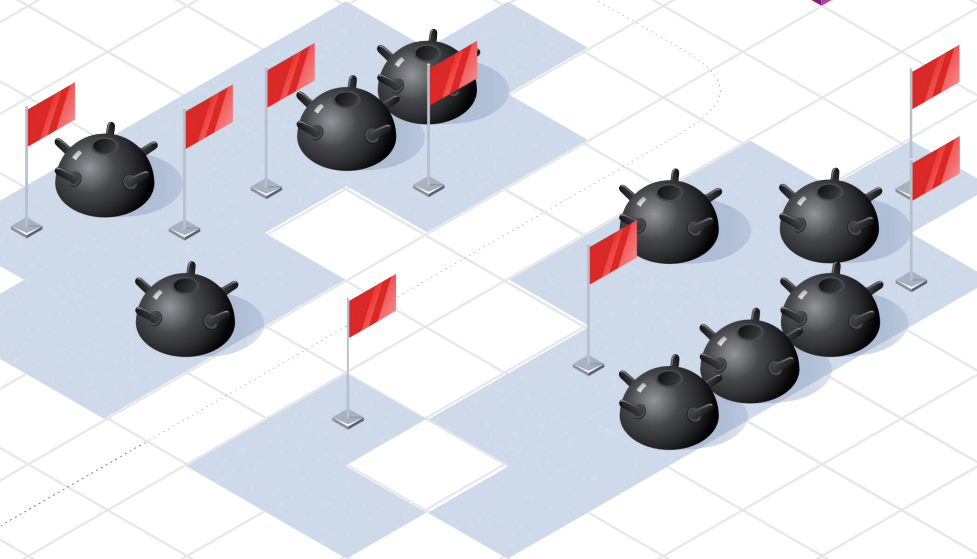


# ПРОГНОЗ. Рыночный риск



**PROGNOZ**

## ПРОГНОЗ. Рыночный риск

Программный комплекс «ПРОГНОЗ. Рыночный риск» обеспечивает автоматизацию процессов анализа и контроля рыночного риска портфелей финансовых процессов банка.

### Основные задачи

- Загрузка и обработка рыночных данных (Bloomberg, Reuters, ММВБ, РТС, Cbonds, Банк России)
- Фильтрация выбросов и восстановление пропущенных значений в ценовых рядах
- Статистический анализ данных, включая эконометрическое моделирование и расчет ковариационных матриц
- Интерфейсы для загрузок сделок из АБС
- Загрузка портфелей и/или расчет портфелей на основе информации по сделкам
- Оценка рыночного риска (Value-at-Risk, Conditional Value-at-Risk) на основе параметрического, исторического моделирования, моделирования методом Монте-Карло
- Контроль адекватности используемых моделей VaR (backtesting)
- Сценарное моделирование («Что будет, если..?»), включая режим стресс-тестирования
- Оценка безрисковых кривых бескупонной доходности на основе параметрических и сплайн-методов
- Оценка кредитных спрэдов по облигациям и группам облигаций
- Оценка процентного риска, включая оценку процентного риска для обязательств с фиксированной ставкой (анализ чувствительности, поддержка решений о рефинансировании) и с плавающей ставкой (Cashflow-at-Risk)
- Поддержка положения 313-П Банка России

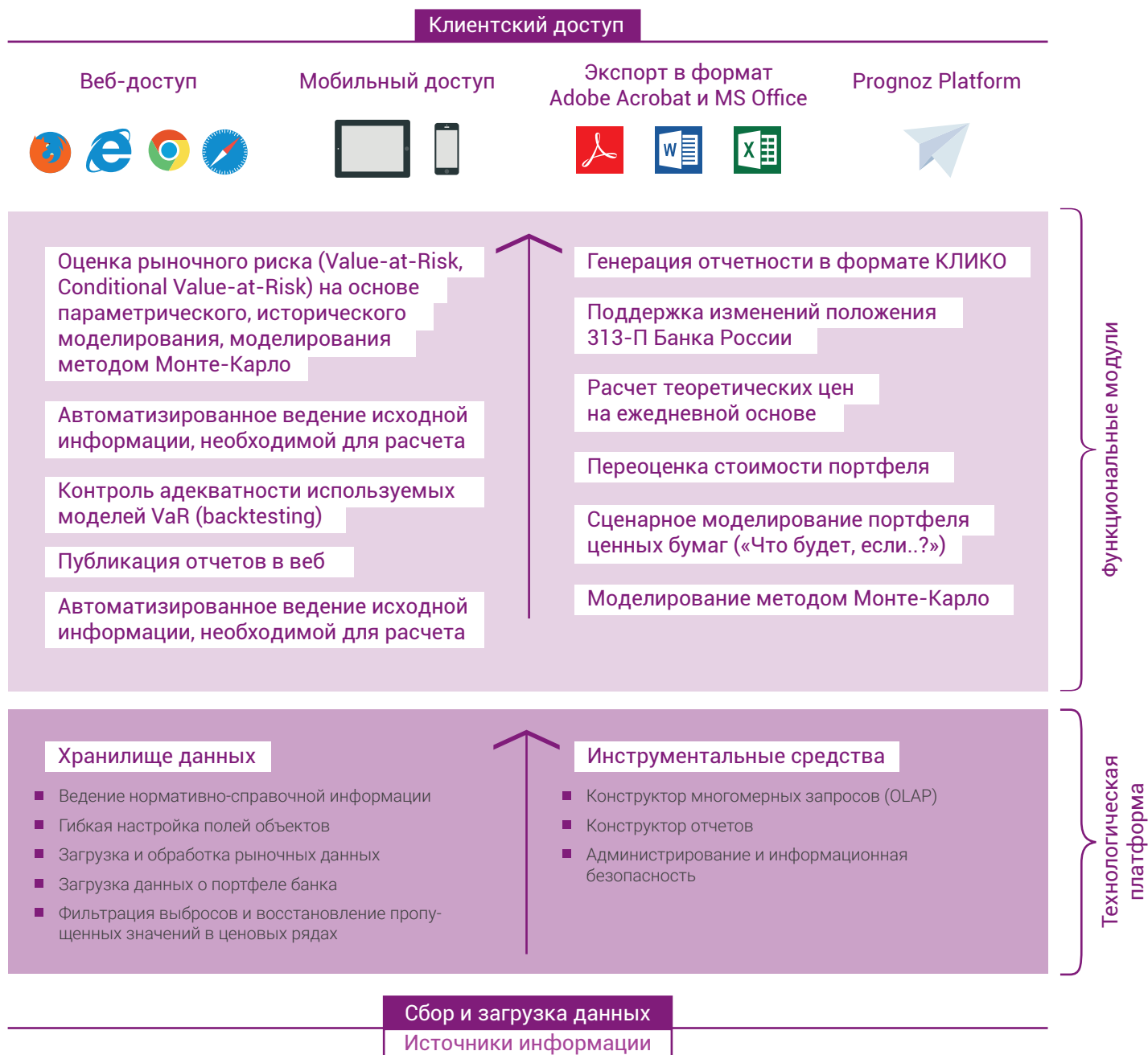
### Эффекты от внедрения

- Высвобождение человеческих ресурсов благодаря автоматизации рутинных операций по загрузке рыночной информации из разнородных источников и расчету оценки рыночного риска портфелей банка
- Повышение качества данных и достоверности результатов анализа за счет консолидации данных и централизованного хранения рыночной и портфельной информации
- Значительное снижение временных затрат на проведение таких трудоемких операций, как сценарный анализ и верификация VaR
- Соответствие системы риск-менеджмента в части рыночного риска современным требованиям (Basel II), что обеспечивает возможность присвоения более высокого рейтинга международными рейтинговыми агентствами и повышение уровня доверия к банку со стороны инвесторов

- Повышение скорости обработки информации за счет интеграции с существующими в банке информационно-аналитическими системами и полной автоматизацией загрузки портфельной информации

- Повышение эффективности резервирования капитала банка, что обеспечивает повышение уровня рентабельности банка

## Как это работает



- Итоги торгов ММВБ, РТС, данные Bloomberg, Reuters, информация ИА Cbonds, данные с сайта Банка России

- Возможность тесной интеграции с существующей ИТ-инфраструктурой банка

## Наши преимущества

- Наличие успешных внедрений системы в крупнейших банках и финансовых организациях (ВТБ24, Внешэкономбанк, Россельхозбанк, АСВ, НФА и др.)
- Возможность тесной интеграции с существующей ИТ-инфраструктурой банка
- Открытые алгоритмы расчета, возможность расширения функционала без привлечения разработчика
- Автоматизация загрузки рыночных данных из стандартных end-of-day источников
- Агрегация данных из нескольких источников, настройка правил приоритетов источников, очистки данных, фильтрации рядов и заполнения пропусков
- Визуальное представление данных в удобном для просмотра и анализа виде, гибкость функциональных настроек, экспорт отчетов во внешние форматы (MS Office, PDF)
- Комплексная поддержка работы пользователя

## Нам доверяют

