

TechEd | форсайт. | BeringPro®

Решение для казначейства по прогнозированию денежных потоков и расчету финансовых рисков



Роман Свиридов

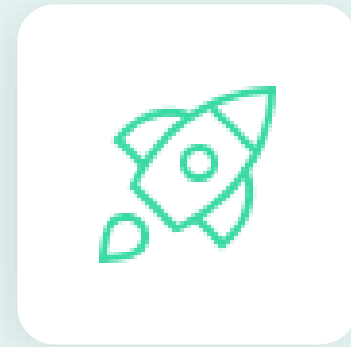
Старший менеджер
BeringPro
+7 (495) 580 97 25

Цели и задачи

BeringPro® | TechEd | форсайт.

Цель

Автоматизация казначейских функций по планированию и прогнозированию денежных потоков, оценке финансовых рисков.

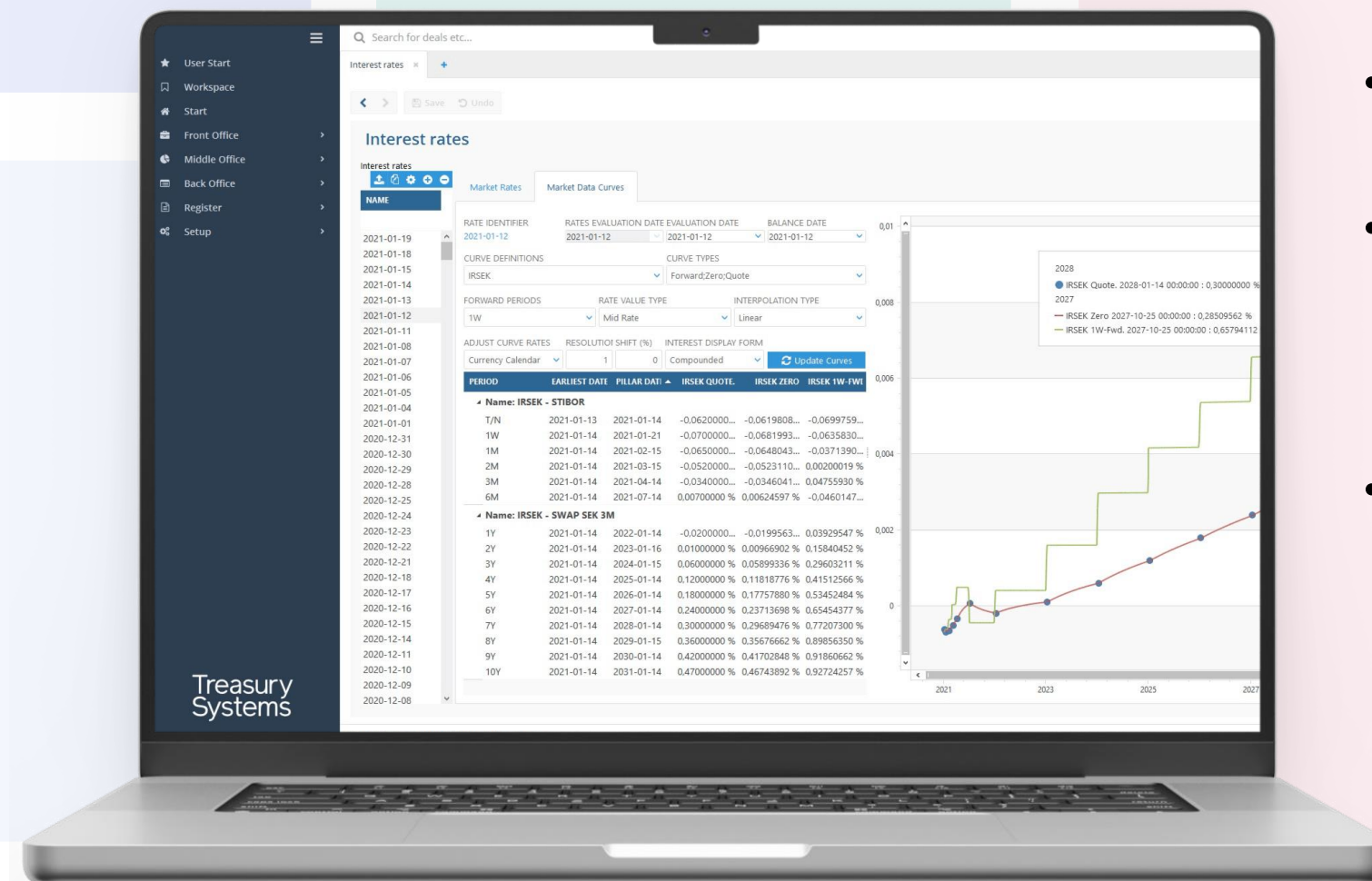


Функционал решения:

- **16 валютных пар** для управления ликвидностью с отражением в отчетности.
- **650+ показателей БДДС**, связанных с ликвидностью.
- **Стресс-тестирование:** цены на металлы, ставки, курсы валют и другие входящие в модель показатели.
- Прогноз БДДС на **3 года** с разной детализацией.

Ключевая задача

Разработка **модели прогнозирования** на базе российской аналитической платформы.



Предпосылки

BeringPro® | TechEd | форсайт.



Актуальные вызовы

1.

Необходимость **модернизации** системы расчета показателей прогнозирования и управления финансовыми рисками

2.

Условия рынка и скорость изменений окружения требует использования в прогнозировании самых **актуальных** и **полных** данных

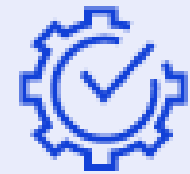
3.

Требование перехода на решение от **российского разработчика** на законодательном уровне



Бизнес-требования

BeringPro® | TechEd | форсайт.



Гибкость и автоматизация

- Возможность адаптации модели **своими силами**
- Работа с **актуальными** на текущий момент данными
- **Онлайн-интеграция** с внутренними и внешними источниками
- Интеграция с **ModelRisk** для **подбора параметров** распределений и **симуляции рисков** методом Монте-Карло



Аналитика и моделирование

- **Прогнозирование ликвидности** на 3 года
- **16** валютных пар, **650+** показателей, **2500+** строк модели
- **Стресс-тестирование** ключевых финансовых метрик для оценки устойчивости компании



Пользовательский интерфейс

- **Удобный** ввод данных и формирование отчетности
- Возможность работы через **web-интерфейс** прогнозирования и стресс-тестирования
- Работа в **едином** интерфейсе

Описание решения

BeringPro. | TechEd. | форсайт.



Оптимальный
набор
продуктов



форсайт.
аналитическая
платформа

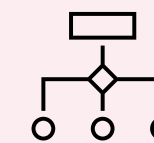
Программный продукт «Форсайт.
Аналитическая платформа» –
лидер в сегменте **бизнес-аналитики**.

Выбран за **универсальность**
и **гибкость интеграции**.



Основные возможности системы

- Интеграция с **КХД** и сервисом **Cbonds**
- Стыковка с **ModelRisk** для моделирования сценариев
- Интерфейс **создания сценариев** и настройки параметров модели
- **Удобная среда** для формирования отчетности и дашбордов



Функциональные модули

- **Интерфейс прогнозирования** – работа с алгоритмами, ввод данных, запуск расчетов
- **Интерфейс стресс-тестирования** – моделирование сценариев (метод Монте-Карло)
- **Отчеты** – преднастроенные аналитические отчеты
- **Дашборды** – визуализация результатов прогнозирования и стресс-тестирования

Архитектура



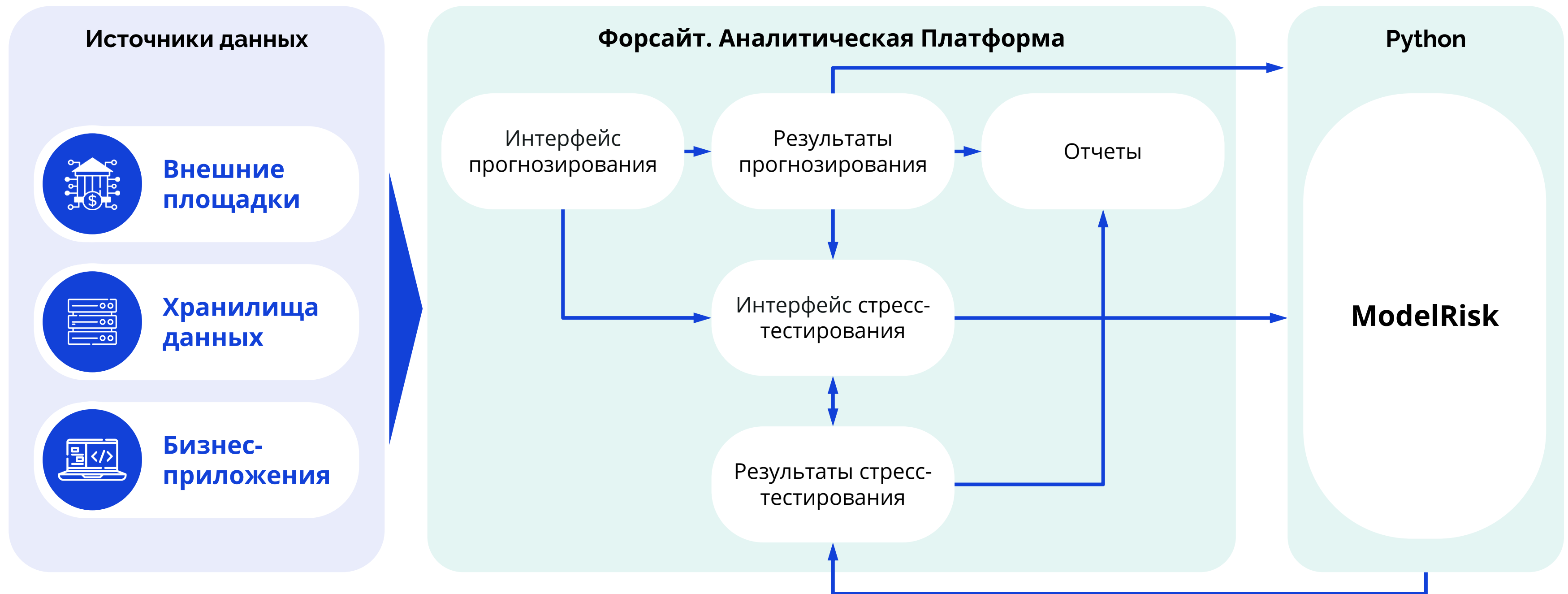
Прогнозирование

BeringPro®

TechEd

форсайт.

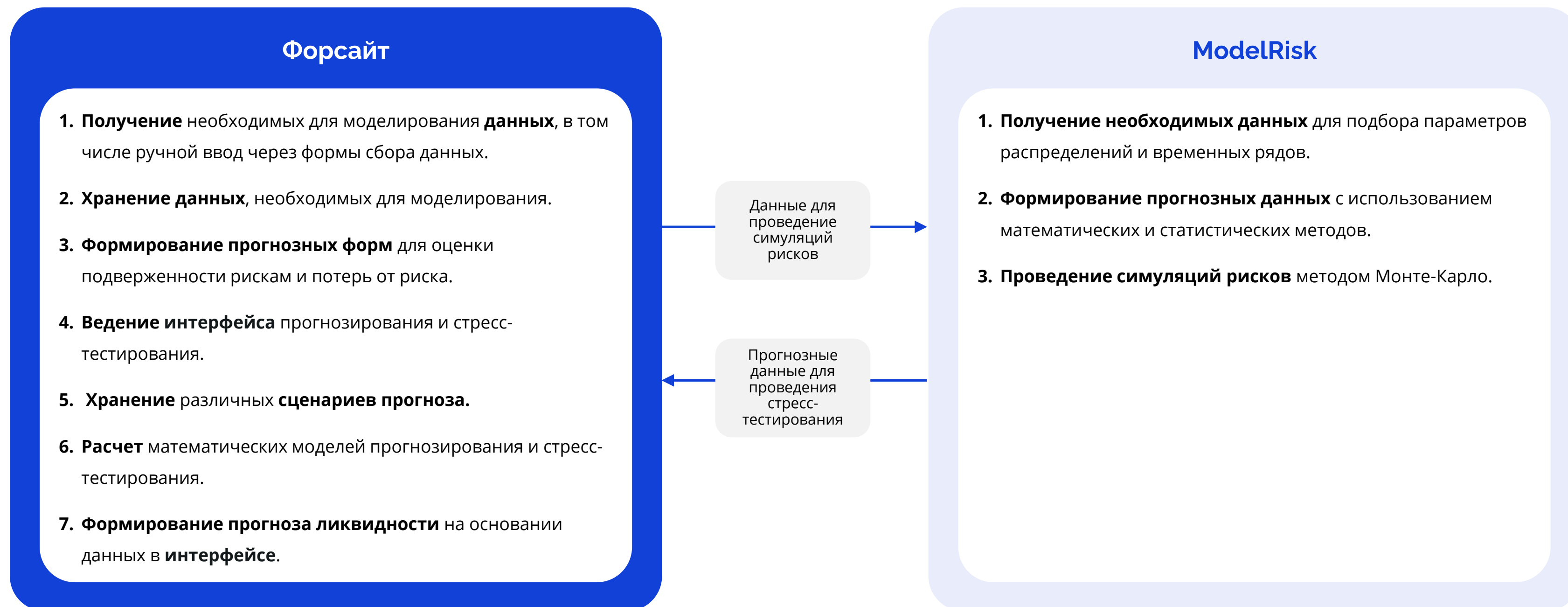
Верхнеуровневые работы расчета модели и стресс-тестирования



Форсайт и ModelRisk

BeringPro® | TechEd | форсайт.

Распределение функций прогнозирования



Достигнутые эффекты

BeringPro® | TechEd | форсайт.

Автоматизация прогнозирования денежных потоков с помощью «Форсайт. Аналитическая платформа» обеспечивает:



Ускорение расчетов по сравнению с legacy-инструментом



Радикальное снижение объема ручного труда в прогнозировании и отчетности



Большую достоверность ввиду использования актуальной информации и бóльшего объема исторических данных



Снижение санкционных и регуляторных **рисков** за счет использования решения от **российского разработчика**



TechEd

| форсайт.

BeringPro®

Спасибо за внимание!