

2004年9月29日

各位

バーラ・ジャパン株式会社

〒105-0013 東京都港区浜松町 1-18-16

住友浜松町ビル7階

TEL:(03)5402-4150 FAX:(03)5402-4154

## **「Cosmos System™ Global Risk Manager 3.2」リリースのご案内**

この度弊社では、新たな日本債券分析モデルとして、Cosmos System GRM 3.2をリリースいたしました。Cosmos GRM 3.2では、従来の日本債券分析モデルであるCosmos Japanから、お客様が持つより幅広く高度な分析ニーズに対応するため、リスクモデル、アプリケーション、データベース構造の大幅な見直しを実施いたしました。そしてこの新しい債券分析モデルであるCosmos GRM 3.2は、銘柄カバレッジの拡大や円建て債券のクレジットスプレッド分析機能の拡充、さらに今回新たに搭載された各種新機能により、より高度な日本債券ポートフォリオのリスク分析をサポートいたします。特に代表的な新機能は以下の通りです。

金利スワップ、金利先物、海外のインフレ連動債、プレイディ債の分析機能の追加

ユーザー登録を行うことにより、金利スワップと金利先物をポートフォリオに含めた分析が可能になります。また、弊社提供データベースにおいて、海外のインフレ連動債とプレイディ債のカバーを開始しました。

新たなリスクモデルの導入と日本債券分析のためのより詳細なスプレッドファクターの採用

リスクモデルとしてバーラ・インテグレートッド・モデル (BIMf) を導入し、円建て債券のみならず外貨建て債券をも含めたポートフォリオの一貫した分析が可能になりました。また今回のCosmos GRM 3.2では、国内債券に特化したスプレッドファクターを採用し、国内債券市場のセクター分類を反映したスプレッドリスクの評価が可能となりました。特に、社債スプレッドファクターを格付け別に細分化し、より精緻なクレジットリスクの分析を実現しています。

Cosmos Japanでは未提供の各種機能、レポートの提供

Cosmos GRM 3.2では、従来のCosmos Japanにおいて未提供の分析機能、レポートを多く備えております。(銘柄コードの拡充、為替関連商品を含めた幅広い銘柄データベースによる分析、複数のセクタースキームによる分析、各種分析レポートの追加、売買リスト機能、OLE(自動化ツール)、RiskAdd機能、データ更新プロセスの改善など)

Cosmos Japan に比べて、Cosmos GRM 3.2 は多くの面で分析機能と操作性が充実しており、国内債券の運用に携わるお客様の投資プロセスの効率化と高度化に大きく寄与するものと考えております。今後とも弊社製品へのご愛顧とともにお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

お問い合わせ：バーラ・ジャパン株式会社 東京サポートデスク (03-5402-4150) または東京セールス (03-5402-4152) 貴社担当のサポート・コンサルタントまでお願いいたします。