



# バーラ ワールドマーケットモデル

国際分散投資のためのアセットアロケーション・ツール

Windows 版

## 特徴

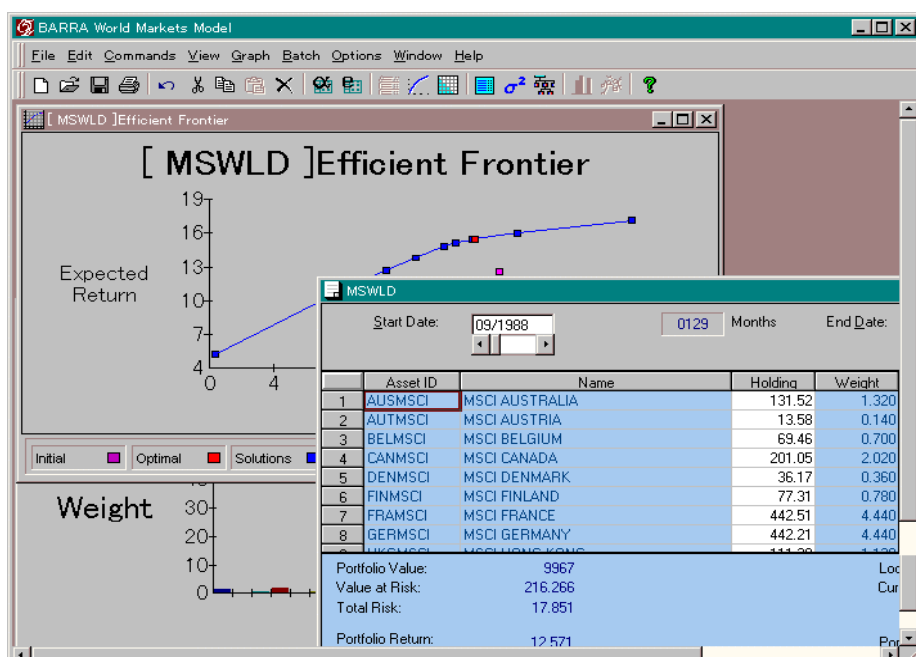
ワールドマーケットモデルは、リスク分析機能、最適ポートフォリオ構築機能、パフォーマンス分析機能を備えた国際分散投資家のための投資分析ツールです。ワールドマーケットモデルのデータベースには、株式、債券、通貨、不動産、商品などの金融資産のインデックスが含まれており、分析に必要なアセットミックスを容易に構築することができます。ワールドマーケットモデルは、マイクロソフト・ウィンドウズ対応のユーザーフレンドリーなソフトウェアですので、即座に結果をご覧いただけます。

## 機能

- アセットまたはポートフォリオのリスクを推定し、アセットのリスクを通貨リスクとそれ以外のリスクに分けることができます。
- 投資家の制約条件を考慮した効率的なアセットアロケーションを構築することができます。
- パフォーマンスを分解し、アセットごとの付加価値貢献度を測定できます。
- ローカルマーケット効果と通貨による効果を正確に分離することができます。
- 戦略を評価するためのヒストリカル・シミュレーションを実行することができます。
- 通貨ヘッジ機能によりアセットと通貨の関係を認識することができます。



ワールドマーケットモデルはグローバルな投資家のアセットアロケーションを評価するための効率的な投資分析ツールです。



### 最適資産配分構築

アセットミックス構築にあたり、  
 バラが独自に開発した2次計  
 画法のアルゴリズムにより、リ  
 スクと期待リターンの効率的な  
 トレードオフを一つの効率的フ  
 ロンティアとして表示します。

### レポート機能

グラフィカルな分析レポートを直接プリンターへの出力や、ワードや他のアプリケーションに対応するファイルに出力することもできます。

### データ更新

インデックス・リターンおよびベンチマーク・ポートフォリオは、月次で更新されます。

### リスク分析機能

各国の株式および債券からなるポートフォリオをワークスペース上に作成し、トータルリスク、ローカルリスクと通貨リスクを測定。ヘッジ機能を利用しての通貨ヘッジも可能です。

### 最適ポートフォリオ構築機能

各アセットの効率的フロンティアを描き、同一のリスク水準で、最も期待リターンの高いポートフォリオを表示。最適なアセットの資産配分を知ることができます。

### パフォーマンス分析機能

ポートフォリオのヒストリカル・パフォーマンスを分析することができます。