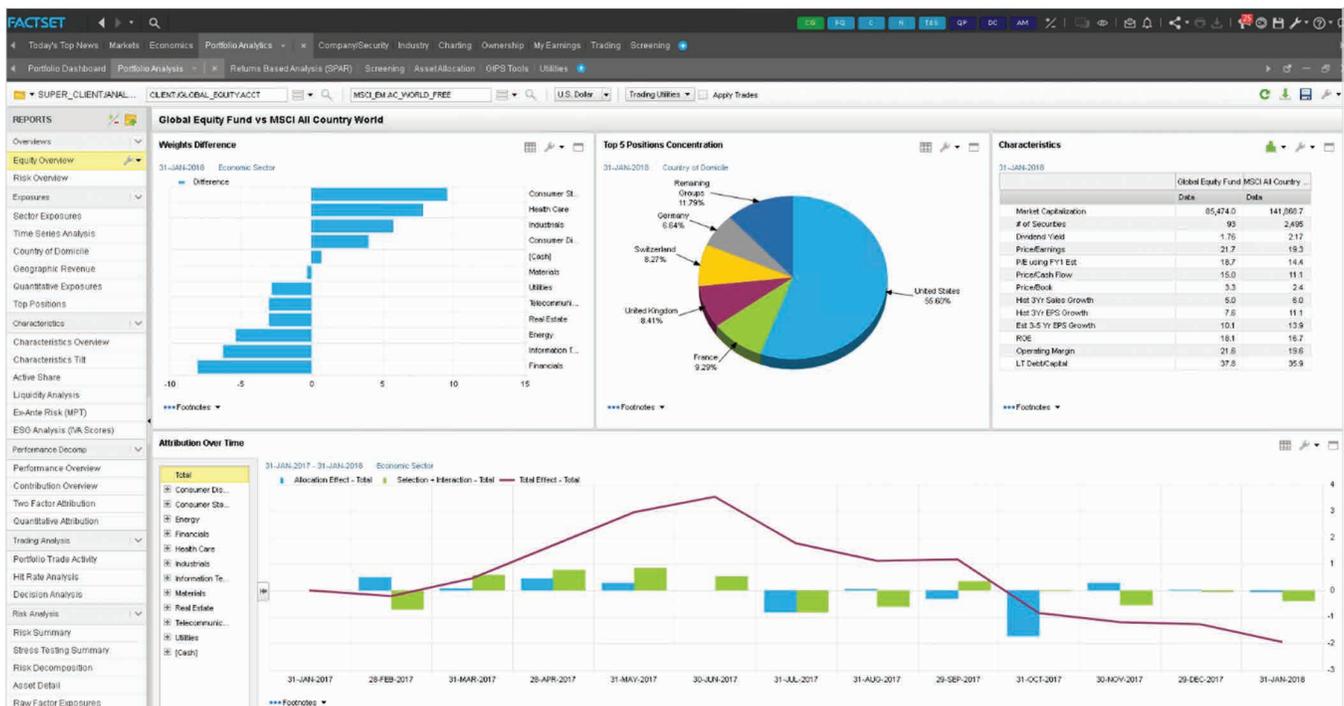


# 投资组合分析

运用 FactSet 行业领先的多资产投资组合分析，助力绩效、归因、风险和报告工作流程。



## 理解组成和风险

可以灵活地基于绝对基准或指定的相对基准，分析投资组合当前或历史上的风险敞口。使用汇总和个券报告查看多种指标，包括权重、估值指标、评级以及投资组合和基准的其他比率。衡量整个投资组合中的数百种基本特征和衍生分析，包括股票、固定收益和相关衍生产品。分解投资组合的绝对风险和相对风险，包括因子贡献、压力测试和极端事件分析。识别投资组合漏洞，并检查资产和投资组合级的风险驱动因素。

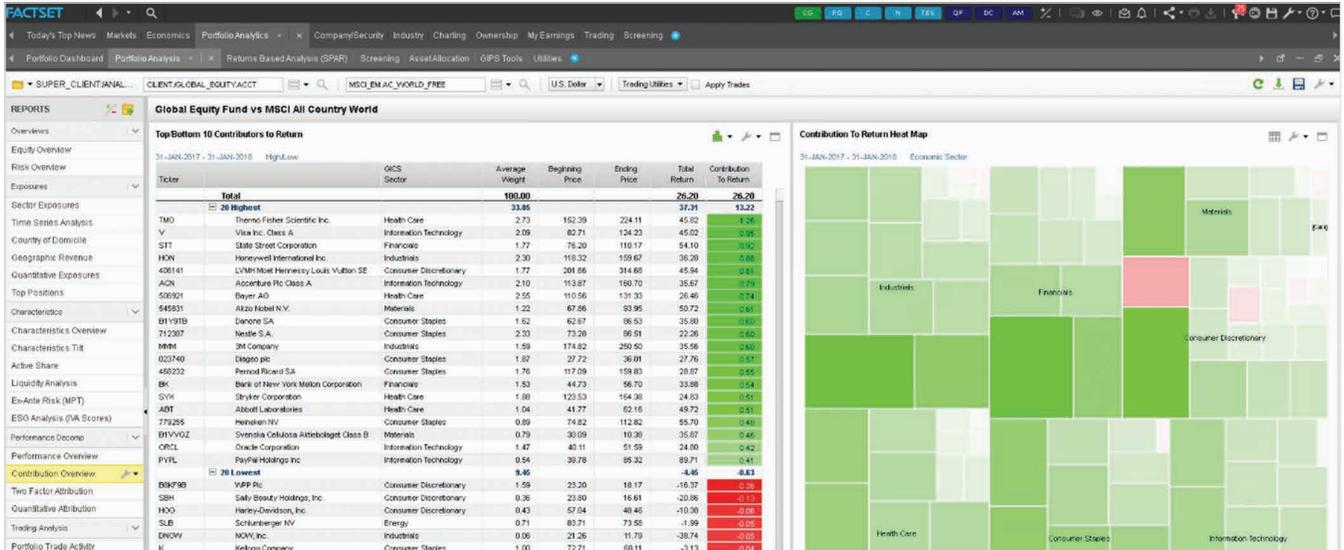
## 评估相对收益和绝对收益

了解诸如证券选择、分组配置和货币倾斜等管理决策可能对投资收益带来的影响。

- 分解投资组合收益到各个组别，例如资产类别、国家/地区、行业部门或专有内部因素

- 使用几种复杂的归因模型评估相对绩效

- 运用双因素或三因素归因来确定投资组合中的配置、选择和交互作用
- 依靠固定收益回报和绩效归因，更好地了解固定收益管理决策的影响
- 运用 FactSet 的均衡归因模型进行灵活的多资产类别分析
- 使用宏观归因模型分析 FOF（基金中的基金）及资产配置策略
- 使用 FactSet 的被动归因模型，更好地了解被动投资组合的跟踪误差
- 使用 FactSet 的决策分析归因模型，衡量由买卖时机带来的收益贡献



**利用直观报告更加智能地工作**

利用更快的报告和并行计算来提高效率并实现快速分析。

- 在 FactSet 的投资组合仪表板中自动计算并监控您的投资组合
- 利用 FactSet 的报告缓存节省时间,以便每天早晨启动 FactSet 时就可以使用您的分析
- 使用自定义排序、简单的格式设置选项、以及分组视图或展现个券详细信息的快速视图来动态检查报告和图表
- 通过投资组合的特定设置,以轻松生成可以即刻用于报告演示的整体报告,并可将其导出为 PDF 文档
- 分析背后的运算完全透明,可以验算组合层面,分组层面和个券层面的计算结果

**从绩效和归因工作流程功能中获益**

利用 FactSet 投资组合分析存储库功能增强绩效和报告工作流程,从而获得更大价值。利用可自定义的配置、计算计划和视图以存储、验证、锁定和检索绩效和归因结果。授权终端用户访问、交互和分析预先计算的指示性结果和官方结果的同时,对绩效信息进行有效管理。以实现更准确、可靠和灵活的数据发布。

**无缝整合数据**

将您专有的持仓数据与 FactSet 专属或第三方数据源整合,包括广泛的基准数据和全球交易所指数。通过每晚上传或与您的托管机构、主要经纪商或者公司会计系统对接,将您的持仓数据和交易流水整合到 FactSet。利用 FactSet 投资组合服务来确保对公司各资产类别投资组合数据进行安全、准确、一致的隔夜处理。实时访问我们的监控、协调和数据管理流程;扩展您的公司运营规模,同时尽可能减少资源密集型运营工作,即对公司各个部门中集成、协调和标准化数据的处理;同时跟踪您的数据工作流程,监控内部数据检查,并将数据问题直接传达给您的投资组合服务支持团队。

**为您的工作流程提供独特的内容**

运用 FactSet 性能卓越、完全整合的内容库,来查找复杂问题的答案。

- 集成第三方内容以更好地了解您在 ESG 上风险敞口
- 将投资组合的收入部门细分到不同区域、国家/地区、经济部门和行业
- 轻松识别公募基金、交易所交易基金 (ETF) 或其他内部资产的基础资产
- 通过设置阈值来确保您的投资组合根据合规性准则或风险承受能力进行投资