

## APT on FactSet

FactSet 上の APT リスク管理システムは非常に柔軟で信頼できるソリューションです。APT の強力な統計因子モデルと非常に多くの説明因子とを組み合わせ、お客様の投資プロセスに合わせる事ができる信頼できるシステムです。

### FactSet プラットフォームを通じた業界最高レベルのリスク・モデル

APT のマルチ・ファクターモデルは、純粋株、債権、不動産、ミューチュアル・ファンド、ヘッジ・ファンドおよび商品先物を含む様々なアセット・クラスのリスク・プロファイルを評価します。新興市場やアラビア市場に特化したモデルなど、単一国からリージョン、グローバル種までカバーしています。

これら全ては客観的な統計的方法を使用して構築され、非常に強力な予測を提供します。現在、中期 (1 ~ 6 か月) と短期 (1 週間 ~ 1 か月) 予測モデルが入手可能です。

### 柔軟なリスク・アナリティクス

APT は RiskScan により柔軟なリスク・ファクター特定性能を提供します。RiskScan は、APT により提供されるファクターのセットから、もしくは FactSet で利用可能な広範囲な時系列データからの、ポートフォリオ中のマーケット・ファクターの選択やシステマティック・リスクの特定を可能にします：

ファクターはリージョン、通貨、国、セクター、産業、スタイル (バリュー、グロース、モメンタム、流動性など) およびファンド戦略を含みます。一度選択したファクターのセットは「モデル」として格納され、あたかも自身のリスク・モデルを構築したかのように FactSet ポートフォリオ管理システムの中で使用することができます。

### ポートフォリオ構築

最新の技術に基づく APT やその他リスクモデルを使用しポートフォリオを最適化してください。制約条件、選択関数、しきい値は、ポートフォリオ、ファクターおよび株式レベルで利用可能なので、ポートフォリオ構築プロセスに対する十分なコントロールが可能です。APT のリスク・モデルと共に使用することで、ユーザーは同リターンでのリスク縮小や同リスクでの改善リターンを期待できます。

APT のリスク管理システムは、世界中のすべての最も頻繁に取引される金融商品のための、柔軟で信頼できるポートフォリオ構築、リスクマネージメント、および報告書作成に必要なコンポーネントをすべて提供します。

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