

10 февраля 2026
Москва
Пресс-релиз

Новое решение на платформе EGAR Focus: конструктор модельных портфелей с оптимизацией

Компания «ЕГАР Технологии» представила новое решение «Конструктор модельных портфелей» на платформе EGAR Focus. Решение ориентировано на банки, инвестиционные и управляющие компании, которым важно быстро выводить на рынок новые инвестиционные стратегии и эффективно управлять портфельными продуктами в условиях меняющейся рыночной конъюнктуры.

В коробочной версии системы модельные портфели формируются из инструментов финансового рынка с применением алгоритмов оптимизации, в том числе на основе классической модели Марковица. Функция оптимизации портфеля обеспечивает расчёт ожидаемой доходности активов, уровня риска и корреляции между инструментами, позволяя максимизировать ожидаемую доходность при заданном уровне риска или минимизировать риск при целевом уровне доходности. Результаты расчетов могут использоваться как внутри платформы, так и передаваться во внешние системы – личные кабинеты, отчетные платформы, торговые системы, – обеспечивая сквозную автоматизацию процессов управления портфельными продуктами.

Одной из ключевых особенностей решения является высокий уровень гибкости и кастомизации. Решение позволяет адаптировать справочники и бизнес-логику под конкретные задачи заказчика, включая добавление новых атрибутов, финансовых моделей и алгоритмов оптимизации в систему, изменение процессов формирования портфелей и настройку дополнительных этапов согласования. Поддержка технологий искусственного интеллекта упрощает настройку и доработку процессов с учетом требований и стратегий управления активами различных клиентов.

Решение разработано на платформе EGAR Focus с применением технологий no-code и low-code. Это дает заказчикам возможность самостоятельно и оперативно расширять линейку инвестиционных продуктов, подключать новые инструменты финансового рынка и выводить актуальные стратегии без необходимости привлекать вендора. Такой подход обеспечивает быструю адаптацию коробочного решения под каждого клиента и существенно снижает время вывода новых портфельных продуктов на рынок.

Модуль применяется для формирования бенчмарков, сравнения модельных и реальных портфелей, разработки и распространения стратегий управления активами, а также для оптимизации портфелей финансовых инструментов с учетом заданных параметров риска и доходности. В системе предусмотрено хранение всей необходимой информации о портфелях, включая описания и сопутствующие материалы, а также передача данных во внешние системы или выгрузка в различных форматах.

Платформа EGAR Focus предназначена для оценки стоимости финансовых инструментов, мониторинга позиций, расчета прибыли и убытков и других аналитических показателей. Линия продуктов EGAR Focus предлагается на российском рынке для импортозамещения иностранных программных продуктов (таких как Finastra (Misys), Adenza (Calypso), Murex, SAS), поддерживает практически все существующие финансовые инструменты и позволяет решать задачи управления рисками и контроля лимитов для финансовых организаций различного профиля. Продукты компании «ЕГАР Технологии» разработаны на импортозамещенных компонентах и компонентах с открытым исходным кодом и зарегистрированы в Едином реестре российских программ Минкомсвязи РФ.

Источник: [EGAR Technology](https://egartech.ru)