

## プレスリリース

### CalPERSが組織全体のリスク管理にBarra TotalRisk System™を採用

(2001年3月13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、カリフォルニア州公務員退職年金基金のCalPERSが基金全体での資産リスク管理にバーラの統合リスク運用管理システム (Barra TotalRisk System™) を採用したと発表しました。1650億ドル(約20兆円)を超える資産を管理するCalPERSがバーラのTotalRisk™を選んだ理由は、TotalRiskが柔軟なアーキテクチャとリスク分析機能の両方を兼ねそろえており、かつ幅広いアセットクラスに対応しているからです。

CalPERSのリスク管理・資産配分を担当しているパトリア・ピンコス氏は、「CalPERSは、すべての資産クラスにまたがるリスクを明確に測定することができるリスク管理ソリューションを求めています。また、保有資産についてVaRを計算したり、ストレス・テストを行ったり、様々なシナリオ分析ができるようなリスク計算手法を模索してきました。バーラ社のTotalRisk™は、こうした分析機能を我々に提供し、全社レベルでの的確なリスク管理を可能にしてくれます。」と述べています。

バーラ本社の社長兼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。「年金基金最大手であるCalPERSは、彼らの保有する大量のデータをスムーズに融合し、なおかつゼンシャレベルでのリスクを計測する高度なリスク管理システムを必要としていました。我々は、CalPERSの戦略的なリスク管理の目標達成の一助となることができ光栄です。」

2000年12月31日時点において、CalPERSは75億ドル(約9000億円)をプライベート・エクイティ、110億ドル(約13兆円)を不動産、486億ドル(約6兆円)を債券、981億ドル(約12兆円)を国内外の株式に投資しています。

CalPERSは米国内で最大の公的年金基金です。同基金は、120万人を超える州および地方公務員とその家族の年金や健康保健サービスを提供しています。CalPERSについての詳細は、[www.calpers.ca.gov](http://www.calpers.ca.gov)をご参照ください。

Barra TotalRisk System™はバーラの業界標準のリサーチ、モデル、データと最先端のリスク管理アーキテクチャを融合した全社的リスク管理システムです。このシステムは、世界有数の資産運用会社、年金スポンサー及び信託銀行で利用されています。詳細は、[www.barra.com](http://www.barra.com)をご参照ください。

バーラ社はポートフォリオ管理及び全社的投資リスク管理の分野においてリスク管理システム及びサービスを提供する先駆的企業です。1975年の設立以来、『顧客がより優れた戦略的投資判断を行うための手段を提供する』という一貫したビジョンを持ち続けてきたことにより、バーラモデルはリスク管理における業界標準の地位を確立しています。詳細は、[www.barra.com](http://www.barra.com)をご参照ください。

問い合わせ先：バーラ・ジャパン(株)

セールス部門

03-5402-4152

The Barra logo features the word "Barra" in a dark blue, serif font. The letter "B" is stylized with a green, leaf-like shape above it.