

08 сентября 2026

Москва

Пресс-релиз

EGAR Focus объединяет ИИ, сценарный анализ, управление рисками и инвестиционные расчёты в едином рабочем пространстве

Компания «ЕГАР Технологии» представила новые возможности платформы EGAR Focus, которые помогают финансовым организациям быстрее принимать решения на основе данных: от моделирования гипотетических сделок и оценки VaR (Value at Risk — стоимости под риском) до расчёта доходности облигационных портфелей и контроля ключевых показателей на одном рабочем экране.

В платформе появился симуляционный терминал, позволяющий трейдерам и риск-менеджерам отвечать на вопрос «что будет с портфелем, если...». Пользователь может создать гипотетическую сделку, изменить котировки, кривые или поверхности волатильности и сразу увидеть влияние сценария на стоимость портфеля, лимиты и показатели риска. Расчёт выполняется тем же ядром, которое используется для боевой переоценки, поэтому результат симуляции соответствует будущему учётному результату. ИИ-ассистент помогает работать с симуляциями: объясняет результаты расчётов и предупреждения системы, подсказывает необходимые рыночные данные и позволяет создавать гипотетические сделки с помощью текстовых команд.

В составе терминала реализован расчёт исторического VaR (Value at Risk — стоимости под риском) и Expected Shortfall (ожидаемого размера потерь при наиболее неблагоприятных сценариях) с декомпозицией риска по валютному, процентному, ценовому факторам и волатильности. Пользователь может анализировать портфели и книги, определять инструменты — основные источники риска, изучать худшие исторические сценарии и видеть причины исключения отдельных инструментов из расчёта. Подготовка исторических данных также выполняется внутри платформы: котировки Московской биржи и курсы ЦБ РФ загружаются автоматически, дополнительные данные можно импортировать и контролировать их полноту без привлечения ИТ.

Для страховых компаний и компаний, управляющих активами, в EGAR Focus появился калькулятор инвестиций, который автоматизирует расчёт доходности облигационных портфелей с учётом реинвестирования купонов. Он формирует инвестиционные корзины по целевым горизонтам, учитывает доступные лимиты эмитентов и фиксирует историю каждого расчёта. На основе полученных результатов строится «гребёнка» доходностей по срокам — готовая основа для параметризации инвестиционных продуктов. Каждая рассчитанная величина сопровождается информацией о методе её получения, а утверждённые версии сетки можно передавать продуктовым подразделениям.

Новое рабочее пространство объединяет ключевые возможности платформы в виде виджетов на одном экране. Рыночные данные, расчёты, сделки и их статусы, утилизация лимитов, состояние интеграций теперь доступны без переключения между многочисленными отчётами и справочниками.

Источник: [ООО «ЕГАР Технологии»](#)