

29 августа 2024, Москва
Пресс-релиз

EGAR Technology: система управления рисками и контроля лимитов обновила функциональные и технологические возможности

EGAR Technology продолжает развивать функциональные возможности системы EGAR RLM для управления финансовыми рисками и контроля лимитов, предлагаемой на российском рынке для импортозамещения иностранных программных продуктов (таких как Finastra (Misys), Adenza (Calypso), Murex, SAS).

Одной из наиболее значимых доработок стала реализация механизма агрегации сделок под лимитом, данный механизм позволяет поддерживать масштабные объемы торгов, сравнимые с объемом торгов банков из топ-10 и крупнейших финансовых организаций, контролировать большое количество метрик, сохранить высокую скорость расчетов и проводить агрегацию сделок без снижения производительности системы.

Еще одной актуальной доработкой стало добавление пре-трейд контроля внебиржевых сделок на этапе ввода сделки, которая в связке с системой автоматизации операций на финансовых рынках позволяет контролировать лимиты и ограничения при заведении сделки.

В системе разработаны новые типы лимитов, в том числе с охватом метрик VAR с добавлением новых типов сделок фондового рынка и Stress Value at Risk, новый лимит на открытую валютную позицию с учетом фьючерсов на валюты и валютные пары. В лимит на максимально возможную сумму требований к контрагенту в день проведения расчетов добавлены новые подходы к определению неттинга по сделкам валютного рынка. В лимите на суммарный кредитный риск на контрагентов оптимизирован текущий алгоритм по операциям с валютой, добавлена логика для сделок с ценными бумагами и в отношении валют, по которым нужно производить дисконтирование платежей. В процессе новых разработок улучшена методология, которая используется для кастомизации базового набора лимитов под конкретные требования заказчиков, представляющих различные сегменты участников финансового рынка.

В рамках развития решения выполнено обновление модели данных, которое может использоваться для проведения доработок в том числе самими клиентами. Специалистами EGAR Technology проведены доработки по повышению стабильности работы EGAR RLM, в том числе переработаны подходы к автоматической загрузке лимитов из внешних систем, оптимизирована работа с базами данных, благодаря чему увеличилась производительность и скорость взаимодействия через API даже при высокой нагрузке.

Значительный пул обновлений выпущен в части удобства использования платформы. Улучшена гибкость индивидуальной настройки EGAR Risk & Limits Manager для повышения производительности расчетов, усовершенствованы средства диагностики событий. Осуществлено множество доработок для клиентов EGAR Technology по направлению риск-менеджмента и кастомизация согласно их бизнес-требованиям, проведены общие технические улучшения.

Решение EGAR Technology по управлению финансовыми рисками и контролю лимитов может быть развернуто на конфигурациях системного ПО с минимальными или без санкционных рисков, в частности, установлено на ОС Linux, с использованием СУБД Postgres и другими open source платформами с широкими возможностями для развития и сопровождения, в том числе силами Заказчика. Специалисты EGAR Technology, работающие на проектах импортозамещения, имеют значительный опыт работы с системами и продуктами западных поставщиков, прекративших заключение новых договоров и оказывающих минимальные услуги поддержки существующим клиентам на территории РФ.

EGAR RLM используется для задач управления финансовыми рисками в банках, инвестиционных, управляющих и страховых компаниях, негосударственных пенсионных фондах (НПФ), проводящих операции на денежном и валютном рынках, рынках ценных бумаг и деривативов, а также в кредитных организациях, осуществляющих документарные операции и оказывающих услуги кредитования, лизинга и факторинга.

Источник:

[EGAR Technology](#)