_не_грузятся

#цепочки_алгоритмов_перестроить

#дать_доступ_к_формулам

#сходимость_данных

#справочники_выровнять

#время_стресс-тестирования_сократить

ЕСТЬ ИНСТРУМЕНТ ДЛЯ ИЗМЕНЕНИЙ



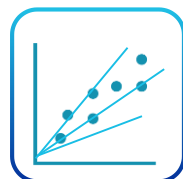
Платежный календарь:

- обработка 30 тыс. документов в день за 2,5 мин.
- 7 автоматических сценариев для решений по дефицитам и профицитам денежных средств.

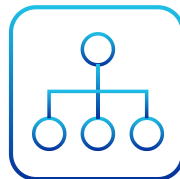


Моделирование финансовых сделок:

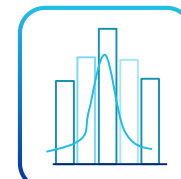
- встроенный конструктор сценариев моделирования;
- отчёты со сценарными и управленческими версиями;
- контроль лимитов по размещению средств.



Обеспечение точности прогнозирования на данных за 5 лет в объёме порядка 200 млн. записей.

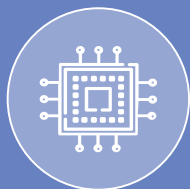


Модель прогнозирования из 700+ показателей на 30+ уровней расчёта.



Прогнозирование и стресс-тестирование для 10 000 итераций на полном объёме данных за 4-8 часов.

А ЧТО ДАЛЬШЕ?



Применение оптимальных методов искусственного интеллекта для прогнозирования ликвидности и управление финансовыми рисками.



Роботизация формирования, анализа и рассылки аналитической информации для выполнения корректирующих мероприятий владельцами процессов и систем по управлению рисками.



Определение детальных требований для разработки решения по управлению взаимоотношениями с банками, включая сбор истории взаимодействий.





НОРНИКЕЛЬ

BeringPro

