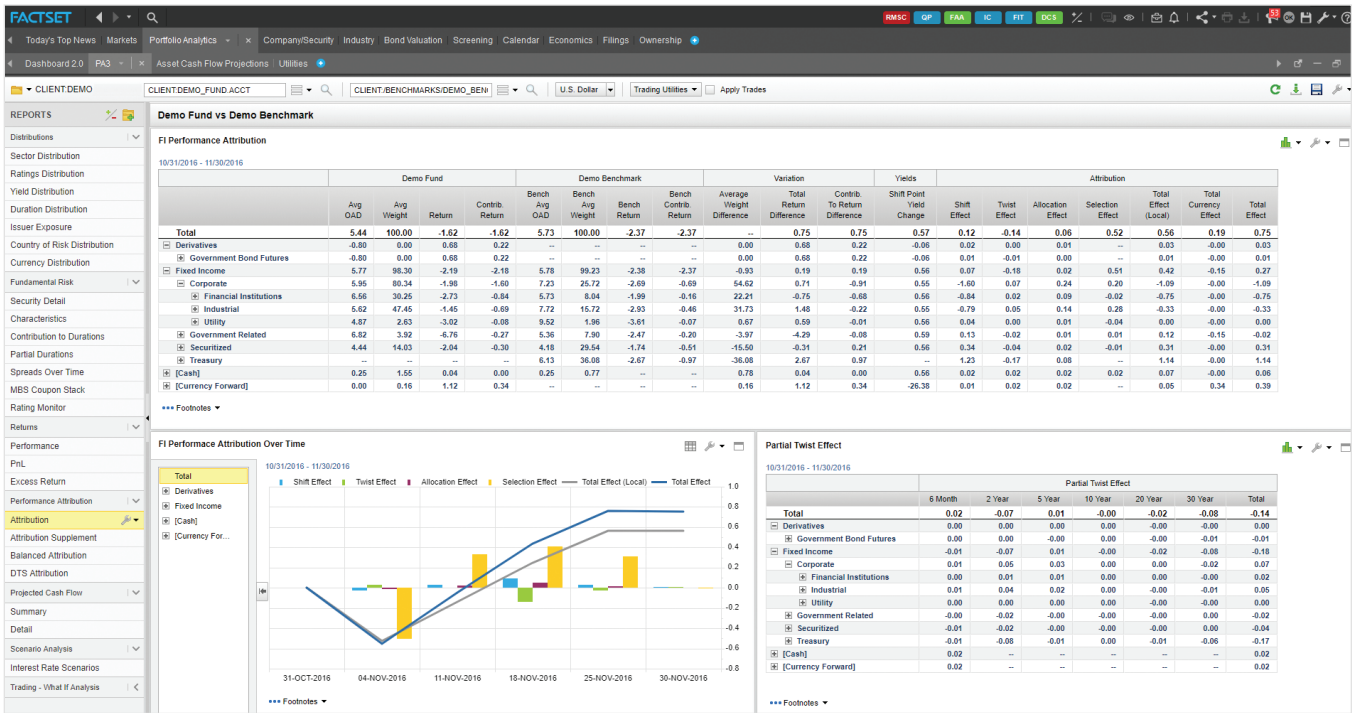


固定收益投资组合分析

利用 FactSet 灵活、行业领先的投资组合分析解决方案，了解全球固定收益投资组合的特征、敞口、绩效、归因和风险。



覆盖种类丰富的固定收益和衍生产品

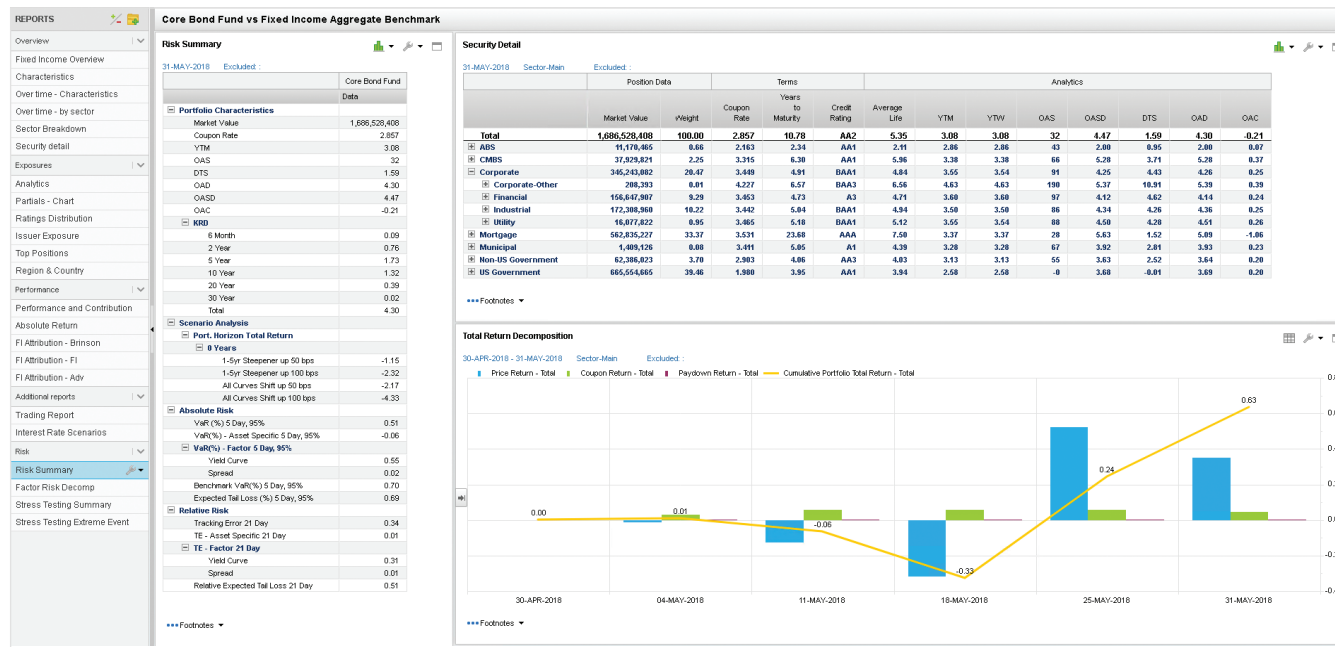
访问您所需的证券类型、基准和市场数据。FactSet 的综合解决方案包含全球资产，涵盖固定收益、股票、衍生产品、货币和商品市场。从全球公司债券、主权债务和证券化产品到交易所买卖衍生产品、场外衍生产品、美国免税市政债券以及美国和欧洲银行贷款，FactSet 均具备条款、参考和定价数据，可满足您的投资工作流程。

围绕全球固定收益市场进行分析

进行 300 多种固定收益的指标运算，包括有效久期和偏久期，以及凸性、利差和收益，并能够根据相应需求访问时间点数据和时间序列数据。FactSet 整合了广泛的条款和条件、第三方定价以及专有债券价格计算引擎；该引擎结合了我们专有的提前还本和期权调整利差模型。

整合持仓数据、基准和专有数据

将您专有的持仓数据与 FactSet 专属或第三方数据源整合，包括广泛的基准数据和全球交易所指数。通过交钥匙式访问接入主要基准指数，包括彭博巴克莱、洲际交易所-美银-美林 (ICE BoA ML)、摩根大通、富时、标普、汇丰、CBI 和其他区域性指数，从而实现所有市场的全球和本地覆盖。使用来自多个系列和资产类别的指数级和公司级信息，构建自定义基准和混合基准。每晚从您的会计系统、托管机构或内部数据库安全上传，将您的和交易直接集成到 FactSet。



评估风险和未来市场变化

分解投资组合中的绝对和相对事前风险，包括因子贡献、压力测试和极端事件分析。识别投资组合漏洞，并检查资产和投资组合级的风险驱动因素。利用各种计算全面了解事前风险，包括跟踪误差波动率 (TEV)、边际 TEV 和对 TEV 的因子贡献，以及风险价值和预期尾部损失。定义场景、未来收益曲线的期限结构以及在任何时间范围内的利差水平，以此发现未来的市场环境将如何影响您的投资组合。

利用定制的工作流程提高效率

利用 FactSet 的多功能界面将您的分析提高到一个新水平，并且自定义投资过程的方方面面。通过自动化的动态报告提高效率，这些报告包括灵活的排序、简单的格式设置选项以及分组和个券详细信息的快速视图。创建个性化的报告和图表显示，这些报告和图表每晚计算并可在新的一天开始时使用。自动化您的报告流程，并创建包含公司专有信息和评论的月末和季度末批量报告。利用固定收益分析实时数据推送服务，增强 FactSet 以外的下游流程。

减轻管理投资组合数据的负担

FactSet 创新的投资组合服务可以确保投资组合在组合层面和个券层面的头寸、分析、风险和收益进行一致、准确且及时的处理。当您依靠 FactSet 对整个企业中集成、协调和标准化的数据进行资源密集型处理时，您的团队能够专注于高影响力的任务。跟踪您的数据工作流程，监控内部数据检查，并将数据问题直接传达给您的投资组合服务支持团队。

检查归因和绩效

量身定制绝对归因模型和相对基准归因模型，并对固定收益和多资产类别投资组合进行归因分析。将债券的总收益分解为包括价格、息票、部分还款和货币在内的核心要素，以此执行粒度分析，并且可以选择对价格进行进一步分解。衡量投资组合证券相比于等政府债券的超额收益。利用灵活的归因模型进行归因分析可以帮助阐述您的投资理念和策略；该模型可以让您从多种因素中进行选择，包括变动、扭曲、收入、利差、附带权益、通货膨胀、部分还款和货币。利用 DTS 归因效应在相对基础上衡量利差变化，彻底掌控信用风险。