

ポートフォリオ分析

業界トップクラスのマルチアセットクラス対応ポートフォリオ分析機能
パフォーマンス計測、要因分析、リスク管理、レポート業務の効率化業務を強化



構成とリスクの理解

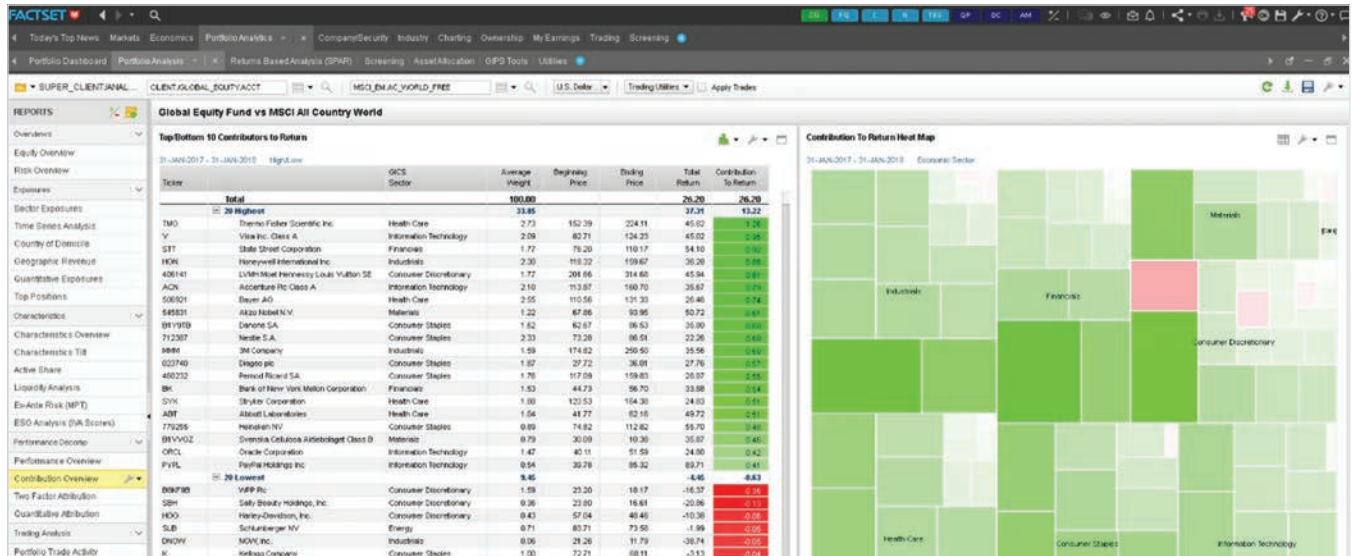
現在及び過去時点のポートフォリオのエクスポージャーを、絶対ベースまたは指定ベンチマークに対する相対ベースで容易に分析が可能です。全体、グループ、銘柄単位で、ポートフォリオとベンチマークのウェイト、特性値、レーティング、その他レシオなどの項目を表示します。株式、債券、デリバティブを含むポートフォリオ全体に対して、様々なファンダメンタル特性や派生データを計算します。リスクファクター別要因分析、ストレステスト、イベント分析等により、ポートフォリオの絶対及び相対リスクを測り、ポートフォリオや構成資産単位の脆弱性やリスクを調査できます。

絶対及び相対パフォーマンスの評価

銘柄選択、資産配分、通貨分散等の投資判断が、パフォーマンスにどのような影響を与えたかを理解できます。

- 資産クラス、国、セクター、独自区分に基づいてパフォーマンスを分解できます

- 複数の要因分析モデルを使用し、相対パフォーマンスを評価できます。
 - プリンソン要因分析より、銘柄選択、資産配分、相互効果によるパフォーマンスへの寄与を分析
 - 債券のリターン及びパフォーマンス要因分析より、債券運用における投資判断の影響を分析
 - ファクトセットのバランス要因分析モデルより、マルチアセットのポートフォリオを分析
 - マクロ要因分析モデルより、ファンド・オブ・ファンズポートフォリオやポートフォリオ内の資産配分戦略を分析
 - パッシブ要因分析モデルより、パッシブポートフォリオのトラッキングエラーを分析
 - ファクトセットの投資判断分析モデルより、マネージャーによる売買の判断やタイミングの適正性を測定



レポート作成業務の効率化

計算及びレポート作成処理を高速化し、レポート作成業務の効率化を実現します。

- ポートフォリオダッシュボードではポートフォリオ全体単位のパフォーマンス、特性値、リスク等を自動計算します。
- レポート・キャッシュ機能を使用することで、指定した時間にポートフォリオ分析の計算処理をバックグラウンドで行い、ポートフォリオ分析画面の起動と同時にキャッシュされた計算結果を確認できます。
- ソート機能やフォーマット設定、グループおよび銘柄レベルのウィックビューを使用し、様々なレポートやチャートを作成できます。
- プレゼンテーション資料に直接活用でき、PDFドキュメントとしても出力可能なポートフォリオ毎のレポートを簡単に生成できます。
- 銘柄、グループ、ポートフォリオ単位の算出値の背後にある計算ロジックやデータを確認でき、透明性を確保します。

パフォーマンス測定と要因分析のワークフローをサポート

ファクトセットのPortfolio Vaultを活用し、カスタマイズ可能な設定項目やインターフェースを通じて、パフォーマンスや要因分析の結果を格納、検証、ロック、連携することができます。アーカイブされたポートフォリオ分析の結果は一元的に保管され、閲覧や将来的な再取得が可能となります。ポートフォリオ情報、外部ベンダーデータ、計算結果に関して、ファクトセットの機能を使いながら、組織全員が一貫した共通のデータを活用することができます。

シームレスなデータ統合

独自の保有資産とファクトセットのコンテンツや膨大なベンチマークや各国の取引所が公表する指数データ等を含む様々なサードパーティデータソースを分析に組み合わせることができます。夜間自動アップロードや、カストディアン、プライムブローカー、会計システムとの接続により、保有資産やそれらの売買取引情報をファクトセットに統合できます。ファクトセットのポートフォリオ・サービスを活用し、安全で正確、且つ一貫した全資産クラスに渡る保有データの統合処理を確保します。また、リアルタイムでデータの監視、調整、管理を行い、部署や部門毎に存在するデータの統合、調整、標準化といった負荷の高い業務を最小限に抑えられます。データワークフローの追跡、内部データチェックの監視、ポートフォリオ・サービスのサポートチームへのデータに関するお問い合わせも可能です。

ワークフローに独自のコンテンツを提供

ファクトセットの業界最高クラスの統合コンテンツ・セットを使用し、複雑な課題を解決します。

- サードパーティのESGデータを統合し、ESGエクスポージャーをより的確に把握
- 地域、国、セクター、業界毎にポートフォリオの収益セグメントを分解できます
- 投資信託やETFの構成資産をルックスルー
- コンプライアンスガイドラインやリスク許容度に従った運用状況を確認する為の閾値を設定