

バーラ ヨーロッパ株式モデル

ヨーロッパ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

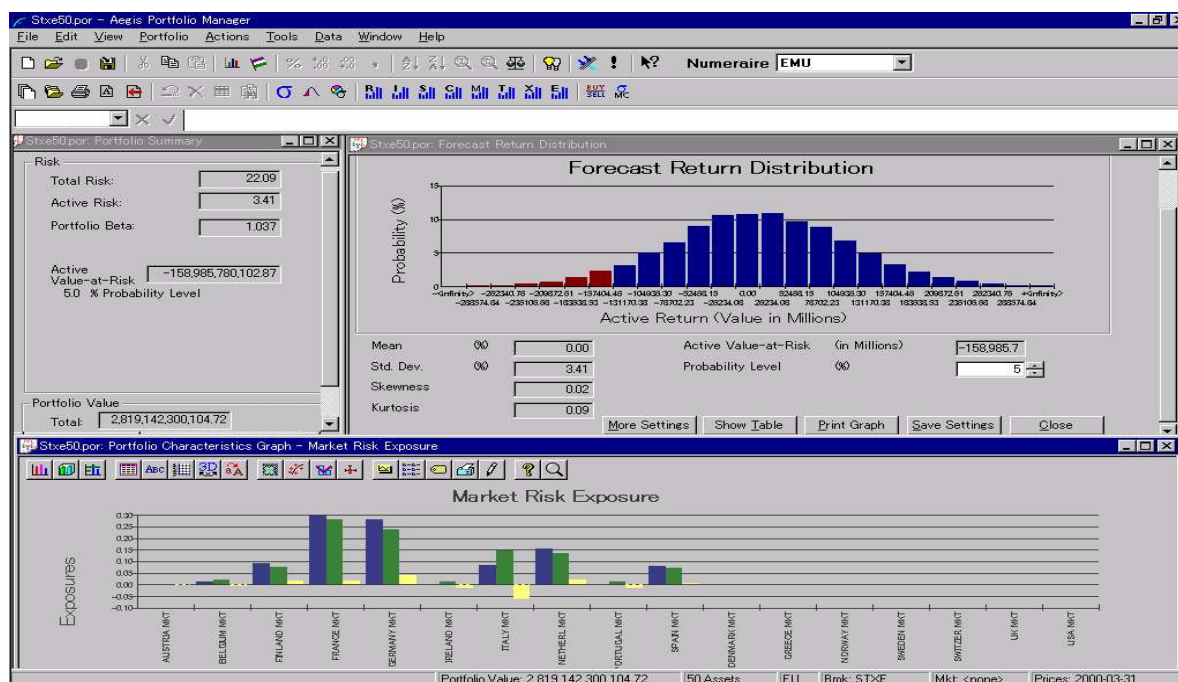
Windows 版

特徴

バーラ ヨーロッパ株式モデルは、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る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。運用ポートフォリオのベンチマークに対するアクティブリスク、アクティブエクスポージャーなどを月次で更新し、管理及びレポートに用いることができます。エクセル等からポートフォリオデータやアルファ値などを取り込むことや、既存のシステムと統合することも可能です。

機能

- ユーロ非参加国のマーケットも含めたヨーロッパ株ポートフォリオのリスク分析
- ポートフォリオの特性及びリスクを、MSCI, STOXX, FT 等のベンチマークと比較
- ポートフォリオのリスク要因・パフォーマンス要因を詳細に分析
- 複数のファンドを比較、総合した分析
- 様々なデータベースから銘柄をスクリーニングし、ユニバースポートフォリオを作成
- 期待リターン、制約条件等を指定し最適なポートフォリオの構築
- 顧客の目的に応じたレポートやグラフの作成



ポートフォリオのリスクをコントロール

ヨーロッパ株式ポートフォリオのリスク特性を分析し、評価・モニター・修正するための支援ツールです。

Countries	Industries	Risk Indices	Benchmarks	
Austria	Basic Resources	Investment Trusts	Size	MSCI
Belgium	Chemicals	Insurance	Momentum	MS Local Index
Finland	Automobiles	Healthcare	Market Sensitivity	FT
France	Entertainment and Leisure	Construction	Volatility	FT Local Index
Germany	Textiles(& Furnishings)	Aerospace (&Defence)	Growth	Dow Jones STOXX
Ireland	Travel	Industrial Services	Leverage	Dow Jones STOXX 50
Italy	Media	Industrial Diversified	Value	Dow Jones EURO STOXX
Netherlands	Retail	Industrial Equipment	Foreign Exposure	Dow Jones EURO STOXX 50
Portugal	Food	Transportation	Yield	Eurotop
Spain	Distillers & Brewers	Technology Hardware		Eurotop300
Denmark	Non-Cyclical Goods & Srevice	Technology Software		CAC40
Greece	Tobacco	Telecommunications		DAX
Norway	Energy	Utilities		MIB30
Sweden	Banks			AEX
Switzerland	Financial Services			FT100
UK	Real Estate			FTAll

等

ヨーロッパ株式モデル(EUE2)のファクター一覧

コモンファクター

9 種類のリスクインデクスファクター、 58 業種のファクター、 16 ヶ国のカントリーファクター、 7 通貨のカレンシーファクター。

インダストリー

UK 対応 29 業種と Continental 対応 29 業種を別のファクターとして定義し計 58 業種ファクター。

ベンチマーク

各国の代表的指数(CAC40, FT100, DAX 等)やMSCI インデックス、FT インデックス、Dow Jones STOXX インデックス等 150 以上のベンチマーク指数を提供。

銘柄カバレッジ

EURO 非参加国も含めたヨーロッパ 16 ヶ国の銘柄を広範囲にカバーしています。
7400 銘柄以上をカバーしています。(2004 年 6 月現在)

基軸通貨

統一通貨ユーロやユーロ非参加国通貨 UK ポンド等に加え US ドルでの分析も可能。

データ更新

バーラリスクと業種別エクスポージャーは月次で更新され、インターネット経由でお客様の PC にダウンロードされます。



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