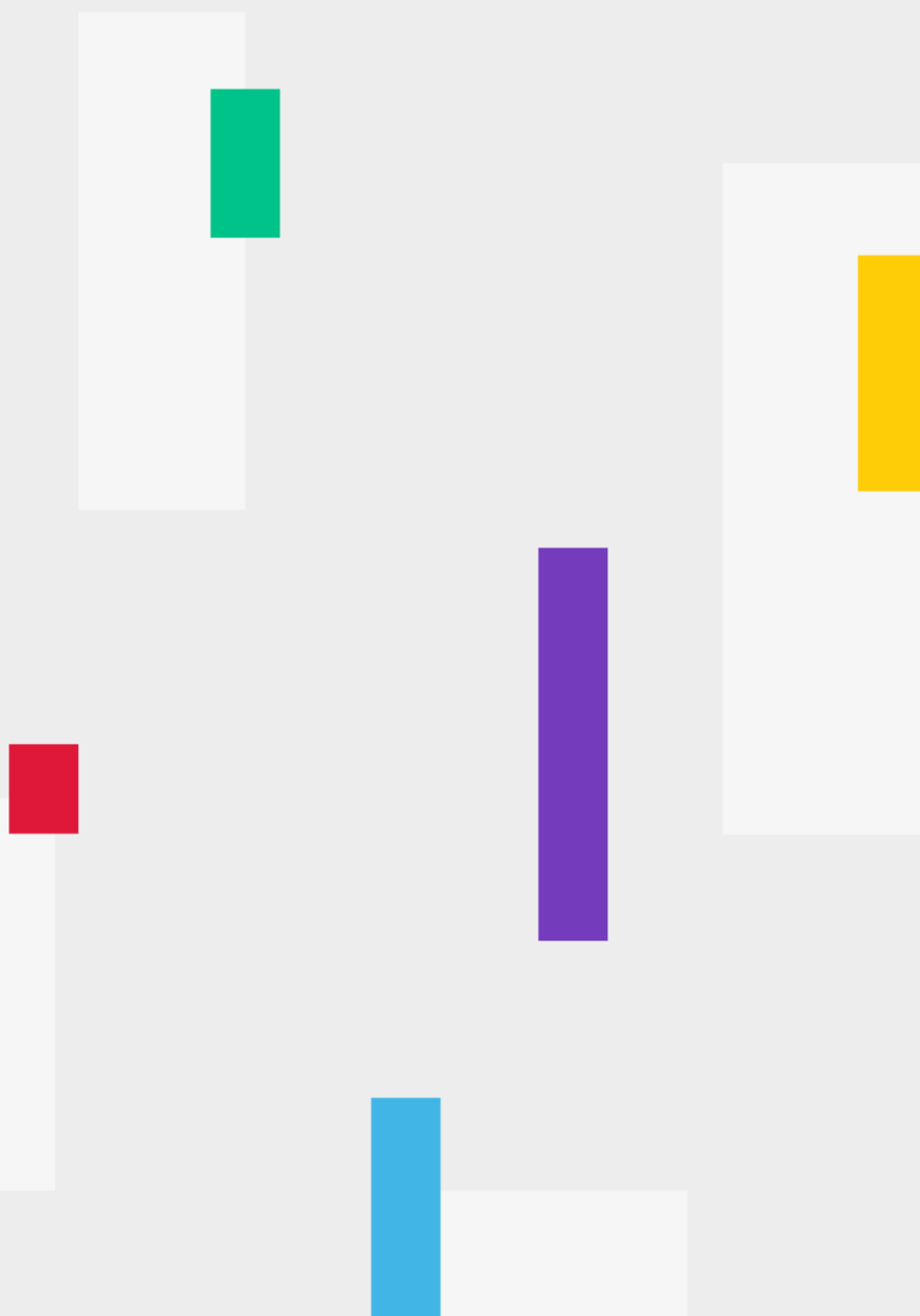


# Portfolio Labs

## 投资组合实验室



# 投资组合实验室

## 简介

投资组合实验室是一个场景测试模块，对组合分析(Portfolio Analyzer)的用户开放。如果您现在已经在使用本公司组合分析工具，那么把实验室加入到您的平台上将是一个不错的选择，因为它不仅高性价比，更有操作简单的优势。

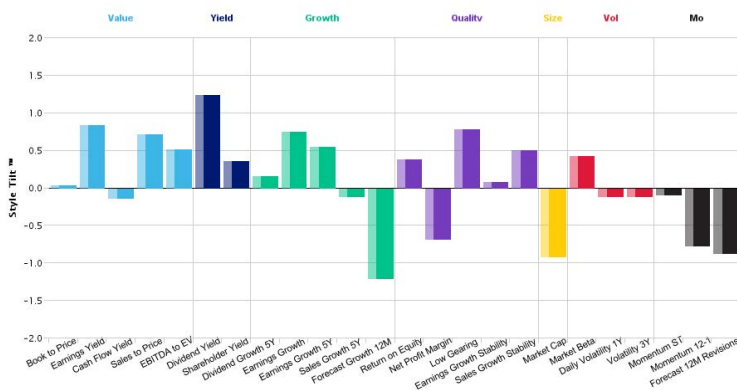
这个模块能让您根据现在的投资组合，结合您想设计的“如果”场景，迅速计算出风格上的变化。不管您的组合是由个股建仓，或是由投资经理基金建仓(FOF)，我们都可以为您做出测试。您不仅可以识别天际线上因子的变化，也可以看到对风险的影响，以及在行业、规模、风格分布上的变化。

投资组合实验室可以让您：

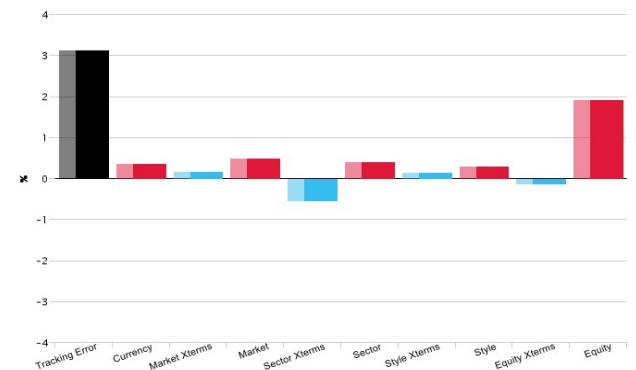
- 买入或卖出现有的股票，更改对某个基金的投资分配，或者替换别的基金；
- 增加或者减少现金的分配；
- 改变净值

图下是打开实验室的效果图，天际线和风险分析并未产生变化。

PORTFOLIO STYLE SKYLINE™



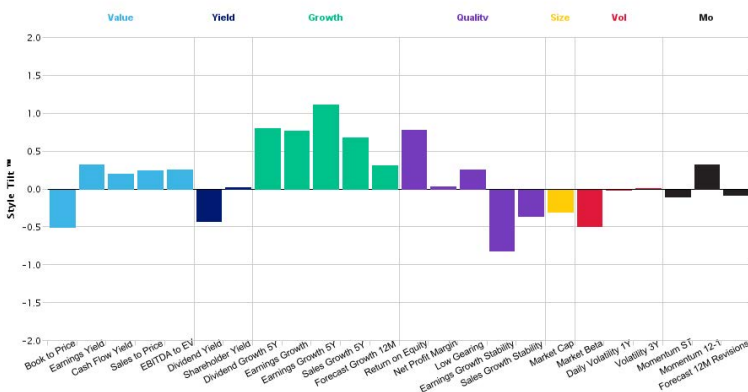
RISK ATTRIBUTION



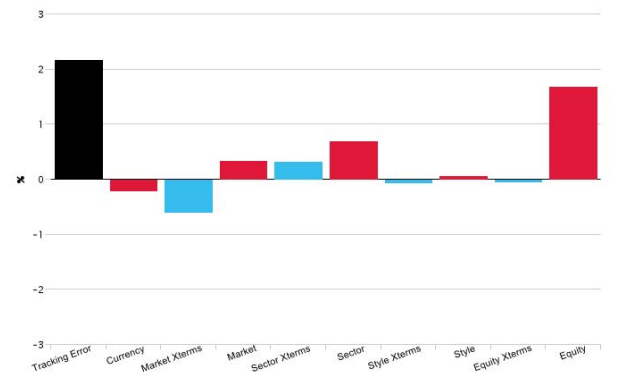
为了让您更好地体验这个模块的强大功能，现在举个例子。我们在组合里面增加了非必需消费品、通讯服务和房地产类股票的权重。您可以从宏观上一目了然看到这个新场景下，投资组合明显有很多成长因子的正增长。与此同时，跟踪误差也变大，因为来自于个股的风险提高。同样，如果您改变对基金的权重，我们也可以很快看到天际线上的因子暴露的增减。

图下为天际线和风险变化的幅度

PORTFOLIO STYLE SKYLINE™



RISK ATTRIBUTION

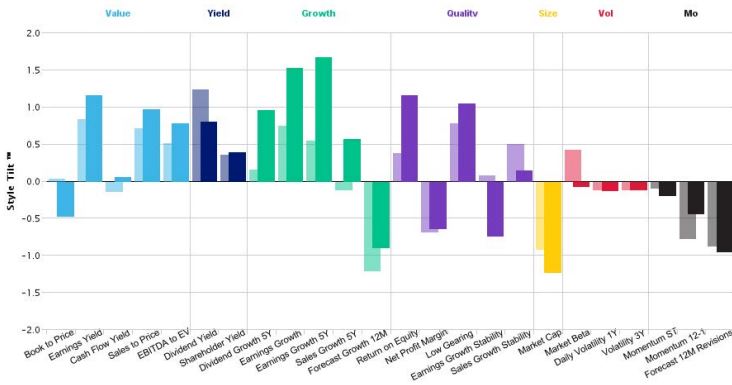


虽然是看到增减的幅度，但是我们如何与原来的投资组合相比较呢？

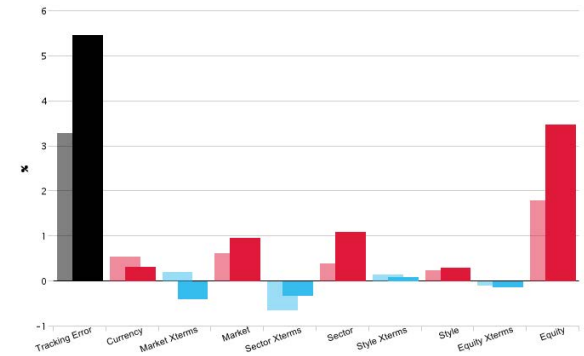
投资组合实验室为用户提供了直观的效果图，让“如果”场景前后的影响可视化。下图中阴影部分是原来组合的风格线，实心部分即为“如果”场景下的风格线。

下图为天际线和风险变化前和变化后的效果对比

PORTFOLIO STYLE SKYLINE™



RISK ATTRIBUTION



您可以把这个场景保存下来，在任何时间进行编辑修改；同时您也可以把这个场景分析用PDF的形式导出报告，让您轻松分享，免去文案的苦恼。

更强大的地方是，您保存场景后，系统会自动生成投资组合快照，这样您就可以在组合分析工具平台上看到完整、详尽的分析报告。您也可以直接用PDF模板导出，即时与客户或团队分享。

## 总结

Style Analytics 投资组合实验室模块为资产持有者、资产管理者、投资顾问提供了快捷便利的场景模拟工具，让用户简单测试出资产分配变化后带来的影响。这不仅能让我们的客户优化资产分配，更能协助客户在市场万变的情况下维持最佳的分配，避免不必要的风险和损失。

如果您想了解更多关于投资组合实验室的信息，或者想讨论报价，请随时咨询：

杰米 斯巴克  
 Jamie.spark@styleanalytics.com  
 + 613 9225 5020

王珏  
 Nicole.Wang@styleanalytics.com  
 +86 (0)21 2890 9032

## 关于 Style Analytics

Style Analytics是一家面向投资专业人士的独立全球软件系统供应商。我们能够让资产持有者、资产经理和投资顾问，对市场、同行和投资组合进行客观和全面的因子分析。

通过因子暴露，分析投资组合风险和回报的系统性原因 - 创造透明度，从而帮助投资专业人士验证并做出强有力的投资决策。

Style Analytics之前被称为Style Research，拥有超过20年的因子分析经验，为30个国家的280多家投资机构提供服务。我们广泛而深入的行业经验和专业知识，不断为我们的客户提供卓越的创新工具。

©2019 Style Analytics Ltd.保留所有权利。Style Analytics, Style Research, Peer Insights, Style Skyline, Style Tilt 和 StyleResearch®是Style Analytics的注册商标。StyleAnalytics™是Style Analytics的商标。