

プレスリリース

ABPインベストメントがリスク管理効率化のために、 バーラ社のBarra TotalRisk System™を採用

(2001年2月20日、米国カリフォルニア州、バークレー): Barra, Inc (ナスダック: BARZ) は同日付で、世界最大規模の年金運用会社の一つであるオランダのABPインベストメントが、同社の投資リスク管理のためにバーラ社の統合リスク管理システム(Barra TotalRisk System™)を採用したと発表しました。1500億ドル(約17兆円)を超える資産を管理するABPインベストメントの資産運用部門がバーラ社のTotalRisk™を選んだ理由は、TotalRiskが柔軟なアーキテクチャと包括的なビジネスレベルでのリスク分析機能の両方を兼ねそろえているからです。

ABP インベストメントのリスク管理部門を統括するティス・コーネン氏によれば、「ABP インベストメントは、アメリカの債券、オルタナティブ投資およびデリバティブなどを含む広範かつ複雑な資産を運用しています。そのため、こうした多種多様な資産に対応し、なおかつ全社レベルでのリスクを分析できるモデル理論及び機能を必要としていました。さらに、市場リスクと信用リスクを統合して効果的に管理することができ、当社の既存のシステムにも完全に適合するシステムを必要としていました。このバーラ社の TotalRisk があれば、リスク分解機能、ストレス・テスト、政策ミックスの作成、モンテカルロ・シミュレーション VaR およびパラメトリック VaR の計算など広範囲なリスク分析機能により、当社のトータルリスクやベンチマークや運用指針に対するアクティブリスクを積極的に管理することが可能となります。また、TotalRisk は、リスク・コントロール・ツールとして、投資ガイドラインを監視したり、顧客へ高水準のレポートニング及び情報の提供をすることも可能にします。」

バーラ本社、(Barra, Inc)の社長兼 CEO のカマル・ドゥギラは、以下のようにコメントしています。「我々は、ABP インベストメント社が顧客に対して優れたリスク管理を提供し、このビジネスにおいて世界で主導的立場となる過程で一助となれたことは大変光栄です。TotalRisk によって、ABP インベストメントの全社的なリスク測定が可能となり、高度なリスクバジェットの実施をサポートする独特のリスク管理システムを構築することができました。TotalRisk の複雑かつ広範囲の資産カバレッジと革新的技術によって、ABP インベストメントのポートフォリオ・マネージャーや会社の経営陣による日々のリスクの把握が可能となりました。」

ABP は、オランダの公務員と教職者のための年金資産運用会社です。1999 年末時点における資産は 1500 億ドルにのぼり、世界最大級の年金資産運用会社です。その資産は、オランダの年金の約 35% を占め、参加者数及び年金受給者数（公務員、警察、大学教職員、消防士などを含む）は 2200 万人に及びます。1999 年末における資産の内訳は、債券が 52%、株式が 40%、不動産が 8% です。ABP は、投資リターンを増やすために、債券から株式への配分比率の変更と、ストラクチャード・ファイナンス、事業債、モーゲージ証券やプライベート・エクイティなどの複雑な資産を含む長期型ポートフォリオへの比率増加を政策目標としています。

ABP の 3 分の 1 以上の資産がヨーロッパ外に投資されており、その全てが ABP により運用されています。ABP は自家運用ポートフォリオ、そして国際的な投資先のさらなる拡大を目指しています。ABP インベストメントは、特化型運用や革新的投資のために戦略的なパートナーとの提携を推し進めたり外部のマネージャーを採用しています。ABP の本社はオランダのハーレンに所在し、アムステルダムとニューヨークに支店をもっています。

問い合わせ先：バーラ・ジャパン(株)

03-5402-4152

The Barra logo features the word "Barra" in a blue, sans-serif font. A stylized, light blue graphic element resembling a curved line or a partial letter 'B' is positioned above the first 'B'.