

PORTFOLIO MANAGEMENT PLATFORM

> Generate alpha and make more informed decisions using FactSet's robust Portfolio Management Platform, powerful analytics and unique content



概要

Portfolio Management Platform (以下PMP) 機能を新たにリリースしました。ポートフォリオマネージャー業務に特化し設計された、ポートフォリオのリアルタイムモニタリング及びシミュレーション機能です。1つのアプリケーション上で、ポートフォリオのモニタリング、シミュレーション分析、また、取引注文管理システム(OMS)への連携が完結します。

PORTFOLIO MANAGEMENT PLATFORM

A portfolio monitoring and trade simulation tool built for the Portfolio Manager



Intra-Day Portfolio Monitoring:

- Composition
- Exposures
- Risk
- Performance
- News & Research

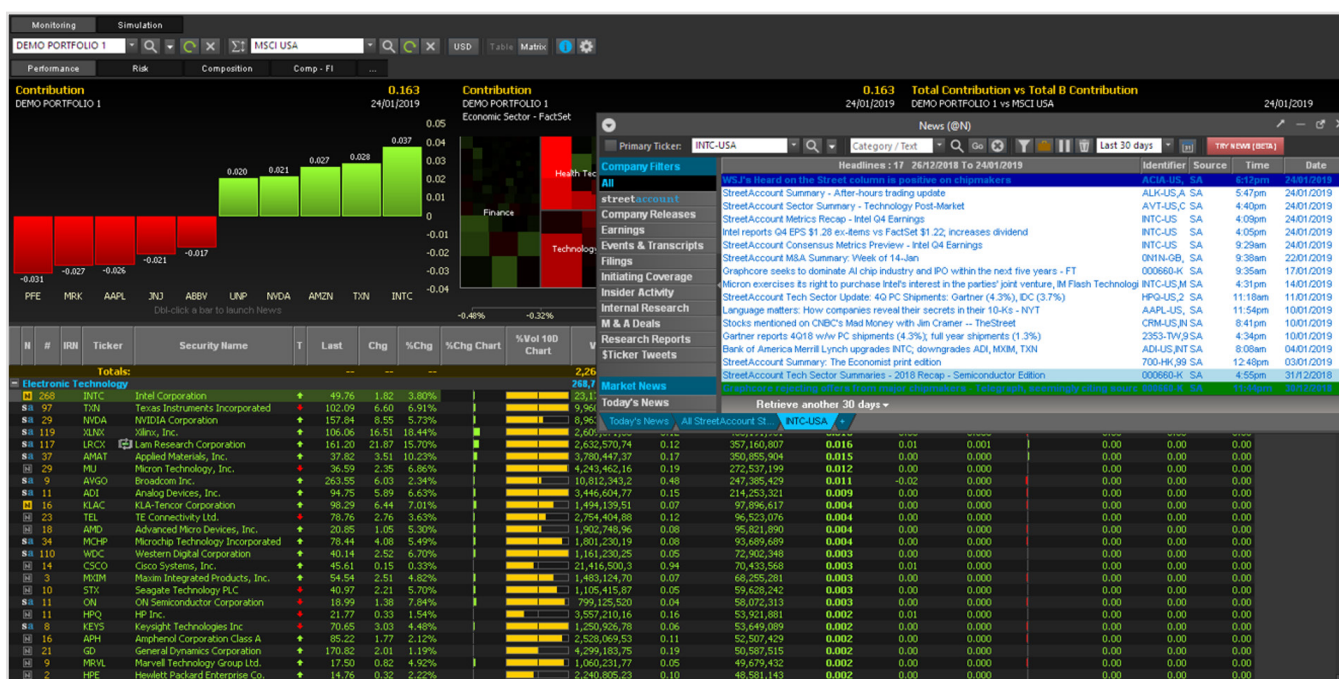


Trade Simulation:

- Single & Multi-Security
- Single & Multi-Portfolio
- Model portfolios to separately managed accounts
- Rebalance on group or total levels
- Optimize the portfolio
- Inject cash and/or forecasted cashflows
- Trade list creation & export

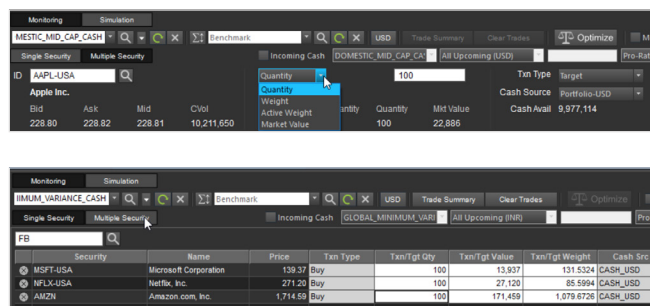
モニタリング

投資保有する銘柄のニュースや社内リサーチ、パフォーマンス、エクスポージャー、リスク、ポートフォリオ構成に関するデータをリアルタイムでモニタリングが可能です。銘柄単位では5秒毎、トータル及びグループ単位では30秒毎にデータの自動更新が行われます。表示するデータ項目やチャートはカスタマイズが可能な仕様となっており、必要なデータをタイムリーに捉える事ができます。ポートフォリオ分析(PA)機能と同じ計算エンジンを実装しており、PMPとPA間でのデータや計算定義の一貫性を確保しております。



シミュレーション

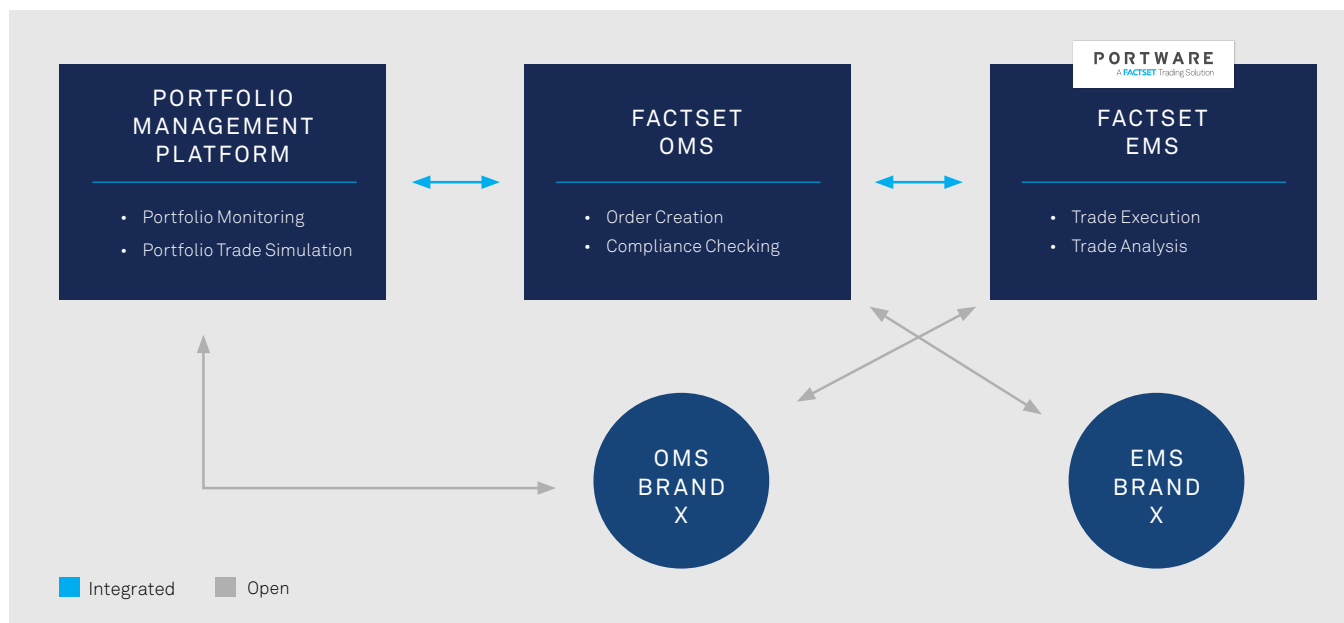
シミュレーション機能により、投資アイデアの検証をより簡単且つ効率的に行う事ができます。様々な取引タイプに対応しており、複数銘柄の取引を複数のポートフォリオに対して一括でシミュレートする事が可能です。また、Axioma Portfolio Optimizer (※ご契約が必要) で作成したストラテジー設定をPMPにロードし、最適化した取引リストの検証を行う事もできます。



OMS/EMSへの連携

シミュレートした取引を注文管理システム(OMS)に連携する機能を実装しております。統合された当社のOMS/EMSや、API経由で他ベンダーが提供するOMSに対し、取引情報を送信する事が可能です。手作業を介さず、シミュレーションからコンプライアンスチェック、取引の実行、分析までの効率的なワークフローを構築します。

Trade Summary					
Portfolio Name	Ticker	Security Name	Quantity	Side	Txn Price
MSCI_AC_LARGE vs. MSCI AC World	BA-USA	Boeing Company	200	B	376.230
MSCI_AC_LARGE vs. MSCI AC World	KO-USA	Coca-Cola Company	200	B	53.810
MSCI_AC_LARGE vs. MSCI AC World	FDS-USA	FactSet Research Systems Inc.	200	B	240.390
MSCI_AC_LARGE vs. MSCI AC World	UBER-USA	Uber Technologies, Inc.	100	S	30.400
DOMESTIC_MID_CAP_CASH vs. S&P Mid	AAPL-USA	Apple Inc.	100	B	227.446
DOMESTIC_MID_CAP_CASH vs. S&P Mid	F-USA	Ford Motor Company	200	B	8.690
DOMESTIC_MID_CAP_CASH vs. S&P Mid	TSLA-USA	Tesla Inc	200	B	238.130
DOMESTIC_MID_CAP_CASH vs. S&P Mid	MMM-USA	3M Company	100	B	153.860
DOMESTIC_MID_CAP_CASH vs. S&P Mid	BRK.B-USA	Berkshire Hathaway Inc. Class B	100	B	207.270



ウェブキャスト (英語)

<https://advantage.factset.com/factset-pmp-webcast>

お問い合わせ

ご質問はEメールでお問い合わせ下さい。

support@factset.com