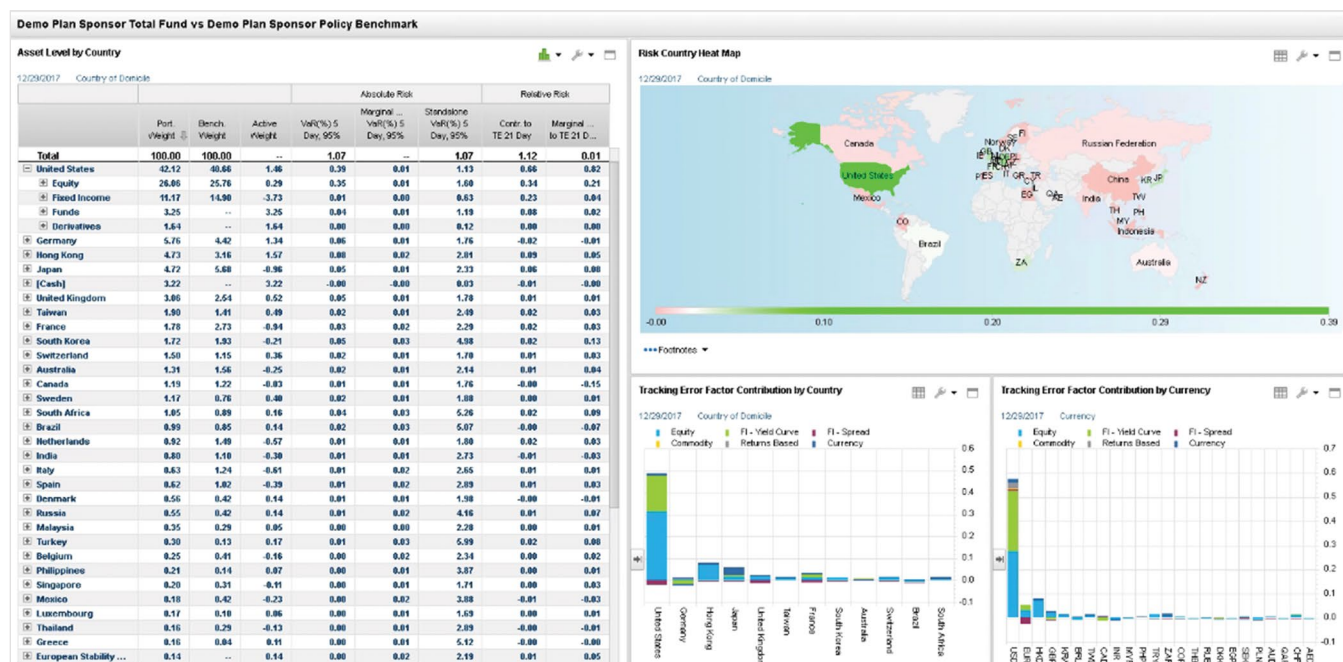


SOLUTIONS FOR ASSET OWNERS

ファクトセットが提供するマルチアセットに対応したポートフォリオ分析とリサーチマネージメントソリューションにより、あらゆる側面からワークフローを強化します。新規投資に対する確認、アセットアロケーション調整に関するインパクトの計測、インハウス運用や外部への委託運用に対する評価が行えます。



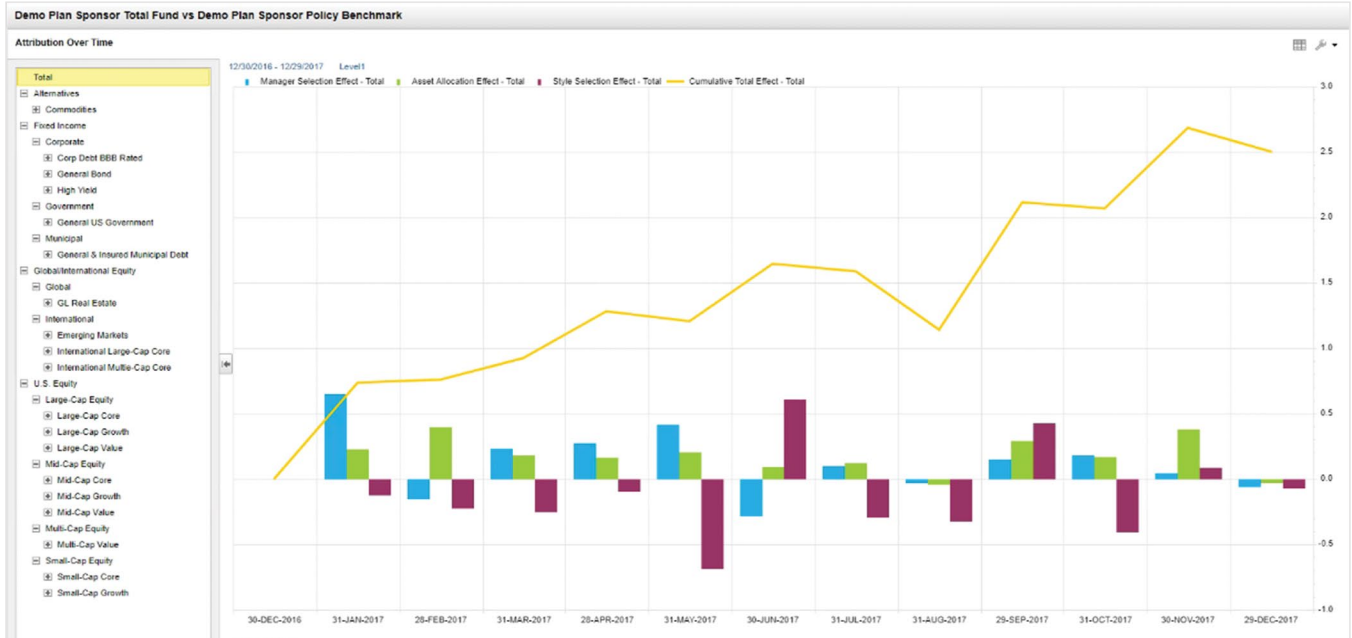
正確なデータでワークフローを強化

業界で最も幅広いベンチマークデータやファクトセット独自のマルチアセットクラスのリスクモデルを含むファクトセット独自のコンテンツやサードパーティのデータソースと、独自の保有データや(ファンド/ポートフォリオ)マネージャー提供のデータを組み合わせることができます。ポートフォリオへの組み込みについては、様々な外部ベンダーの情報に対応しており、ファクトセットが提供する株主情報を管理しているデータベースをご利用いただける他、ファクトセットの投資家ネットワークを経由して、外部機関から直接データを提供する形態にも対応しております。お客様からファクトセットにロードされたデータを分析可能な形へとモニター、クレンジングするポートフォリオサービスを活用すれば、安全かつ正確で一貫性のあるポートフォリオデータをご利用いただくことができます。

総合的な運用プランに対するパフォーマンスとリスクの把握

運用状況を包括的かつ統合的に把握できるため、一貫性のないサードパーティの運用レポートに対する依存度を軽減することができます。どういった運用がされているのか、リスクエクスポージャーはどの程度か、またポートフォリオのみならずプラン全体に対するパフォーマンスに及ぼす影響はどの程度かといった分析が行えます。

- ポートフォリオ、グループ、ファクター、アセットといったレベルで事前リスクを測定、分解
- 不動産、ヘッジファンド、プライベートエクイティを含むオルタナティブ投資に対するリスクの評価
- 戦略的かつ戦術的な資産配分の決定、マネージャーの選定、及び手数料の影響を把握
- カスタムで作成可能なストレスファクターをポートフォリオに適用して、パフォーマンスを予測
- LDIプロセスの強化



ファンドマネージャーに関するリサーチ

ファクトセットの強力な分析機能を利用すれば、定量的かつ定性的なデータを使って、新しい投資機会を容易に見出すことができます。ファンドマネージャーに対する包括的な概要情報にアクセスすることも可能です。

- パフォーマンス、構成データ、分析結果、特性値及びリスクに関するカスタムレポートの閲覧
- ポートフォリオのパフォーマンス及びコンプライアンスにおいて閾値を超えた際のアラートの作成
- 定量的・定性的な基準でファンドマネージャーを検索

戦略的かつ戦術的な市場調査の実施

幅広いコンテンツと強力なツールを活用して、マクロ経済データに潜む複雑な関係性を理解することが可能です。

- グローバルな経済状況や、地域別および国別の分析レポートにアクセスし、簡単に比較
- 資産クラスのパフォーマンスと特性を現在と過去の両面でモニタリング
- ファクトセットのStreetAccountが持つマーケットサマリーやマクロ経済に関するコンテンツで、市場を動かすニュースを深く掘り下げ

投資およびデューデリジェンスプロセスの運用化

効率的で透明性の高いリサーチマネジメントプロセスを経ることで、より、より多くの情報に基づいた意思決定が行えるようになります。

- 一元管理されたデータベースを活用して、迅速かつ容易に社内にあるリサーチ情報にアクセスし、社内全体のコミュニケーションを促進
- 資料収集、ミーティングの実施、他ファンドとの比較検討、とりまとめといったオンボーディングプロセスで発生するデューデリジェンス業務を体系的に組織化してどのマネージャーでも再現可能に
- 毎日大量に届くファンド関連資料を自動的に分類し、タスク作成までサポート

Portfolio	Equity Characteristics				Fixed Income Characteristics				Risk Characteristics				Stress Tests					
	Port. Value	Market Value	Price/Earnings	Dividend Yield	Duration	Effective Duration	Trailing 30 Days (%)	21 Days Breakeven	Delta	Gamma	Convexity	Volatility	Skewness	Kurtosis	Value at Risk	Value at Risk	Value at Risk	Value at Risk
Demo Plan Sponsor Total Fund	92,825,296	2,551	15.4	6.9%	5.75	5.62	1.68	1.68	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Demo Alternatives Sleeve	295,638	-	-	-	-	-	3.62	3.69	2.79	0.67	-0.79	0.97	-2.98	-	-	-	-	-
Demo Alternatives Portfolio	18,939,203	-	-	-	-	-	4.93	5.08	3.99	0.65	-0.63	1.31	-4.25	-	-	-	-	-
Demo Hedge Fund Sleeve	189,282,032	-	-	-	-	-	3.57	3.68	2.98	0.67	0.65	0.95	2.84	-	-	-	-	-
Demo Hedged Sleeve	1,267,489	2.12	26.2	2.313	6.85	8.29	1.81	1.61	0.37	0.49	1.01	1.01	1.01	-	-	-	-	
Demo Global Balanced Strategic	172,171,720	2.12	26.2	2.313	6.85	8.29	1.81	1.61	0.37	0.49	1.01	1.01	1.01	-	-	-	-	
Demo Equity Sleeve	6,506,969	2.60	17.4	-	-	-	5.05	6.17	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	-	-	-	
Demo Developed ex US Passive Portfolio	68,986,529,715	1.36	40.7	-	-	-	5.10	6.07	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	-	-	-	
Demo Emerging Market Country Alpha Portfolio	24,975,533,827	7.41	12.9	-	-	-	4.93	6.06	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	-	-	-	
Demo Emerging Market Passive - Global Top Portfolio	14,789,189,142	9.81	16.6	-	-	-	5.26	5.21	1.05	0.00	-0.39	-0.39	-0.82	-	-	-	-	
Demo Global Developed Passive Portfolio	314,139,142	2.09	26.3	-	-	-	5.11	6.07	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	-	-	-	
Demo US Core Passive Portfolio	92,825,296	2.09	19.8	-	-	-	5.03	6.04	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	-	-	-	
Demo US Long Short Portfolio	1,085,142,149	3.95	11.8	-	-	-	5.11	7.03	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	-	-	-	
Demo US Short Alpha Portfolio	339,148,377	2.09	19.8	-	-	-	5.17	6.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	-	-	-	
Demo Fixed Income Sleeve	3,279,269	-	16.3	6.959	5.98	1.68	6.08	4.69	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	-	-	-	
Demo Core Japan Fixed Income Portfolio	100	-	6.07	5.45	1.45	1.45	1.45	1.45	1.45	1.45	1.45	1.45	1.45	-	-	-	-	
Demo Global AM Fixed Income Portfolio	18,939,851	-	2.82	8.45	1.48	0.89	3.78	0.71	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	-	-	-	
Demo US Government Portfolio	6,846,149	-	2.82	4.40	2.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	-	-	-	
Demo Value Composites Portfolio	1,023,213	-	10.3	6.311	2.75	0.31	-0.31	-2.09	0.79	0.22	0.26	0.46	-0.47	-	-	-	-	
Demo Micro Overlay	1,924,276	-	-	-	-	-	7.97	-1.99	-0.91	1.91	-0.92	2.91	-0.91	-	-	-	-	
Demo CDO Overlay	14,219,191	1.18	-	-	-	-	7.76	15.23	0.42	1.26	4.86	2.93	4.26	-	-	-	-	
Demo Multi-Factors Overlay	51,425,935	-	-	-	-	-	13.84	16.37	13.42	1.91	5.36	2.69	5.81	-	-	-	-	
Demo Private Equity Sleeve	690,869	1.61	18.8	-	-	-	7.18	0.08	0.73	0.70	0.02	1.04	-0.88	-	-	-	-	