

ПРОБЛЕМА

В КОМПАНИИ СОЗРЕЛА ПОТРЕБНОСТЬ К ИЗМЕНЕНИЯМ, И ГЛОБАЛЬНАЯ СИТУАЦИЯ СТИМУЛИРУЕТ ЭФФЕКТИВНЕЕ УПРАВЛЯТЬ ДЕНЕЖНЫМИ РЕСУРСАМИ

Внесистемное моделирование для платёжного календаря:

- плановых дат платежей по зарубежному и мини-бизнесам;
- рекомендаций по конверсиям, внутригрупповым займам, взятию и покрытию кредитных средств, размещению депозитов;
- сценариев финансовых сделок.



Внесистемное моделирование сценариев финансовых сделок:

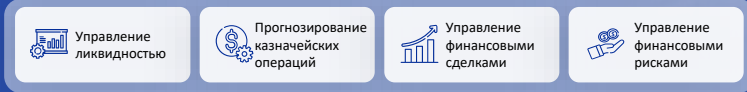
- ограничена комбинаторика параметров;
- затруднено формирование отчётности;
- сложно отслеживать лимиты по размещению средств.

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

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 ИННОВАЦИОННЫЕ ИНСТРУМЕНТЫ



ЧТОБЫ

- 1 Улучшить контроль за расходованием 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 предложены гипотезы по реализации.

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

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

Собран **проектный опыт** по реализации решений, закрывающих отдельные требования.

Проанализированы возможности **санкционных ИТ-продуктов**.

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

РЕШЕНИЕ

А ПОДХОДИТ ЛИ ЭТО НАМ?

РЕШЕНИЕ ДОЛЖНО ОБЕСПЕЧИВАТЬ:

- Использование для прогнозирования показателей выручки, оборотного капитала, операционной, финансовой и инвестиционной деятельности, налогов, курсов валют и др.
- Полнота и оперативность поступления данных из внутренних и внешних источников, включая макропараметры
- Структурирование и приведение данных к единому виду
- Максимальная автоматизация процессов управления ликвидностью, финансовыми сделками
- Расчет годовых и среднесрочных финансовых прогнозов
- Стресс-тестирование ключевых показателей
- Понятная и удобная визуализация результатов
- Обеспечение высокой производительности



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 КАЗНАЧЕЙСТВО» на базе нескольких лучших 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:

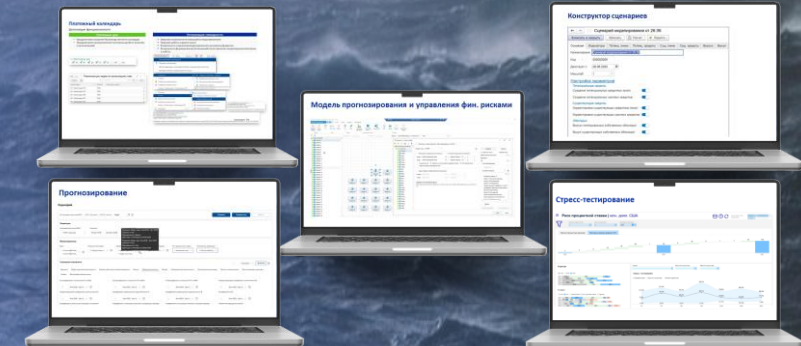
- Статистические модели временных рядов,
- Эконометричные модели с причинно-следственными связями.

ШАГ 3

Определение перечня параметров методов прогнозирования для повышения точности расчетов прогнозов.

РЕЗУЛЬТАТ

ЧТО ЖЕ МЫ ИМЕЕМ?



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;
- 5 отчётов 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 управления 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.



- Олег Сусликов**
Представитель функционального Заказчика

Евгения Тропина
Партнер проекта

Егор Беляев
Руководитель проекта

Дмитрий Ларионов
Руководитель проекта

Марина Агеева
Архитектор по прогнозированию и управлению фин. рисками

Юлия Балычева
Архитектор по управлению ликвидностью

Роман Кайгородцев
Архитектор по финансовым сделкам

Богдан Бельский
Архитектор 1С

Денис Тутаров
Архитектор Форсайт

Анна Елистратова
Архитектор аналитических систем

100+
человек на проекте