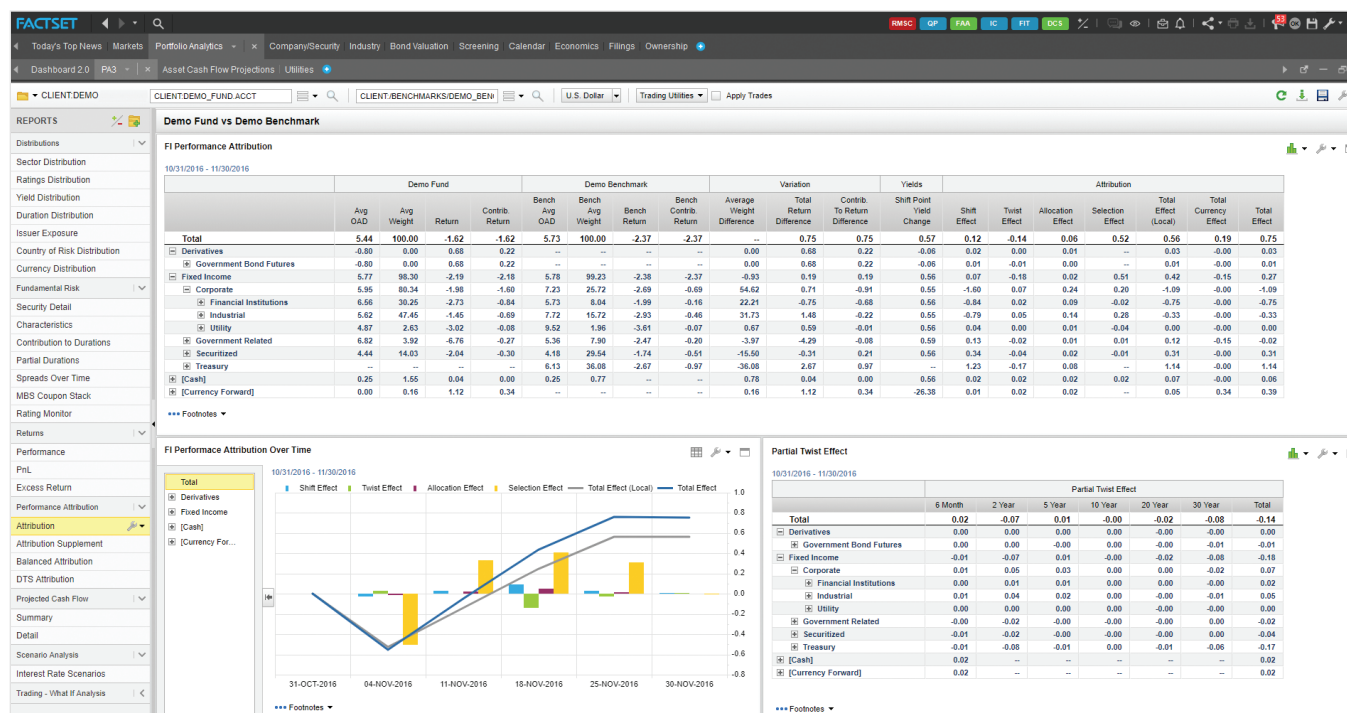


債券ポートフォリオ分析

ファクトセットの業界をリードするポートフォリオ分析ソリューションを活用して、グローバル債券ポートフォリオの特性値やエクスポージャーの把握からパフォーマンス、要因分析、リスク分析の実行を実現します。



広範囲なカバレッジを持つ債券・デリバティブデータ

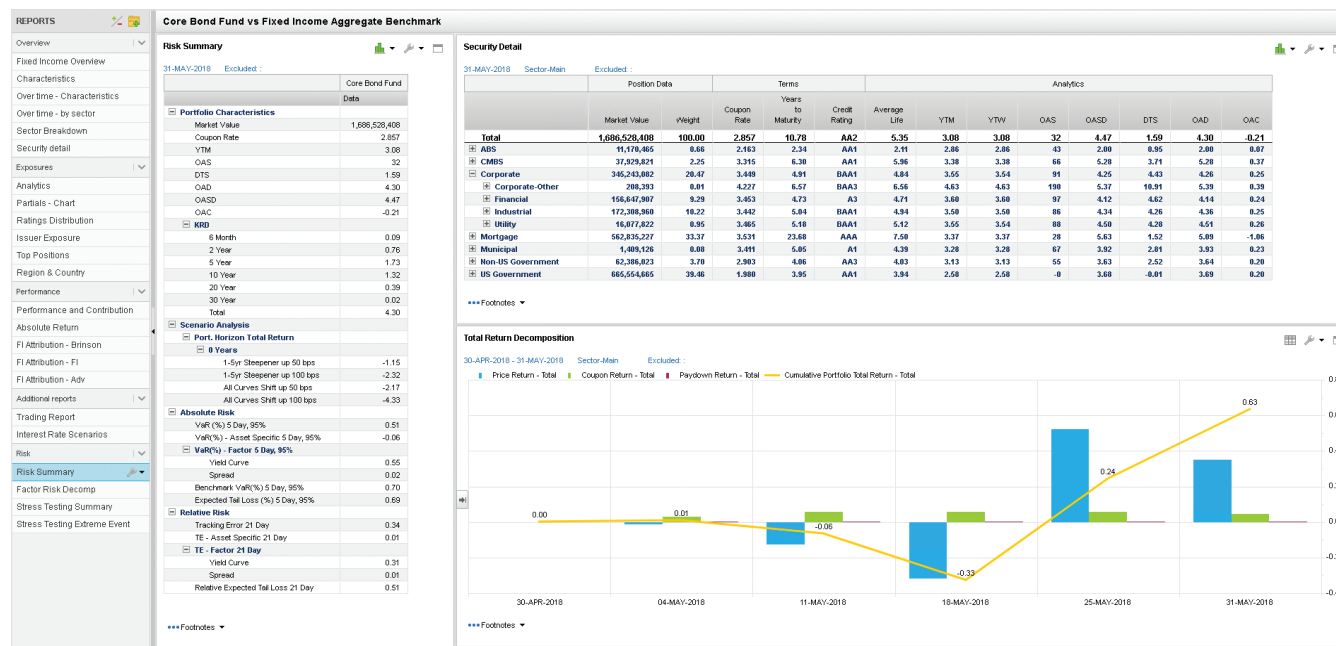
必要とする銘柄やベンチマーク、マーケットデータが利用可能です。ファクトセットの包括的なソリューションにより、債券、株式、デリバティブ、通貨、コモディティ市場のグローバルなアセットが網羅されています。グローバルな社債、国債、証券化商品から、上場デリバティブや店頭デリバティブ、米国の非課税地方債、欧米のバンクローンまで、お客様の運用業務に沿った形でファクトセットが提供する発行条件や価格データを利用できます。

グローバル債券市場の分析

コンバクシティ、スプレッド、利回りだけでなく、実効デュレーションやパーシャルデュレーションを含む300以上の債券計算項目が利用可能、必要に応じて一時点および時系列データを使用することができます。ファクトセットでは幅広い発行条件の情報をカバーしており、サードパーティ提供の価格データ、期限前償還モデルやオプション調整スプレッドモデルを組み込んだ独自の債券計算エンジンを活用することができます。

残高情報、ベンチマーク、独自データの統合

自社の残高情報とファクトセットが持つコンテンツ、格付け、ベンチマークの構成銘柄、グローバルな取引所のインデックスといった業界をリードする他社からのデータを組み合わせることができます。Bloomberg Barclays, ICE Bo ML, J.P. Morgan, FTSE, S&P, HSBC, CBIの主要なベンチマーク指数から地域別の指数まで、あらゆるマーケットにおけるグローバルまたは特定地域を対象とした幅広い指数のカバレッジを有しており、すぐに利用可能です。複数の資産クラスからインデックス及び企業レベルの情報を使用して、カスタムベンチマークの作成やベンチマークのブレンドを行うことができます。安全な夜間アップロードを通じて、勘定システムやカストディアン、社内のデータウェアハウスから直接残高情報や取引データをファクトセットに統合することができます。



リスクや将来の市場変化を評価

ファクター寄与度、ストレステスト、大きなイベント分析など、ポートフォリオの事前的な相対・絶対リスクを分解。ポートフォリオの脆弱性を特定し、資産レベルやポートフォリオレベルでリスクの要因を把握します。トラッキング・エラー・ボラティリティ(TEV)、限界TEV、TEVへのファクター寄与度、バリュー・アット・リスク(VaR)、期待テールロスなど、さまざまな計算値から事前リスクの全体像を把握できます。シナリオを設定して将来のイールドカーブの期間構造、スプレッド水準を複数期間で定義づけることで、将来の市場環境が与えるポートフォリオへの影響を明らかにできます。

カスタマイズされたワークフローによる効率の向上

分析を次のレベルへと引き上げ、ファクトセットの多彩なインターフェースで投資プロセスのあらゆる側面を業務に即した状態にします。個々のニーズに沿って作成されたレポートやチャートは毎晩処理され、一日の始まりにすぐ利用できるよう表示することができます。自社の独自情報やコメントを盛り込んだ月末や四半期末の報告書はバッチ処理を通して作成されるため、レポート生成プロセスの自動化を図ることが可能です。債券分析データフィードで、ファクトセット以外の下流プロセスを強化することもできます。

ポートフォリオ・データマネジメントの負担を軽減

ファクトセットの革新的なポートフォリオサービスでは、ポートフォリオレベルや証券レベルでのポジション、分析、リスク、リターンに対し、タイムリーで正確性、一貫性のある処理が実行可能です。企業全体のデータ統合や調整、標準化といったリソースを集中的に消費する運用をファクトセットが担うことで、チームがより重要な業務に注力できるようになります。データワークフローの追跡、内部でのデータチェックの監視を行い、データを照会する場合は、直接ポートフォリオサービスサポートチームへ問い合わせることができます。

要因分析・パフォーマンス分析

絶対寄与度モデルやベンチマーク相対寄与度モデルを活用して、債券ポートフォリオやマルチアセットポートフォリオの要因分析を実行。債券のトータルリターンを価格やクーポン、ペイダウン、通貨といった主要な項目に分解、さらに価格についてより深い分解を行うことで、粒度の高い分析が実行できます。ポートフォリオの構成銘柄と同等の国債に対する超過リターンを測定します。シフト、ツイスト、インカム、スプレッド、キャリー、インフレ、ペイダウン、通貨などのさまざまな要因から選択できる柔軟な要因分析モデルで、運用哲学や戦略を補完する要因分析を実行します。デューレーションタイムスプレッドの効果寄与度を使ってスプレッドの変化を相対的に計測し、クレジットリスクを捉えることができます。