



バーラ株式モデル Aegis System

マルチプルポートフォリオレポート (オプション)

Aegis のマルチプルポートフォリオレポート機能では、200 までのポートフォリオを次の項目で比較することができます。

- ファクターエクスポージャー
- リスク分解
- 相対リスク
- 相関

複数ポートフォリオを集計した統計値、全体としてのリスク値の他、複数ファンド間の相関を分析することが出来るため、大量なポートフォリオ分析を簡単に出来るだけでなく、会社全体としてのファンド管理及びリスクモニタリングにもご利用できます。

個々のポートフォリオはそれぞれのベンチマークを持つことが出来、すべてのポートフォリオを一つのマーケットポートフォリオと比較することができます。

サマリーレポート

個々のポートフォリオの基本情報（銘柄数、対象ベンチマーク、ベータ値、トータルリスク、アクティブリスク等）を表示します。

Multiple Portfolio Case 1: Portfolio Comparison					
Summary Factor Exposure Risk Decomposition Relative Risk Correlation					
Risk	Nk225	Nk300	Nk500	Tse1	
Benchmark	Nk300	Nk300	Nk300	Nk300	
Weight, %	52.85	21.14	10.57	10.57	
Assets	225	300	500	1,341	
Portfolio value	191,890,000	256,366,188,922,000	768,597,200	369,365,175,804,000	18,294,000
Cash, %	0.00	0.00	0.00	0.00	
Mkt. Beta	1.05	1.00	0.96	1.00	
Bmk. Beta	1.03	1.00	0.93	0.98	
Active Risk	5.18	0.00	7.44	2.77	
Total Risk	23.54	22.30	21.94	22.04	
Coeff. Determ.	0.03	0.00	0.02	0.00	

Print

リスク分解レポート

個々のポートフォリオのリスク分解を表示します。また、一番右側には分析ポートフォリオを集計したポートフォリオ(Aggregate Managed Portfolio)のリスク分解も表示されますので、複数のファンドを合計して会社全体としての運用リスクを算出する際に非常に便利です。

Multiple Portfolio Case 1: Portfolio Comparison

Summary | Factor Exposure | **Risk Decomposition** | Relative Risk | Correlation

Risk	Nk225	Nk300	Nk500	Tse1	Otcip	Aaar. Mana
Total	23.54	22.30	21.94	22.04	25.55	22.30
Benchmark	22.30	22.30	22.30	22.30	22.30	22.30
Active	5.18	0.00	7.44	2.77	17.86	3.45
Act. Systematic	0.92	0.00	0.97	0.09	2.62	0.00
Act. Residual	5.09	0.00	7.38	2.77	17.66	3.45
Act. Residual CF	3.75	0.00	5.90	2.10	14.52	2.10
Act. Residual Indust	2.32	0.00	2.93	0.85	4.56	1.00
Act. Residual Risk I	3.18	0.00	4.63	1.90	13.60	2.10
Act. Residual Spec.	3.45	0.00	4.44	1.80	10.06	2.10

Print

相関レポート

個々のポートフォリオと他のポートフォリオとの相関を示します。複数のファンドを運用している場合のリスク管理等に便利なレポートです。

Multiple Portfolio Case 1: Portfolio Comparison

Summary | Factor Exposure | Risk Decomposition | Relative Risk | **Correlation**

Correlation Type: Total

	Nk225	Nk300	Nk500	Tse1	Otcip
Nk225	23.54	0.98	0.95	0.98	0.75
Nk300	0.98	22.30	0.94	0.99	0.73
Nk500	0.95	0.94	21.94	0.96	0.80
Tse1	0.98	0.99	0.96	22.04	0.76
Otcip	0.75	0.73	0.80	0.76	25.55
Aaar. Managed	1.00	0.99	0.97	0.99	0.78
All Others	0.98	0.98	0.96	0.99	0.76

これらのレポート以外にもファクターエクスポージャーレポートや相対リスクレポートも表示・プリント出来ます。