



Измерение эффективности и результативности управления ликвидностью и прогнозирования ЛИКВИДНОСТИ

Тематическое заседание КС 5 ноября 2024 года

ГУЦК МФ Таджикистан

Результаты управления ликвидностью

Доля (%) платежей, которые не были произведены в установленный срок (из-за нехватки ликвидности), от общей суммы платежей (в стоимостном выражении) за месяц	0.01%	0.01%	0.01%
Соотношение непогашенных авансов или других заимствований у Центрального банка и общих ежемесячных расходов, %	-	-	-

Охват ЕКС

Остатки денежных средств на ЕКС под контролем Казначейства и доступные для выполнения обязательств (в национальной валюте)*	-	-	-
Общая сумма прочих остатков средств органов государственного управления в банковской системе (в национальной валюте) **	-	-	-
= $A/(A+B) \times 100$ процентов	25%	25%	25%

Прогнозирование ликвидности

Показатель	Июль	Август	Сентябрь	Среднее за 3 месяца
Доходы (прогноз), в национальной валюте, R_F	1.6 млрд	1.7 млрд	1.75 млрд	1.68 млрд
Доходы (фактически), в национальной валюте, R_A	1.65 млрд	1.68 млрд	1.76 млрд	1.7 млрд
Ошибка, доходы $ER = RA - RFRA \times 100\%$	3.38%	1.16%	0.5%	1.68%
Расходы (прогноз), E_F	1.7 млрд	1.8 млрд	1.7 млрд	1.73 млрд
Расходы (фактически)*), E_A	1.98 млрд	1.65 млрд	1.62 млрд	1.75 млрд
Ошибка, расходы $EE = EA - EFRA \times 100\%$	14.13%	8.67%	4.56%	9.12%
Чистое отклонение $E_b = RA - RF - EA - EFRA \times 100\%$	13.65%	7.37%	3.73%	8.25%