



バーラ 中国株式モデル(CHE1)

中国株式ポートフォリオの
リスク管理・最適化ツール・パフォーマンス分析

Windows 版

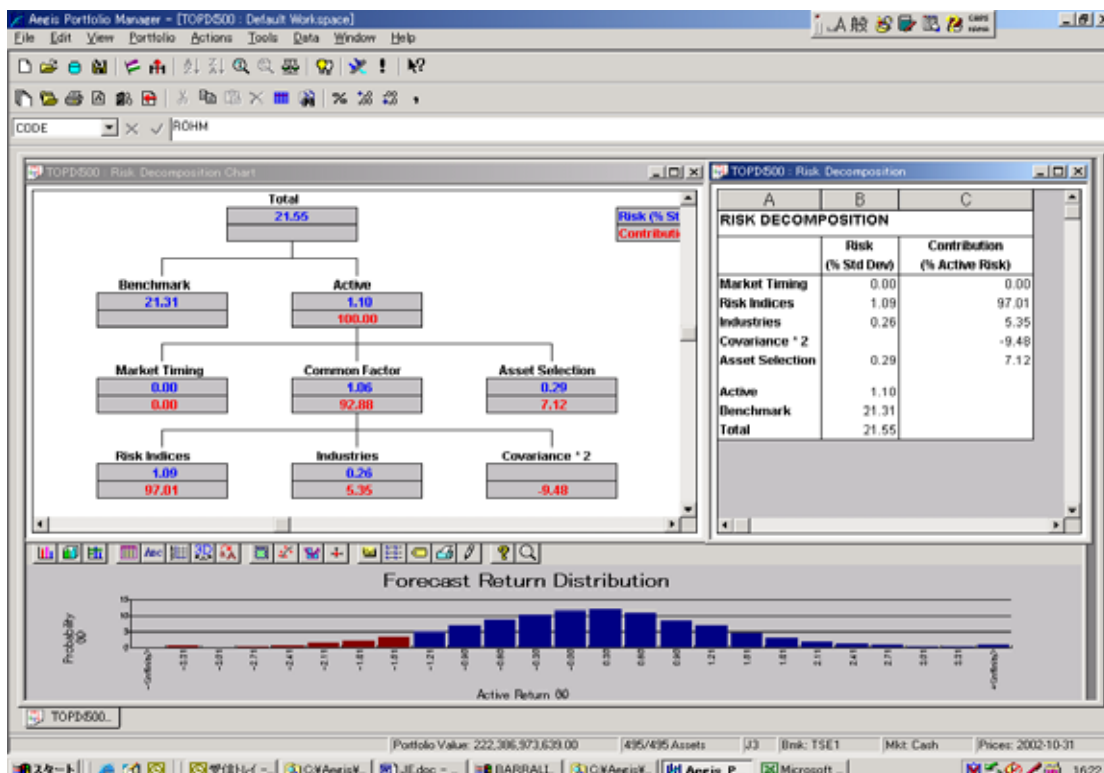
特徴

バーラ中国株式モデルは、バーラのリスク推定とファンドマネージャーの運用スキル、スタイルを組み合わせて最適なポートフォリオを構築し、リスク及びリターンの管理を行うツールです。バーラの業界標準のマルチファクターリスクモデルをもとに、7つのリスクインデクスファクターおよび19の業種ファクターにより構成されるコモンファクターと銘柄固有要因により銘柄・ポートフォリオのリターン/リスクを説明します。リスク分解チャート、詳細なエクスポージャー分析、トレードシミュレーションによる効用分析、条件設定を考慮した最適化処理、リターンの要因分析等幅広い機能によりファンドマネージャーの投資意思決定を効果的に支援します。オプション契約により日次データの取得も可能です。

機能

<Aegis Portfolio Manager >

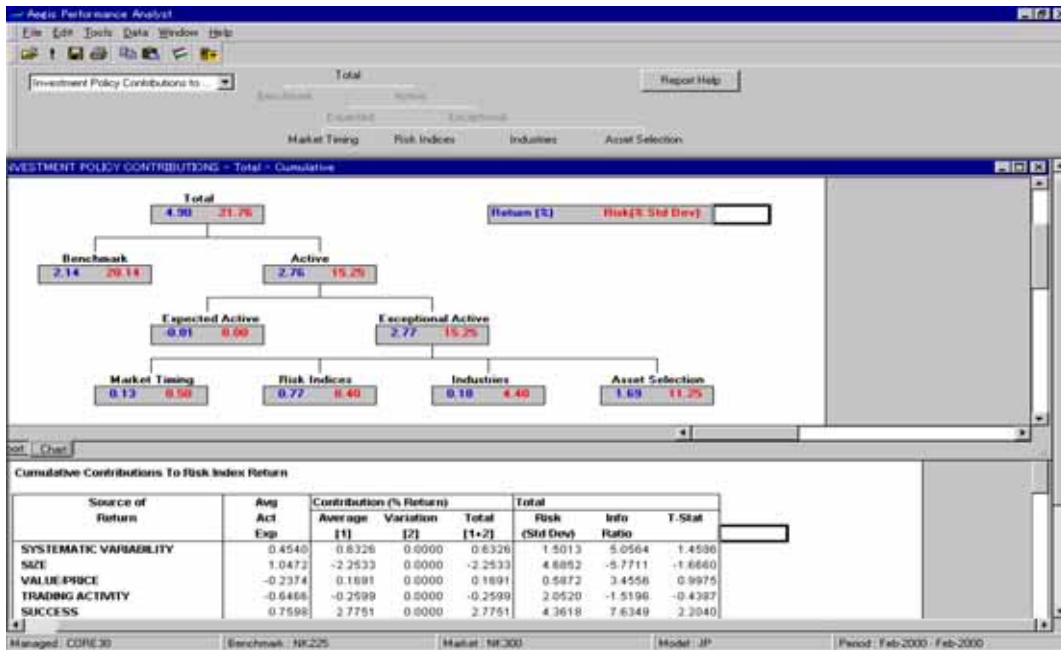
1. リスク分析・・・ポートフォリオのリスクを予測
 - 数十種類のレポートなどを通してポートフォリオのリスク特性を把握
 - 複数のポートフォリオを比較、統合した分析による各ファンドの相関や集計
2. 最適化処理・・・最適ポートフォリオの構築
 - 機能制約条件等を織り込みつつ、期待収益率、リスク及び取引コスト間のトレードオフ関係を表す効用関数を最大にする最適ポートフォリオを構築。ロング・ショートポートフォリオの構築も可能。



<Aegis Performance Analyst >

パフォーマンス分析・・・ポートフォリオのリターン計算&要因分析をする機能

- 投資方針の成否およびマネージャースキルの評価



コモンファクター

リスクインデクス

マーケットデータや

財務データから

作り出された

7個のファクター

インダストリー

独自のリサーチに基づく

19の業種分類

リスクインデクス	インダストリー	ベンチマーク
H株フラグ(China H-Share Flag)	自動車	インフラ建設
企業規模(Size)	化学	製造
配当利回り(Yield)	消費財	金属/鋳業
モーメントム(Momentum)	複合	不動産
市場感応度(Market Sensitivity)	電子機器	小売
ボラティリティ(Volatility)	エネルギー	通信
株価相対企業価値(Value)	金融	観光
	食品/飲料	運輸
	ヘルスケア	その他産業
	情報技術	

中国株式モデル (CHE1) 全 26 ファクター一覧

ベンチマーク

FT China、MSCI Free China、IFC China、IFC China Investable 等のベンチマーク指数を提供

銘柄カバレッジ

深セン A・B 株および上海 A・B 株の全上場銘柄、香港 H 株レッドチップ株

約 1500 銘柄をカバーしています。(2004 年 4 月現在)