

最佳现金管理奖

新疆金风科技股份有限公司



“企业自主构建现金流预测模型，节省财务费用，激活闲置和沉淀资金的范例”

金风科技通过统计建模手段，梳理集团历年资金规律。建立适合金风的资金动态监控体系（包括五大模型），从而推演出未来时间资金的运行轨迹，对资金缺口进行初步预警。首先，在对最优现金持有量的预测方面，通过构造现金持有量损失函数，结合博弈论中“多方占优均衡”和运筹学中“约束条件下的最优结果”求解法，建立最优现金持有量预测模型（模型一）；其次，以资金链不断为假设前提，利用迭代算法，建立现金日记账校验模型（模型二）；此外，在集团的融资规模及融资时间判断方面，利用财务间接法结合数量经济学理论，建立经营活动产生的现金流净额预测模型（模型三）；最后，在资金的周转率预测方面，利用时间序列建模原理，建立存货周转率预测模型和应收账款周转率预测模型（模型四、模型五）。在建模过程中用到的统计检验方法有，pearson相关性检验法、Sargan检验法、自相关性检验法、Kruskal-Wallis H非参数检验法、Fisher精确概率检验法等。

实践结果表明，集团的资金动态监控体系具有较好的预测效果和应用价值。2017年，通过对融资规模 and 时间的预判和统筹规划，已为集团节约财务费用1.7亿元；通过激活闲置和沉淀资金，已累计实现投资收益5774万元。

公司简介

金风科技是全球领先的清洁能源解决方案供应商，是集风机研发制造、生产与销售，风电场及智能微网设计、建设运行维护一体的大型企业。拥有130多家子公司，业务遍及五大洲17个国家，经营范围覆盖清洁能源全产业链。

重点推荐

德邦物流股份有限公司



重点推荐

洛阳栾川钼业集团股份有限公司



合作支持机构



重点推荐

蚂蚁金服



合作支持机构

