



## Управление инвестиционными портфелями в режиме реального времени

**Текст: Андрей Сыкулев, директор по развитию бизнеса компании «Синимекс»**

В последние годы все большую популярность приобретают решения, построенные не на традиционных реляционных базах данных, а на так называемых «key-value» хранилищах. Особенности таких СУБД являются феноменальное быстродействие, масштабируемость и отсутствие ограничений на структуры данных. Достигается это за счет того, что СУБД целиком размещается в оперативной памяти и поддерживает только операции прямого доступа по ключу. Надежность в таких СУБД обеспечивается посредством периодического сохранения информации на обычные дисковые носители и за счет ведения полного журнала изменений.

Как правило, применяются такие СУБД для создания решений в областях, в которых гарантированный уровень быстродействия является критическим фактором. Для инвестиционного банкинга это, прежде всего, решения, непосредственно поддерживающие торговлю, в том числе, автоматизированную. Но не только.

Сегодня я хочу рассказать про решение, которое можно отнести даже не к «фронту», а скорее к мидл-офису – это решение для управления инвестиционными портфелями, разработанное американской компанией «Адвент», партнером которой в России является компания «Синимекс».

Geneva® – это полнофункциональное решение по управлению портфелями ин-

вестиций, которое охватывает весь спектр бизнеса, поддержка принятия решений для фронт-офиса, автоматизация функций мидл-офиса, начиная от регистрации сделки до ее согласования, а также неограниченные возможности по формированию отчетности в различных разрезах: по инвесторам, фондам и портфелям.

Geneva была разработана специально для поддержки сложных инвестиционных продуктов и используется более чем в 230 компаниях по всему миру. Geneva поддерживает инвестиционные инструменты любой сложности, любые типы транзакций, любые валюты.

Исчерпывающий охват инвестиционных инструментов, реализованный в Geneva, исключает применение «обходных» решений и «ручную» обработку, что, в свою очередь, исключает ошибки и дорогостоящие задержки в обработке сделок. Система поддерживает любые инвестиционные инструменты, включая следующие:

- акции и их производные;
- инструменты с фиксированным доходом, включая бумаги, обеспеченные активами;
- фьючерсы, опционы, права и гарантии;
- банковские кредиты и кредитные линии – как в одной валюте, так и мультивалютные;
- сложные деривативы, такие как процентные свопы, свопы на полный доход, контракты на разницу цен (CFD), кредитные дефолтные свопы и другие кредитные деривативы.

Используя текущую информацию о торгах, получаемую с Bloomberg или дру-

гих площадок, Geneva рассчитывает итоговые суммы в режиме реального времени.

Geneva предоставляет широкий выбор готовых сводных панелей (dashboards) по P&L, эффективности, рискам, прогнозированию, позволяя отслеживать консолидированные P&L и риски по портфелям в режиме реального времени с точностью до секунды. Встроенный визард для построения сводных панелей позволяет персонализировать готовые панели или создавать новые, при этом система обеспечивает доступ ко всем хранящимся в ней данным, позволяет легко их находить и использовать.

Geneva управляет процессами обработки совершенных сделок во фронт-, мидл- и бэк-офисе, позволяя пользователям отслеживать жизненный цикл сделки от регистрации до согласования и оплаты – все в одной системе.

Реализована прямая интеграция с поставщиками рыночной информации, OMS, системами управления рисками и другими системами, что позволяет без дополнительной разработки вести все сделки, независимо от их источника, в одном общем журнале сделок.

Система позволяет проводить сверку данных с данными из любого внешнего источника: денежные расчеты, позиции и транзакции сверяются с внешними контрагентами. Она также обеспечивает необходимую гибкость при определении правил реконсолидации и при обработке несоответствий, предлагая для этого удобный интерфейс.

Уникальная архитектура Geneva позволяет поддерживать любые объемы торговли для фондов любых размеров, от стартапов до всемирно известных лидеров с самыми высокими требованиями к ПО. Весь учет по портфелям, включая ввод и обработку сделок, внесение поправок и корректировок, создание отчетов, выполняется в режиме реального времени, а это является гарантией того, что, как только сделка введена в систему, она немедленно отражается во всех отчетах, сводных панелях и итоговых суммах. <sup>1</sup>

### АКЦЕНТ

Geneva включает в себя пакет из более чем 150 стандартных отчетов и простой в использовании конструктор запросов, который дает возможность:

- получать доступ к отчетам через веб, PDF, Excel и XML;
- автоматизировать процесс генерации и рассылки отчетов подписчикам;
- строить иерархические и кросс-отчеты;
- воспроизводить любые отчеты за любой интервал времени (система ведет полный журнал изменений и хранит исторические данные);
- создавать отчеты по позициям, P&L и эффективности (с учетом или без учета комиссий) в различных разрезах, по фондам, стратегиям, отраслям, контрагентам и т.д.