

バーラ米国株式モデル

米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

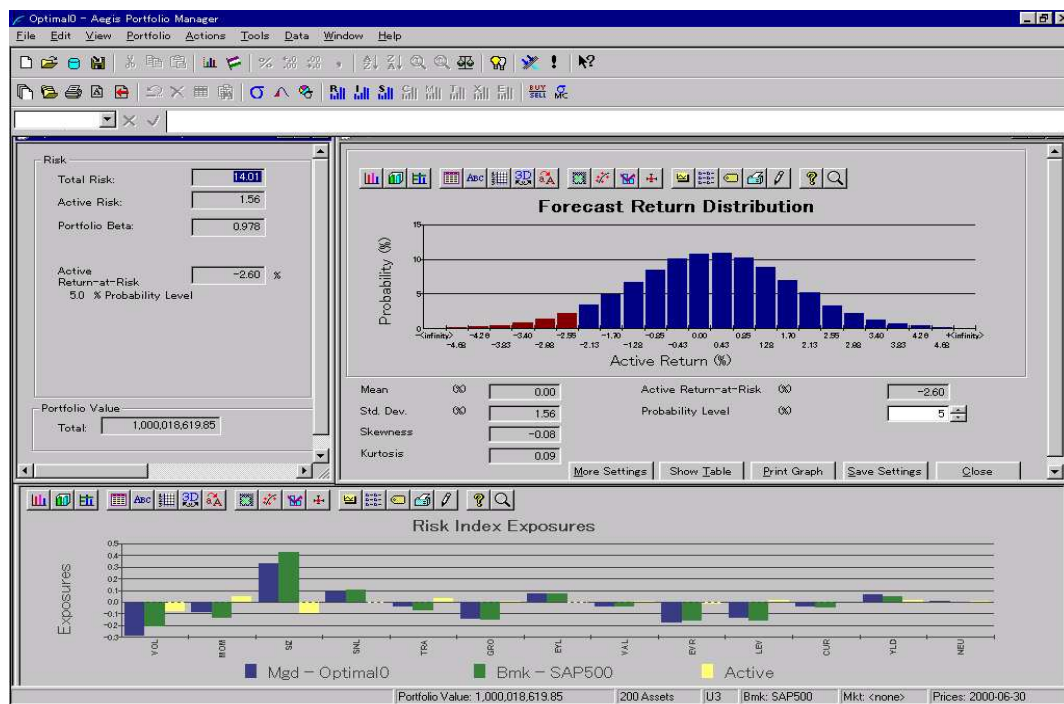
Windows 版

特徴

Aegis 米国株式モデルは、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。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

- 米国株ポートフォリオのリスク及びパフォーマンス分析
- ポートフォリオの特性及びリスクを、SAP500、S&P/BARRA 等のインデックスなど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リスクが最小でリターンが最大の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

米国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

Risk Indices	Industries		Benchmarks
Size	Mining & Metals	Industrial Parts	S&P100
Size Nonlinearity	Gold	Electric Utilities	S&P500
Momentum	Forest Products & Paper	Gas Utilities	S&P BARRA
Volatility	Chemicals	Railroads	NASDAQ
Trading Activity	Energy reserves & Production	Airlines	MMI
Growth	Oil Refining	Trucking, Shipping, Air Freight	NYSE
Earnings Yield	Oil Services	Medical Providers & Services	Frank Russell
Value	Food&Beverage	Medical Products	REIT
Earnings Variability	Alcohol	Drugs	ADR
Leverage	Tobacco	Electronic Equipment	MSCIUSA
Currency Sensitivity	Home Products	Semiconductors	FTUSA
Dividend Yield	Grocery Stores	Computer Hardware & Office Equipmer	等
Non-Estimation Universe Indicator	Consumer Durables	Computer Software	
	Motor Vehicles & Parts	Defense & Aerospace	
	Apparel & Textiles	Telephones	
	Clothing Stores	Wireless Telecommunications	
	Specialty Retailers	Information Services	
	Department Stores	Industrial Services	
	Construction & Real Property	Life & Health Insurance	
	Publishing	Property & Casualty Insurance	
	Media	Banks	
	Hotels	Thriffs	
	Restaurants	Securities & Asset Management	
	Entertainment	Financial Services	
	Leisure	Internet	
	Environmental Services	REIT	
	Heavy Electrical Equipment	BioTechnology	

米国株式モデルの 68 ファクター一覧

コモンファクター

- リスクインデクス (13)
- インダストリー (55)

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 13 個のファクター。

インダストリー

55 業種分類を用い、1 銘柄最大 5 業種までウェイト付けされます。

ベンチマーク

S&P500 や S&P100 等の代表的指数や S&P/BARRA スタイルインデクス、フランクラッセルインデクス、FTUSA や MSCIUSA インデクス等 40 以上のベンチマーク指数を提供。

銘柄カバレッジ

NYSE、NASDAQ、American Stock Exchange 等、各市場上場銘柄だけでなく、ADR や REIT も広範囲にカバーしています。11,000 銘柄以上をカバーしています。(2004 年 6 月現在)

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