

サンガードAPT — 市場リスク管理のリーダー

APTは、投資リスクを効果的に監視・管理するためのソリューションです。どのような投資戦略を採用している場合でも、市場リスクの管理は、投資企業にとって必要不可欠な要件です。APTは、あらゆる市場情勢で投資企業やその顧客に想定される潜在的な損失に対処するための効果的な施策の基盤となります。

リスク管理システムは、以下の条件を満たしている必要があります。

- ・ 柔軟性 — リスクをあらゆる視点から総合的に見渡せること
- ・ 即応性 — グローバルな金融市場の急速な変化に対応できること
- ・ 信頼性 — 「ファットテール」(正規分布よりも裾が厚い形状の度数分布)を考慮したリスク予測を提供していること

また、以下の機能も備えている必要があります。

- ・ 近い将来に起こり得るシナリオに加えて、過去に市場に衝撃を与えた事象もリスク分析に組み込む
- ・ リスクに最も大きく寄与している要因を(ポジションごと、または特定要因へのエクスポージャーごとに)特定する
- ・ 最適なヘッジ戦略を明らかにして、企業内のあらゆるレベルで集計された市場リスク全体を軽減する

APTを利用することによって以下のことが可能になります。

- ・ 経営陣、顧客、規制当局に対してそれぞれが必要とするリスク情報を提供する
- ・ あらゆるアセットクラスにわたるリスクの相関関係をさらに明確に理解する
- ・ あらゆるポジションやポートフォリオに関連したリスクを測定・監視する
- ・ ポートフォリオのリスクをモデル化してその原因を特定することで、経営、取引、ヘッジに関する意思決定をより適切に実施する
- ・ 企業全体にわたってリスクを集計することで、会社に最大の影響を及ぼす構造的な要因を明らかにする

APTの主な特長

- ・ グローバルなマルチ・アセットクラス対応により、デリバティブを含めた、非常に幅広い資産を取り扱うことができる
- ・ 豊富なデータを完備したソリューションにより、顧客側のデータ要件を最小限に抑えられる
- ・ あらゆるタイプの投資戦略について、絶対値またはベンチマーク相対値に基づいた一貫したリスク・アプローチを提供している
- ・ 信頼性と即応性の高いリスク評価手法と主要指数が包括的に用意されている
- ・ 柔軟なテクノロジー・オプションとして、ウェブ・ベースおよびExcelベースのリスク・レポート、設定不要なデスクトップ・ツール、あるいは全面的にプログラム可能なコンポーネント(完全な統合化が可能)などを提供している
- ・ フロント/ミドル/バックオフィス・システムとの統合が容易なので、短期間で導入することができる
- ・ サンガードの他の主要なトレーディング・投資製品と統合されている
- ・ 革新的なリスク・ソリューションによって200社を上回る投資企業を支援してきた20年を超える経験と実績に基づいている

APTの最適ユーザー

- ・ あらゆる投資会社や金融サービス機関の市場リスク・マネージャー
- ・ プライベート・ウェルス・マネージャー(PWM)および投資アドバイザー
- ・ ヘッジファンド・マネージャー
- ・ 機関投資家向けファンド・マネージャー
- ・ 定量分析アナリスト
- ・ リスク・コンプライアンス・マネージャー

お問い合わせ： サンガードジャパン
東京都千代田区飯田橋1-3-2 曙杉館9階
電話：(03) 3237-7769 Fax: (03) 3237-9872
Email: info.japan@sungard.com Website : www.sungard.com/japan