

REFINITIV® ALPHADESK

バイサイド向けクラウドベースの発注・ポートフォリオ管理ソリューション

リフィニティブのオープンで強力かつ包括的なトレーディングソリューションを導入することで、ポートフォリオ・マネージャーやトレーダーは、よりスマートな方法で迅速かつ効率的にトレーディングを執行し、ワークフローの柔軟性や運用効率の向上、コスト削減を実現できます。

Refinitiv® AlphaDeskは、リフィニティブが展開するトレーディングソリューションの要となるコンポーネントです。リスクやコンプライアンス・ツールも備えており、クラウドベースのマルチアセット・クラスのオーダー・マネジメントおよびポートフォリオ管理をバイサイド向けに提供します。

AlphaDeskは、投資および取引におけるワークフロー全体をサポートします。ポートフォリオ管理から、金融プラットフォームEikonを経由した取引に必要なプレレード・データや分析、受賞歴のあるRefinitiv® REDI® EMS (執行管理システム)を使用した取引執行、そして決済、照合、リスク管理を含むポストトレード機能に至るすべてに対応しています。また、世界最大のFIXオーダー・ルーティング・ネットワークの1つであるRefinitiv® Autex® Trade Routeにより、世界中のカウンターパーティーに効率的に接続できます。

AlphaDeskが選ばれる理由

- 複数ベンダーのデータフィードや複数の電子取引システムと連携して動作し、カスタディアン/ブライム・ブローカー、ファンド・アドミニストレーターにも対応した**柔軟なシステム**
- 社内の全注文を**1か所**で管理
- P&Lエクスポージャーを**リアルタイム**で追跡し、100を超えるオプション設定と柔軟なグルーピングが可能
- あらゆるアセット・クラスおよび証券タイプ、上場銘柄、OTC銘柄を**包括的にサポート**
- **タブレットやモバイルデバイス**に対応し、ポートフォリオや取引を社外にいてもモニタリング可能
- ソフトウェアの展開、モニタリング、アップグレードは**クラウド**経由で実行
- **高度な設定が可能なソフトウェア機能とAPI**を使用して、他のベンダー・アプリケーションや社内システムとの相互運用が可能
- **マネージド・サービスのサポート・スタッフ**がFIX接続を含むお客様の取引全体をモニタリング

機能

- **オーダー・マネジメント**
社内の全注文を1か所で管理。注文を数百か所に送信し、リアルタイムに約定を受信。AlphaDeskは主要な取引執行システムとの連携に対応
- **ポートフォリオ・リバランス**
他のポートフォリオやモデルポートフォリオに対して、最適なポートフォリオに戻す。ポートフォリオのサブスクリプション適用に有効
- **リスク管理**
パフォーマンスや他のポートフォリオの測定基準に基づき、取引プロセスのさまざまな段階においてリスクを評価。バリュー・アット・リスク、シナリオ分析、流動性リスク、金利リスクを含むリスク管理が可能
- **手数料管理**
ユーザーが定義した取引および証券のパラメーターに基づき、手数料を決定
- **リアルタイムのポートフォリオ・モニタリング**
ポジションの利益寄与度をリアルタイムに更新・表示
- **包括的なポートフォリオ会計処理**
総勘定元帳や勘定科目表へのアクセス
- **コンプライアンス**
ファンド要件や社内のポリシー、規則に遵守しているかをチェックするルールを設定し、取引前または取引後にコンプライアンスを確認することが可能。米国1940年投資会社法(40 Act)とこれに基づくリキッド・オルタナティブ、および欧州のUCITSをサポート。また、MiFID IIを含む報告義務にも対応
- **シャドウNAV**
全種類の通貨および証券の未収支勘定、配当を含む正確な純資産価値を計算
- **ヒストリカルレポート**
詳細な取引履歴、さまざまな税制度に対応する損益レポートの表示、複数の期間における利益寄与度の算出、カスタマイズされたレポートの生成、手数料や純利益予想の分析など

AlphaDesk Multi-Strategy NAV: 930,258,227
Day: -8 bp Month: 471 bp Net: 24% Gross: 181%

SECURITY	DESCRIPTION	QUANTITY	PRICE	CHANGE PCT	CHANGE BPS NAV	Δ	DAY PROFIT	EXPOSURE PCT NAV	EXPOSURE	VALUE
OPPORTUNISTIC										
BIR.CA	BIRCHCLIFF ENERGY LTD	221,500	11.20	0.00%	0.0		0	1.79%	16,688,088	16,678,837
FN.V.CA	FRANCO-NEVADA CORPORATION	-9,800	66.41	0.00%	0.0		0	-0.06%	-595,824	-595,824
NKO.CA	NIKO RESOURCES LTD	35,000	1.92	0.00%	0.0		0	0.01%	61,522	61,522
M.PRE.CA	PACIFIC RUBIALES ENERGY	500,000	10.18	0.00%	0.0		0	0.50%	4,659,895	4,659,895
SEO.CA	STORM EXPLORATION INC.	400,000	28.02	0.00%	0.0		0	1.10%	10,260,924	10,260,924
FN.VT.C	FRANCO-NEVADA \$20 WARRANT A.	500	46.20	0.00%	0.0		0	0.00%	30,399	21,148
GROWTH										
HF.CA	HANFENG EVERGREEN	534,400	0.71	0.00%	0.0		0	0.04%	347,363	347,363
B.BB.20.PUTS.AUG.2.	BLACKBERRY AUG 20 PUTS 2014	350	1.63	0.00%	0.0		0	0.00%	0	52,207
F.US	FORD MOTOR CO	280,000	17.42	0.00%	0.0		0	0.52%	4,877,600	4,877,600
GOOG.US	GOOGLE INC	5,260	574.78	0.00%	0.0		0	0.33%	3,023,343	3,023,343
STX.US	SEAGATE TECHNOLOGY	100,000	57.93	0.00%	0.0		0	0.62%	5,793,000	5,793,000
TTM.US	TATA MOTORS LTD (ADR)	187,800	42.20	0.00%	0.0		0	0.85%	7,925,160	7,925,160
FUNDAMENTAL VALUE										
ABX.US	BARRICK GOLD CORP	75,000	20.82	0.00%	0.0		0	0.17%	1,561,500	1,561,500

Unplaced (0) Working (3) Filled (0) Allocated (0) Cancelled (0) For Approval (0) All Today (3)

SECURITY	ORDER	ORDER QUANTITY	ORDER STATUS	FILLED	ALLOCATION METHOD	INF DATE	Δ	BROKER	LEGI ID	LEGI2 ID	TIME IN FORCE	TRADE ID	STRATE
TM.US	Buy	3,200.00	PreAllocated	1,600.00	Balance Percent.	04/30/2014		BARCLAYS	0	0	Day	1183	FUNDAM
PG.US	Sell	381,800.00	PreAllocated	200,000.00	Use Pre-Allocati.	06/05/2014		MORGAN STANLEY	0	0	Day	1188	
MFI.CA	Buy	18,500.00	PreAllocated	12,000.00	Use Pre-Allocati.	06/05/2014		MULTI	0	0	Day	1189	EVENT DR

Pending (0) Open (3) Filled (1) Allocated (0) Cancelled (0) For Approval (0) Target Selection (1) All Today (4)

SECURITY	ORDER	ORDER QUANTITY	FILLED	AVERAGE PRICE	ALLOCATED QUANTITY	BROKER	COMMISSION	COMMISSION TYPE	ORDER STATUS	SETTLE AMT PER UNIT	TI
TM.US	Buy	1,600.00	1,600.00	107	.00	BARCLAYS	3.00	Cents Per Share	Filled	107.08	04/30
PG.US	Sell	381,800.00	200,000.00	77	.00	MORGAN STANLEY	.00	Cents Per Share	Filled	77.30	06/05
MFI.CA	Buy	10,000.00	5,000.00	13	.00	TD SECURITIES	.00	Cents Per Share	Filled	13.00	06/05

設定可能なAlphaDeskのPortfolioグリッド

©Refinitiv 2020. All rights reserved.

AlphaDeskはリフィニティブの商標です。本書はリフィニティブの機密・専有情報を含みます。所有者の明示的な書面による許可がない限り、本書を（一部または全部の如何を問わず）複製、配布、再発行または再配布することは禁止されます。

REDI Global Technologies LLC (FINRAおよびSIPCの会員)、REDI Technologies Limited (Financial Conduct Authority (FCA) (金融行動監視機構) Firm Reference Number (FRN) (企業参照番号) #612490) およびそれらの関係会社 (総称して「REDI」) が提供する資料はすべて、一般的な情報提供のみを目的としたものです。本書は、institutional accounts (機関投資家) (FINRAの定義による) および Eligible Counterparties (適格取引先) (FCAの定義による) のみを対象としており、retail investors/persons (個人投資家) を対象としたものではありません。一部の国や地域では、REDIのサービスおよび関連サービスは提供されていません。

本書はマーケティング資料であり、いかなる金融商品についてもその購入または売却の推奨、勧誘、あるいは申し出を行うものではありません。オプション取引にはリスクが伴うため、すべての投資家に適しているわけではありません。オプション取引のリスクに関する詳細情報については、Option Clearing Corporationによる「Characteristics and Risks of Standardized Options」をご参照ください。REDIは、これらの資料の正確性または完全性を保証せず、また資料について (明示・黙示を問わず) 何らの表明または保証も行いません。REDIは、これらの資料またはその使用に関して一切の責任を負いません。REDIは、本書を提供することにより何らのサービスまたは助言を行うものではありません。本書にはREDIの専有情報が含まれており、REDIの書面による明示的な許可がない限り、本書（一部または全部の如何を問わず）を複製、配信または配布することを禁じます。REDIによってお客様に提供されるすべての資料およびサービスは、該当するREDIとの該当契約の契約条件に従うものとします。

発行元: リフィニティブ・ジャパン株式会社

Webサイト: refinitiv.com/ja/alphadesk

お問い合わせ先

URL: refinitiv.com/ja/ask

電話: 03-6743-6515

@RefinitivJP

Refinitiv

RE1311296/11-20

REFINITIV®
DATA IS JUST
THE BEGINNING®