



The Barra Aegis System™ Developer's Toolkit


世界で最も進んだ株式分析モデルをお客様独自のシステムに統合する開発キット

特徴

Barra Aegis System Developer's Toolkit は、Aegis System をお客様のニーズに合わせて、お客様独自の投資プロセスに統合するためのフレキシブルなツールキットです。Barra Aegis 株式分析モデルの分析プロセスを、C++・VB・VBA・HTMLなどを介して、お客様のシステムへ統合できます。このツールにより、世界約 50 ヶ国以上・35000 以上の銘柄をカバーする業界標準の Barra Aegis 株式モデルを、お客様のニーズに合わせたスタイルでご利用できます。また、幅広い自動化機能によりコスト削減も実現できます。

機能

- 膨大な数のポートフォリオの分析・最適化・シミュレーションなどの大規模バッチ処理が可能です。
- Barra Aegis 株式モデルのデータだけでなく、お客様独自のデータや他のベンダーからのデータを取り入れカスタマイズされたレポートを作成できます。
- お客様の運用プロセス、会計経理、その他の業務の目的や用途に合わせてシステムを構築できます。
- Barra Aegis 株式モデルを社内システムに組み込むことで、イントラネットを通してのアクセスも可能となります。インターフェイスは自由にデザインすることができます。



Model: JP Date: 2001-09-28 Calculate Risk

Browse Portfolio: D:\jpeqty\200110\20010928\CORE30.POR

Browse Benchmark: D:\jpeqty\200110\20010928\TSE1.POR

	Variance	S.D.
アクティブスペシフィックリスク:	16.721	4.089
トータルアクティブコモンファクターリス:	29.524	5.434
リスクインデクス:	31.581	5.620
業種:	17.581	4.193
国:	n/a	n/a
通貨:	n/a	n/a
コバリアンス:	-9.819	-
トータルアクティブリスク:	63.731	7.983 %
ベンチマークリスク:	513.466	22.660 %
トータルリスク:	766.704	27.689 %

アクティブリスクの詳細

■ アクティブスペシフィックリスク:	■ リスクインデクス:
■ 業種:	■ 国:
■ 通貨:	■ コバリアンス:

Assets in Portfolio	Asset ID	Implied Alpha	Weight	Price
信越化学工業(株)	4063	0.024425946	0.01318	3350
武田薬品工業(株)	4502	0.017964831	0.04554	5500
富士写真フイルム(株)	4901	0.019278005	0.019646	4100
(株)日立製作所	6501	0.030698865	0.024646	793
(株)東芝	6502	0.030397535	0.013667	456

カスタマイズしたインターフェイスでの Aegis 株式モデルの使用例です。

Barra Aegis System Developer ' s Toolkit の利用ケース

顧客サービスの向上

ビジュアル性に富む顧客向けレポートを自動作成できます。複数多種にわたるデータ、Aegis 以外の分析プラットフォームから出されるデータを一つのレポートに統合できます。

マネージャーの評価

ファンドマネージャーの運用を一極集中的に自動管理するシステムを構築することで、ファンドマネージャーセレクションにもご利用できます。

運用の向上

ファンドマネージャーに対しどのように運用ポリシーがリターンに貢献しているか、適切なフィードバックを与えます。どのポリシーが収益を生み、どのポリシーが損益を被ったかを明瞭に理解することができます。リターンに影響を与える恐れのある意図しないポリシーをファンドマネージャーに警告するシステムを構築できます。

リスクレポートと運用成績レポート

社内、社外の情報を統合したレポートが可能です。日本語でカスタマイズされたリスクレポートをイントラネットなどを通して複数のオフィスに配布または、会社のウェブサイトでレポートを発信することにより、リスク管理能力の高さをアピールすることも可能です。これによりリスク管理における共通の尺度を社内的、社外的に浸透させることが可能となります。

投資戦略のバックテスト

過去のデータに基づき、投資戦略の有効性を検証することができます。ポートフォリオ構築において顧客の設定したガイドライン、保有制約、マーケット感応度、又はユーザー定義のパラメーターを考慮することで、より理想的な投資戦略を構築することが可能です。

システム統合

バックオフィスの会計勘定システムとバーラ社のポートフォリオ分析システムを結び付けることにより双方のデータを自動的に統合し一つのレポートとして作成することができます。最新のポートフォリオのリスク、リターン特性をユーザー及び顧客のニーズに適った形で見ることができます。



お問い合わせ・ご連絡は
バーラ・ジャパン(株) 03-5402-4152 まで