

퀀트 포트폴리오 운용

▶ 잠재적 투자 요인들을 신속히 조사하고 분석할 수 있도록 해주는 도구 및 데이터베이스로 지속적으로 성장하는 투자 시스템을 구축하십시오. 퀀트 포트폴리오 운용을 위한 FactSet의 종합적인 솔루션으로 투자요인들을 확립하며, 편견 요인을 최소화한 전략 시뮬레이션을 구성하고, 포트폴리오 익스포저를 최적화하여 리스크 및 성과를 관리하십시오.



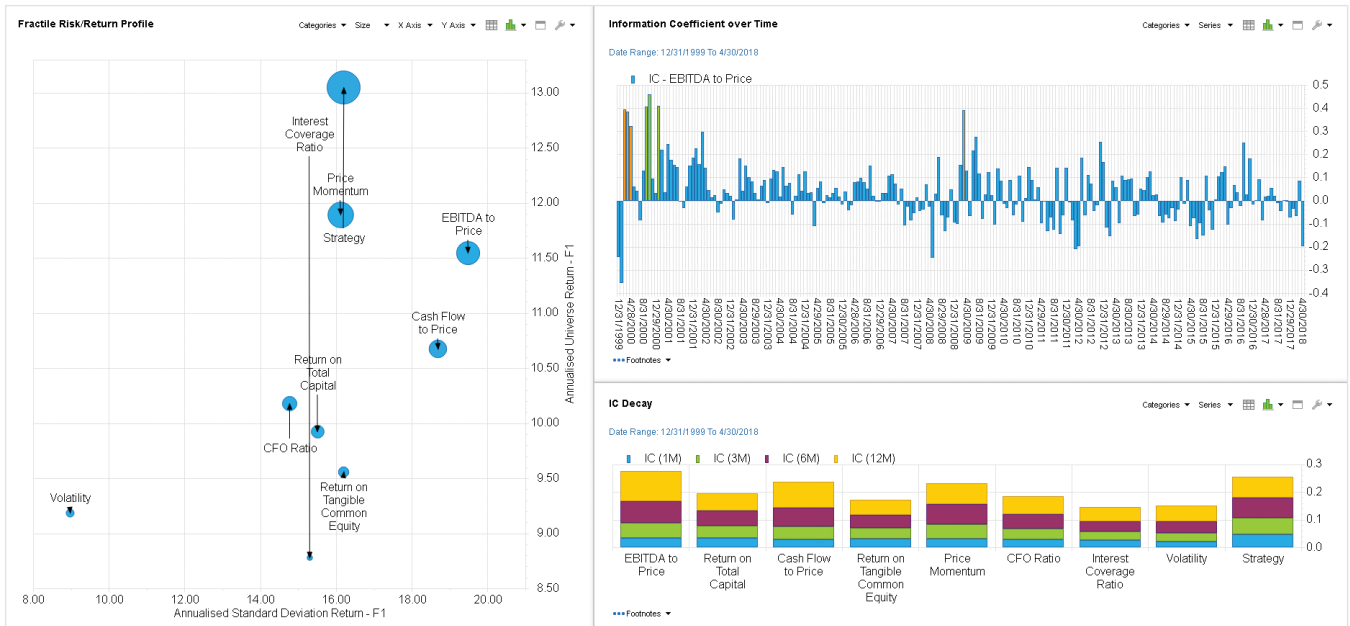
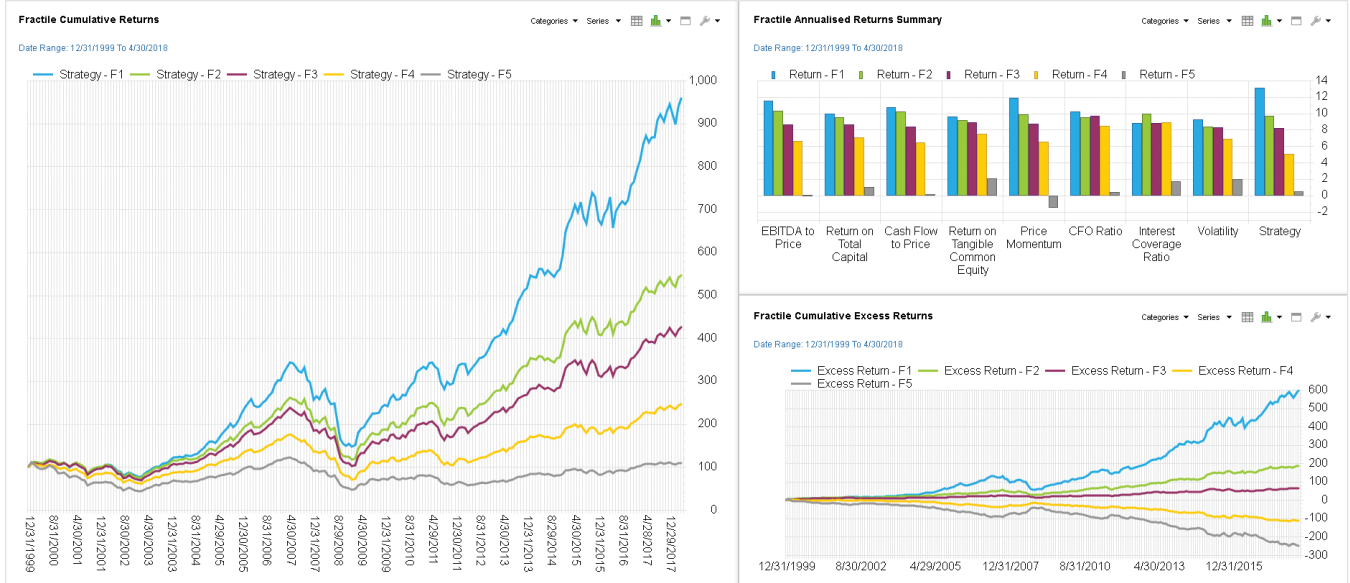
퀀트 워크플로우 강화

업계를 선도하는 솔루션을 확보하여 가장 심도있는 퀀트 포트폴리오 운용을 하십시오.

- 업계를 선도하는 필수 데이터(재무, 추정치) 뿐만 아니라センチ먼트 및 ESG와 같은 고유한 프리미엄 콘텐츠로 워크플로우를 강화하십시오.
- FactSet의 단일 엔터티 식별자를 통하여 기업 이벤트 정보를 정확히 반영한 콘텐츠 조합을 순조롭게 통합하고 관리하십시오.
- 함축적인 스타일 틸트, 시간을 초월한 지속성, 상이한 거시경제 시장 여건 하에서의 성과 및 리스크-수익률 조정과 같은 새로운 통찰력을 찾으십시오.
- 리서치 생성 및 알파 시그널 관리에서부터 거래 목록 생성까지 하나의 플랫폼에서 이루십시오.

요인 연구 및 알파 시그널 확인

FactSet의 선도적인 스크리닝 엔진을 기반으로 한 알파 테스트의 광범위한 구축 역량을 활용하십시오. FactSet의 강력한 데이터베이스 라이브러리의 데이터, 제3자 콘텐츠 및 귀사의 고유 데이터를 사용하여 수천 종목을 필터링하십시오. 기능 라이브러리를 활용하여 어떠한 미가공 데이터도 의미있는 분석으로 변형시키고, 이러한 기능을 모든 애플리케이션에서 사용하십시오. 다양한 시장 영역 전반에서 이러한 사용자 설정 요인들의 성과를 측정하고, 통합 효과를 계량화하며, 요인의 턴오버를 이해하고, 다이나믹한 다변수 알파 시그널을 구축하십시오.



최적 포트폴리오 구성 및 시간 경과에 따른 전략 시뮬레이션

Axioma, Barra 또는 Northfield의 리스크 포트폴리오 구축 도구를 가지고 알파 테스트로부터의 리서치를 활용하여 더욱 선진화된 포트폴리오를 구축하십시오.

- 수익을 극대화, 리스크 최소화, 거래 비용 효과 완화 및 절세를 통해 강력한 포트폴리오를 구축하십시오.
- FactSet의 데이터 용어 색인, 엔터티 매핑 및 종목 이벤트 데이터를 활용하여 포트폴리오 전략을 백테스트 하십시오.
- 거래 목록 감사, 포트폴리오 성과, 리스크 특성 등, 다양한 보고서 라이브러리를 통하여 최종 포트폴리오들을 비교하십시오.
- 다운로드 또는 FTP 전달을 통하여 거래 목록에서부터 분석자료에 이르기까지 최적화된 결과물을 이끌어내십시오.

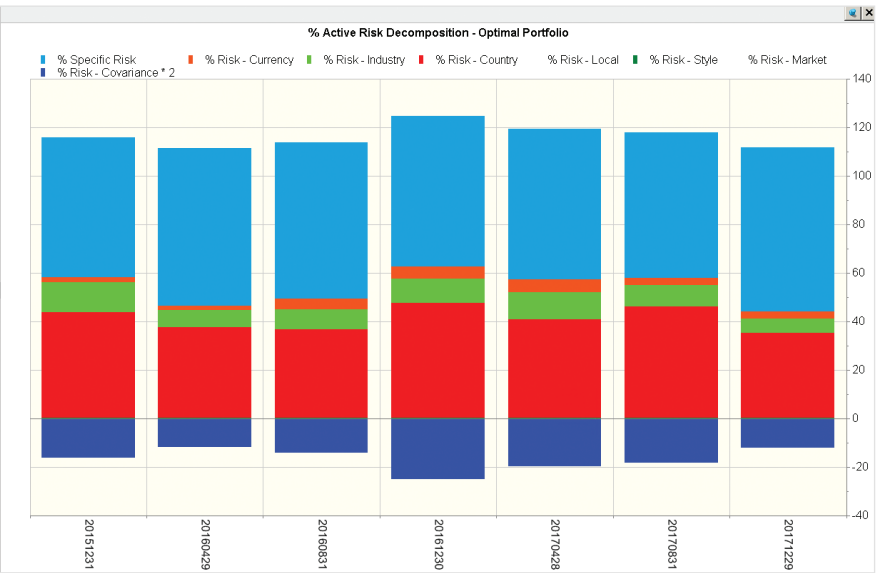
Trade List

CASH vs MSCI Europe Ex-United Kingdom
 Trade Universe: AXIOMA_ALPHAS Holdings as of 30-NOV-2017
 Currency: Euro Axioma Europe Fundamental Equity Risk Model MH 2.1 as of 30-NOV-2017

Symbol	Description	Initial Shares	Final Shares ↓	Shares	Price	Trade Value	Trade Value (%)	Transaction Cost	Trade Type	Action	
Totals								0.00	0.00	152.74	
B55ZR9	Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	0.0	7,696.3	7,696.26	3.95	30,431.00	3.04	11.80	Buy New	Buy	
595937	LM Ericsson Telefon AB Class B	0.0	6,200.1	6,200.13	5.30	32,850.68	3.29	9.30	Buy New	Buy	
BD1RP6	Bank of Ireland Group Plc	0.0	4,693.5	4,693.54	6.55	30,761.44	3.08	23.88	Buy New	Buy	
517617	Orange SA	0.0	2,421.2	2,421.19	14.48	35,058.81	3.51	4.55	Buy New	Buy	
BYMXPS	UniCredit S.p.A.	0.0	2,126.3	2,126.34	16.90	35,926.81	3.59	10.27	Buy New	Buy	
B3B8D0	SUEZ SA	0.0	2,001.2	2,001.18	15.49	30,998.30	3.10	6.49	Buy New	Buy	
414881	RELX NV	0.0	1,728.8	1,728.81	19.23	33,253.75	3.33	3.13	Buy New	Buy	
718762	Lundin Petroleum AB	0.0	1,580.6	1,580.60	19.38	30,635.42	3.06	5.74	Buy New	Buy	
563692	thyssenkrupp AG	0.0	1,381.2	1,381.23	22.99	31,754.39	3.18	4.07	Buy New	Buy	
717158	Credit Suisse Group AG	0.0	1,180.0	1,180.02	14.23	16,790.78	1.68	4.65	Buy New	Buy	
458882	Danske Bank A/S	0.0	1,087.0	1,087.02	31.39	34,119.49	3.41	3.10	Buy New	Buy	
BKJ9RT	ISS A/S	0.0	973.7	973.72	31.76	30,929.50	3.09	4.25	Buy New	Buy	
461785	Deutsche Post AG	0.0	922.1	922.09	39.89	36,782.21	3.68	3.28	Buy New	Buy	
BQYZDZ	Deutsche Wohnen SE	0.0	869.9	869.86	37.14	32,306.66	3.23	2.86	Buy New	Buy	

Risk Decomposition Summary
 Earliest (31-Dec-2015) To Latest (29-Dec-2017), All Restructure Dates

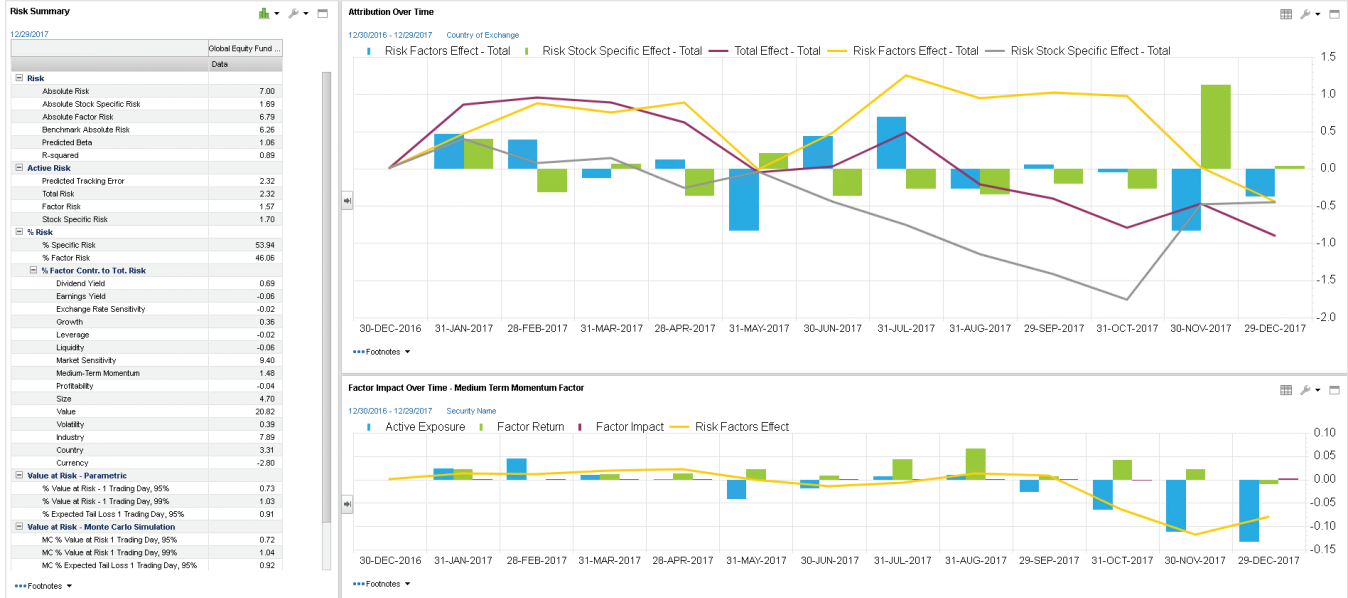
	Initial % Specific Active Risk	Initial % Factor Active Risk	Final % Specific Active Risk	Final % Factor Active Risk	Total Portfolio Turnover
Summary	49.05	50.95	62.58	37.42	91.30
31 Dec 2015	15.20	84.80	57.46	42.54	192.54
29 Apr 2016	36.25	63.75	64.82	35.18	78.73
31 Aug 2016	52.05	47.95	64.46	35.54	62.70
30 Dec 2016	55.07	44.93	62.02	37.98	63.20
29 Apr 2017	60.97	39.03	61.88	38.12	72.75
31 Aug 2017	58.26	41.74	59.77	40.23	80.22
29 Dec 2017	65.56	34.44	67.62	32.38	88.96



예측 리스크 분해 및 실현 성과 측정

FactSet의 업계를 선도하는 포트폴리오 분석 도구, 성과 주요 자료, 배분 분석 및 특성 리포트를 생성하여 워크플로우를 더욱 강화하십시오. 전통적인 방법론에 리스크 분석, 분해 및 리스크 기반 성과 속성을 포함시켜 어플리케이션의 가치를 극대화 하십시오. 상대적 성과의 시스템적인 자료를 확인하고 성과에 도움을 주었거나 성과를 떨어뜨렸던 특정한 익스포저를 분석하여 정보에 기반한 포트폴리오 운용 결정을 가능하게 만드십시오. 스트레스 테스트를 접목하여 시장이 움직이는 경우 잠재적 취약성이 어디에 있는지 이해하고 다음과 같은 리스크 및 보고 특징들을 활용하십시오.

- 업계를 선도하는 리스크 모델 또는 완전한 맞춤형 사용자 정의 리스크 모델을 구동하여 사전 리스크 분석 및 사후 요인 속성의 완전한 스펙트럼에 접근하십시오.
- 귀사의 모든 사용자들이 모든 리스크 수치를 산출하고 변동성 예측을 측정하며 시스템 및 종목별 리스크를 통해 추적 오류의 원인을 살펴볼 수 있도록 하십시오.
- 포트폴리오의 초과 수익률을 분해하여 어떤 요인들이 성과를 내고 있는지 그리고 종목 선정에 얼마나 기여하는지 정확히 알아보십시오.
- 상품가격 급상승, 경제적 서프라이즈, 스타일 선호의 변이, 극단적인 시장 사건 및 수천 개의 추가 시나리오의 효과를 예측하십시오.
- 개별 자산, 그룹 자산, 기여 요인 및 총 포트폴리오를 포함하여 모든 레벨에서의 단일 또는 복수의 스트레스 테스트의 영향을 측정하십시오.



프로세스의 간소화 및 자동화

퀀트 투자 운용 워크플로우를 위한 완전한 솔루션을 확보하고 중복 시스템의 불필요한 사용을 최소화 하십시오. 특정한 시간 및 주기에 가동되는 자동화된 계산을 통하여 시간을 절약하십시오. 자동화된 플랫폼 파일 전달을 통하여 요인 분석 및 맞춤형 요인 익스포져 리포트를 수령하십시오. 병행 계산을 활용하여 수천 개의 포트폴리오를 한 번에 효율적으로 리밸런싱하십시오. 리스크와 성과 분석을 결합하고, API를 통하여 퀀트 모델 및 포트폴리오에 대한 결과물을 일괄 제공하며, 프레젠테이션이 즉시 가능한 보고서를 용이하게 만드십시오.

고객의 고유한 필요성을 충족할 수 있는 맞춤형 솔루션 확보

계량 분석을 플랫폼 안팎으로 사용하여 본인에게 알맞는 솔루션을 맞춤 제작하십시오. 업계를 선도하는 데이터를 사용하여 아이디어를 신속하게 창출하고, 즉시 데이터를 호출 할 수 있는 파이톤 기반 플랫폼을 최대로 사용하십시오. 퀀토피안의 강력한 리서치 환경 내에서 FactSet의 수준 높은 콘텐츠에 접속하여 더 많은 데이터를 포트폴리오 구성에 통합시키십시오. 퀀토피안의 계산 소프트웨어 및 Open: FactSet Marketplace의 프리미엄 데이터를 활용하여 투자 알고리즘이 실제 세계에서 어떻게 작동하는지 시뮬레이션하십시오. 데이터 기반 투자 전략을 개선하고, 귀사의 전략이 실제 세계에서 어떻게 작동하는지 시뮬레이션하고, 아이디어를 개발하고, 더 강력한 계산 자원을 이용하여 투자 전략을 더 빠르게 테스트하십시오.