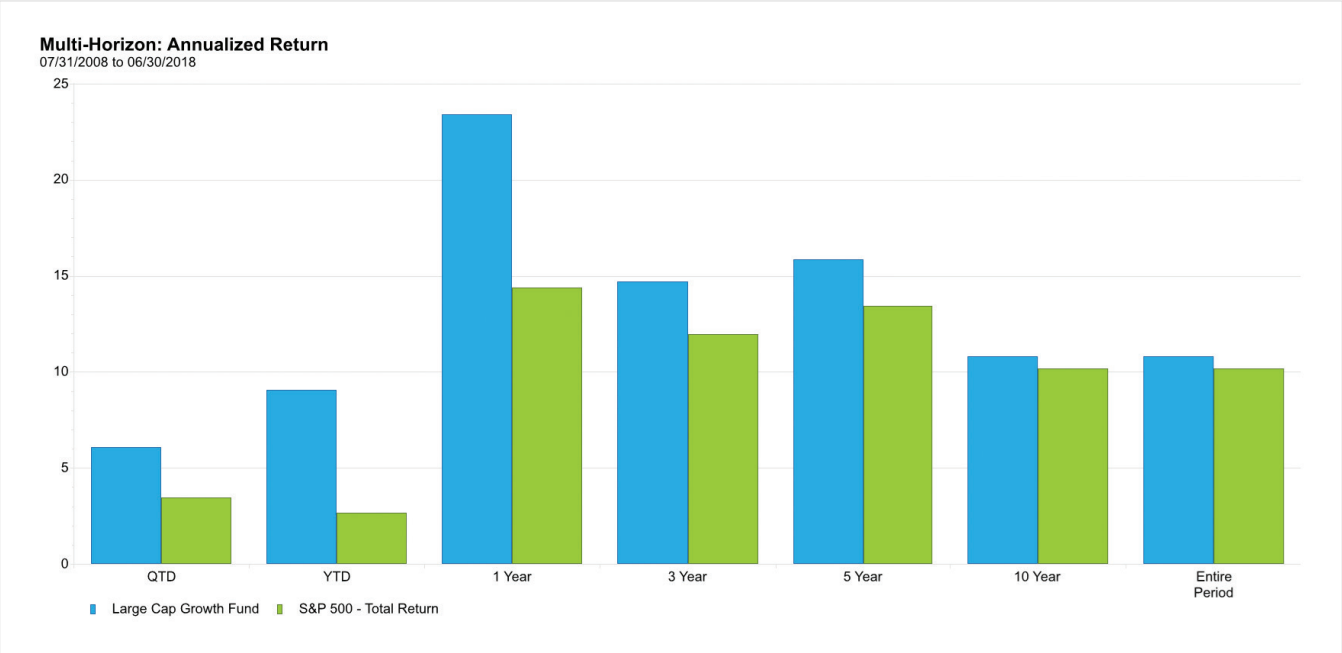
FACTSET 〉 SEE THE ADVANTAGE

SPAR(スタイル・パフォーマンス・リスク分析)

〉 ファクトセットのリターンベースのポートフォリオ分析アプリケーションでは、レポートやチャートを活用して、ベンチマークや競合するユニバースと比較したポートフォリオのリサーチをサポートします。



スタイルやパフォーマンス、リスクの分析および他社ファンド比較

ご自身のポートフォリオ、ベンチマーク、他社ファンドについて、過去のリスクやリスク調整後のパフォーマンスを調査できます。

- 様々な表やチャート上で、複数期間や任意の指定期間、ローリングのリターンを確認可能
- ファンドのサイズ、バリュー、グロースといったスタイルの傾向を比較
- ポートフォリオや戦略に対して、リスクとリターンの詳細な分析が可能な機能を実装
- 70を超えるMPTリスク統計値を活用し、2万もの株式および債券のベンチマークと比較してポートフォリオを分析

投資機会の特定

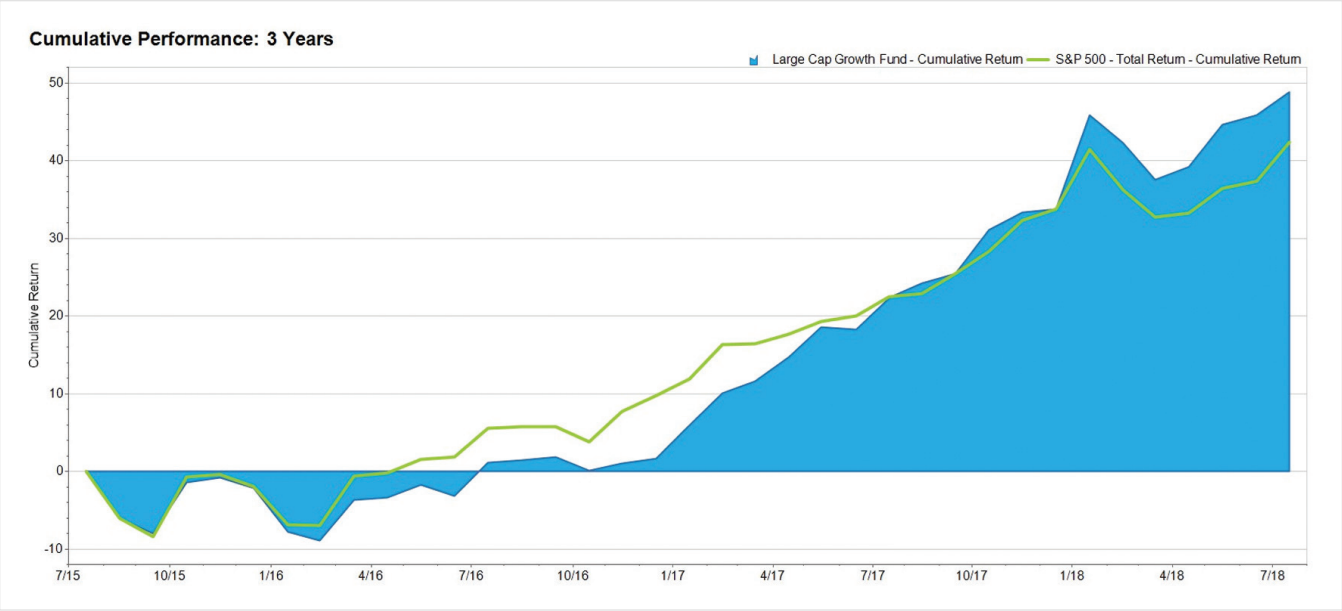
特定の基準を満たすファンドをスクリーニングすることで投資機会を迅速に特定します。

- 50万以上のグローバルミューチュアルファンド、セパレートアカウント、ヘッジファンドから表示
- 保有数やファンドマネージャーの在職期間といった定性的なデータを用いたレポートの作成も可能
- 任意の項目でランキングを作成し、基準を満たすファンドを確認可能
- スクリーニング結果を他のファクトセットのアプリケーションにエクスポート、更なる分析へ

オリジナルのレポートやプレゼンテーション資料を簡単に作成

ファクトセットやサードパーティーのプロバイダー、社内システムからのデータを活用して、Microsoft Officeアプリケーションで様々なレポートが作成できます。

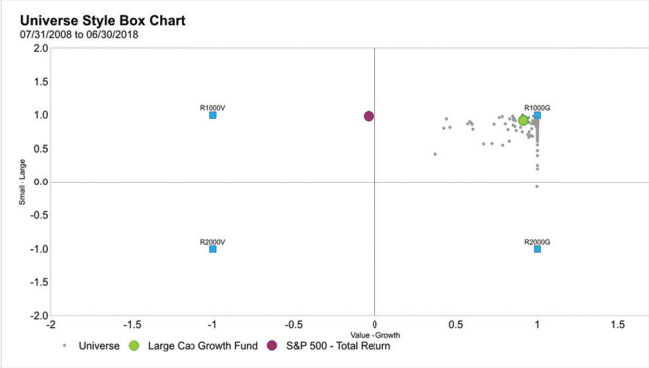
- PowerPoint、Word、およびExcelに数値やチャート、設定内容をリンクしてカスタムレポートを表示、簡単に更新
- 色やマーカー、ヘッダーやフッターに至るまで、グラフのあらゆる側面のカスタマイズが可能
- ポートフォリオダッシュボードを使用して、すべてのポートフォリオのリスクとリターンの特性を一元化してモニタリング



直感的な操作で分析をサポート

ワークスペース上で簡単に操作が行えます。

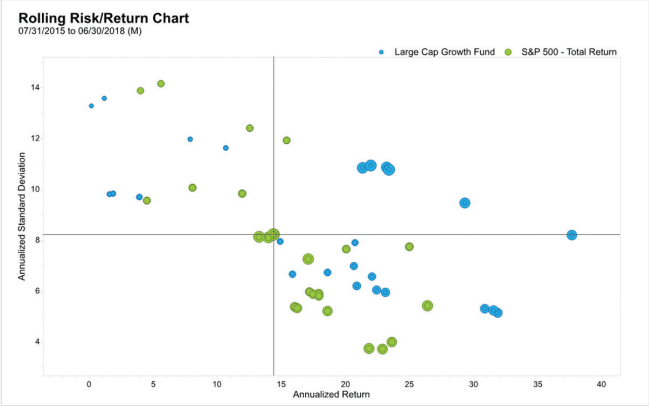
- 様々なタイル、レポート、ドキュメントをカスタマイズ
- 表とグラフはワンクリックで切り替え可能
- 簡単なボタン操作だけでタイルの設定を他のレポートへ適用可能
- 残高ベースで提供されるポートフォリオ分析機能と同じような日付の調整が、SPARでも設定可能に



API統合による信頼性の高いデータと分析へのアクセス

オープンで柔軟なテクノロジーを活用して、APIを使用した強力な分析機能を提供します。

- ファクトセットのポートフォリオ分析を使用して、社内および社外向けのダッシュボードを強化
- お客様のデータレイクやレポーティングツールに、直接バルクデータをファクトセットから取り込めるセルフサービスプログラミングを用いることで、データプロセスを向上
- ビジネスインテリジェンスツールにおけるファクトセットデータの統合
- APIを介してモデルポートフォリオの分析結果を送受信



FactSetについて:FactSetは、世界中の投資専門家に財務情報と分析アプリケーションを提供する大手プロバイダです。ファクトセットのスタイル・パフォーマンス・リスク分析の詳細については、sales@factset.comにお問い合わせいただくか、www.factset.comをご覧ください。Copyright © 2021 FactSet Research Systems Inc. All rights reserved.