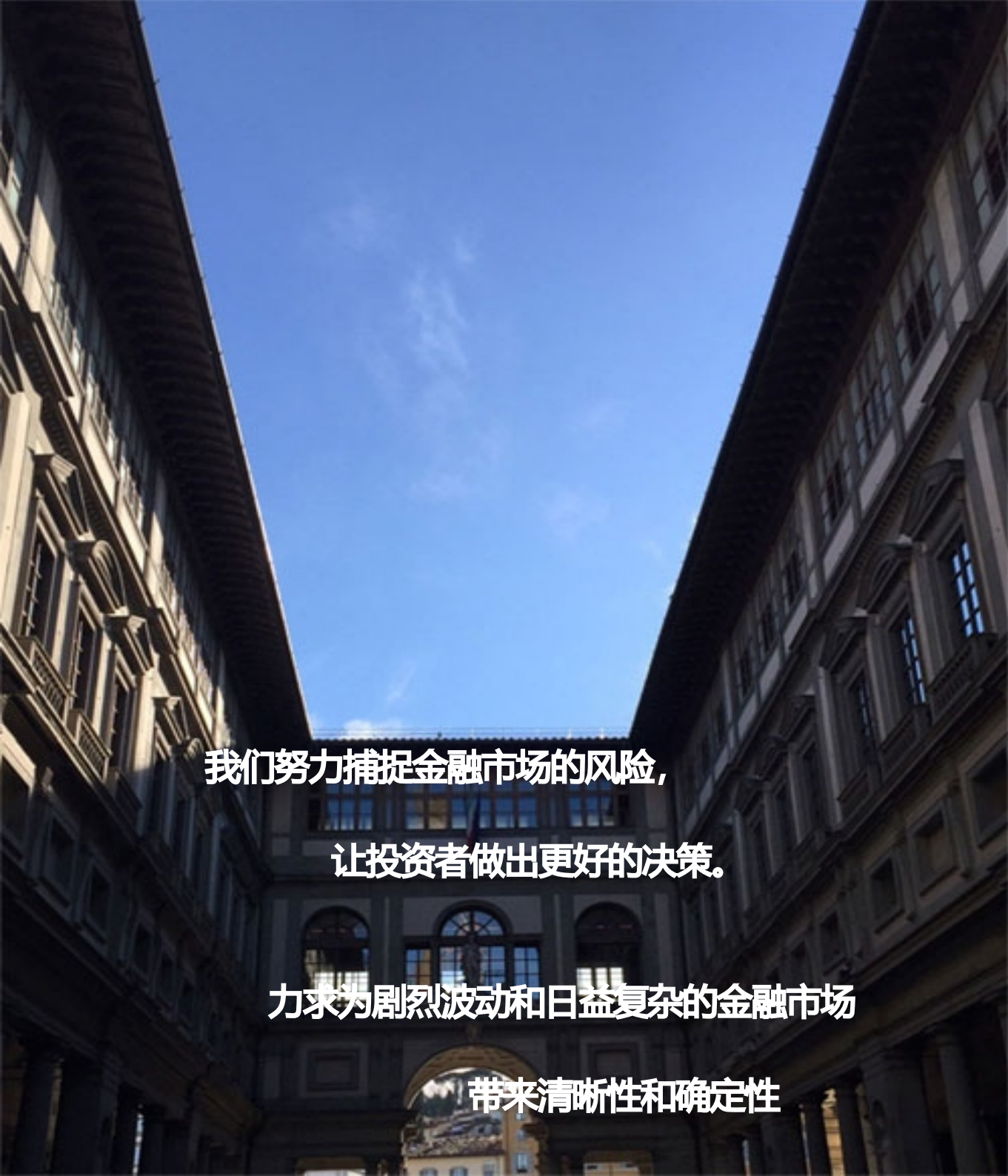




解读曲线背后的语言

Behind the Curve

Just Monitoring Risk



我们努力捕捉金融市场的风险，
让投资者做出更好的决策。

力求为剧烈波动和日益复杂的金融市场
带来清晰性和确定性



更好的投资风险管理决策

Taking better investment risk management decisions from SECF





基于我们独特的视角，我们建立了全球股票观察系统，以监控金融市场波动和控制风险以及捕捉机会，并积累有价值的历史市场数据，这些数据难以复制，并为我们提供了实质性的竞争优势。

SECF致力于研究分析指数和股票的风险，帮助投资者构建和管理更好的投资。SECF为投资者提供风险管理见解和风险监控工具。我们在风险测量领域拥有深厚的专业知识，这些领域基于我们独特的研究。

我们广泛的产品线可以满足客户对所有主要资产类别的需求，并为他们提供风险和绩效管理的一致方式。我们拥有高度灵活的业务模式，使客户能够选择他们需要的各种产品和服务，并将其集成到自己的投资流程和方法中。

投资者使用我们的风险管理系统来监控和控制他们的投资组合中的风险来驾驭当今复杂的市场，我们为投资者提供关键的风险管理数据和分析见解。

随着金融市场的发展，我们不断创新风险分析模型的研究。我们致力于确保我们的数据准确，我们从证券市场收集市场数据，分析市场波动性，长短数据和基本变化，我们在将其纳入我们的研究报告之前进行复杂的验证和严格甄别。我们数据的广度，深度和准确性是客户选择SECF的重要原因。





Behind the Curve

解读曲线背后的语言



曲线背后解读的是什么语言呢？

金融市场的潜在波动风险

金融市场潜在的投资机会

美国股市是全球最成功的证券市场

我们来看一下，在美国市场谁都在关注曲线背后的语言



机构投资者

(通过解读曲线背后的语言，以此不断调整交易策略)

美联储、上市公司股东、基金投资者、政府、
证监会、华尔街金融机构

(通过解读曲线背后的语言，来不断修正各自的策略，
可调节的货币政策，企业经营策略，密切关注金融
市场波动的风险，调整国家金融战略)



美国道琼斯指数一路上涨，2019年突破27000点，回看2008年金融危机，道指同样下跌至7000点，其后是什么力量推动道琼斯指数突破27000点。

美联储的QE政策

美股上市公司业绩改善预期和业绩兑现

美联储的货币政策调节

美股上市公司股份回购

回看一路上涨，这些做多力量总是在市场运行到关键时刻，果断推出做多能量进而推动股指向上攀升。

其关键要素在于市场参与者尊重曲线背后语言的客观性，认真审视自己的策略，选择恰当时机引导市场走向。

DOW and Behind the Curve

道琼斯指数与曲线背后的语言

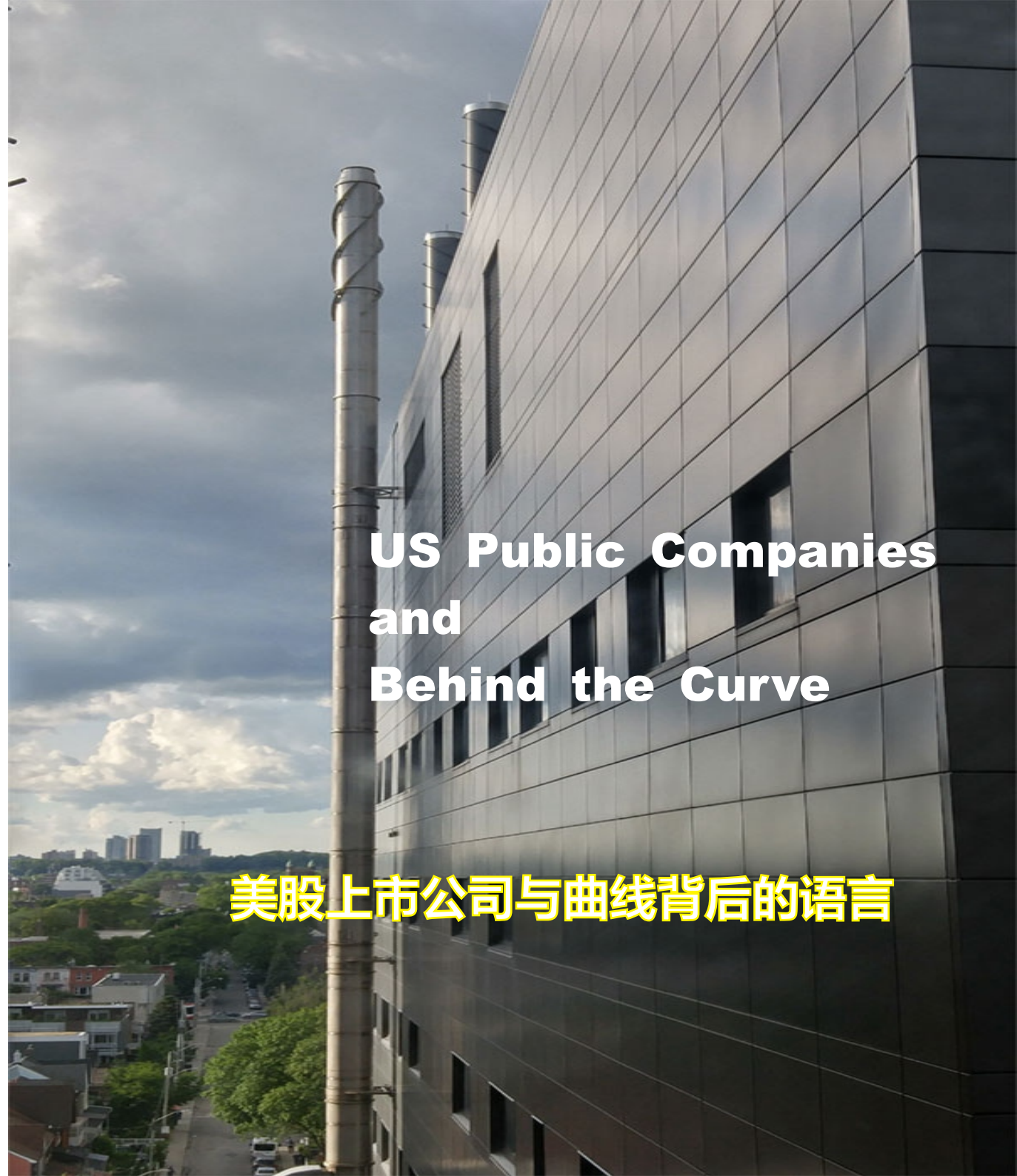
优秀上市公司

区间盘整阶段，公司不断发布下阶段的战略计划

用金融市场熟悉的语言，通报公司最近的工作和数据

伴随着公司的战略计划实施，股价持续上升

为何上市公司经营数据不佳之际，股价保持强势，因为公司用专业的分析告诉投资者，如何站在行业的角度看待企业的未来发展和数据改善的机会



**US Public Companies
and
Behind the Curve**

美股上市公司与曲线背后的语言



为了吸引资产，管理者必须在人群中脱颖而出。挑战在于，在当今竞争日益激烈的市场中，差异化比以往任何时候都更加显著和重要。

风险管理工具以帮助资产管理构建和管理更好的投资组合。资产所有者使用我们的研究，数据，基准和多资产类风险管理工具来确定他们雇佣的经理是否提供适当的风险调整回报。资产经理使用风险管理模型和绩效归因工具来了解其投资组合中的回报驱动因素。

投资事项

随着全球化的发展和金融市场的日益一体化，公司越来越多地在多个国家和地区开展业务，其业绩可能越来越多地与其本国以外的经济和政治条件联系在一起。

此外，专业投资者 - 无论是机构投资者，资产管理者还是财富投资者 - 经常寻求了解他们在更远的地方投资时的风险。

识别此类意外影响的最佳方法是利用代表整个机会集的指数，没有差距，没有重叠，也没有固定数量的成分股。

定盘星全球股票观察监测系统作为监测指数为全球专业投资者用于投资分析，绩效评估，资产配置，对冲以及创建各种指数衍生品，基金，ETF和结构性产品。

从市值加权的区域，国家和行业指数到基于因子投资等策略的指数，现代指数战略使客户能够以一致的方式构建和监控投资组合，避免风险。



独特视角洞察金融市场波动风险

解读曲线背后的语言

定盘星全球股票市场观察系统

股价和指数波动风险分析由灵活的技术提供支持，使客户能够管理风险，交流结果并做出更好的投资决策。

风险分析产品为机构投资者提供波动风险和回报的综合视图。

我们的研究内容和工具可帮助机构投资者做出更好的投资决策，增强他们对所持有的股票波动风险的理解和分析，涵盖短期，中期和长期时间范围。

全球股票市场观察

定盘星全球股票市场观察系统目前监测全球49个发达市场和新兴市场的23,269个股票及指数ETF，32个行业，密切关注全球股票市场波动。它为49个发达市场和新兴市场的股票提供了无缝，现代和完全监测视图。

定盘星全球股票市场观察系统提供了一种现代，无缝且完全集成的方法来衡量股价波动的风险。其风险标准代表投资策略，并记录49个发达市场和新兴市场的股票波动风险。

定盘星全球股票市场观察系统的全球股票监测旨在关注49个发达市场和新兴市场中大型和中型股票的波动风险。

风险分析



定盘星与曲线背后的语言

1999年

开始建立定盘星监测系统，以监控股市波动和投资机会的风险。
定盘星监测系统在1999年开始观察美国股市，并发现2000年2月下旬纳斯达克市场的风险。

2002年

2002年10月，定盘星监测系统发现巴西股票的投资机会，其未来20年的指数投资有10倍的回报。

2003年

定盘星监测系统开始监控中国A股指数。

1月，定盘星监测系统发现了道琼斯指数的投资机会。

5月，定盘星监测系统发现了印度股票的投资机会，该股票在未来20年内将获得10倍的指数投资回报。

2004年

10月，定盘星监测系统发现了Amzon的投资机会。

10月，定盘星监测系统发现了中国互联网公司（新浪，搜狐，163等）的投资机会。

2005年

2005年9月，定盘星监测系统发现了中国股票的投资机会。

2006年

定盘星监测系统开始每周发布研究报告，分析未来市场的波动风险。

2007年

8月，定盘星监测系统发现了中国股票市场的风险。

9月，定盘星监测系统发现了美国股票市场的风险。

定盘星监测系统开始发布每日研究报告，分析未来市场的波动风险。

2008年

12月，定盘星监测系统发现了全球股票市场的投资机会。

2010

定盘星监测系统实现每小时发布研究报告，分析未来市场的波动风险。

2013年

定盘星监测系统监测到道琼斯指数加速上涨的迹象

2015年

定盘星监测系统开始监控中国股市的指数，ETF和部分个股。5月中旬监测到中国A股出现高风险迹象，截止到5月底，中国A股风险指数始终在85-90分之间波动，确定A股进入极高风险阶段。

2016年

1月，定盘星监测系统监测到道琼斯指数有突破18000点加速上涨的迹象

2019年 - 2020年

定盘星监测系统将全面进入中国股市，监测中国A股市场，科创板，商品期货。

解读股市脉动





监测指数策略

指数投资提供了一种现代，无缝且完全集成的方法来衡量完整的权益机会集，没有任何差距或重叠。监控指数策略能够以一致和完整的方式构建和监控投资组合，避免指数的波动风险。

监控指数战略的核心是为所有市场提供一致的标准，并确保可投资性，可复制性和成本效率的最佳实践。

连接

涵盖完整的机会集及其所有细分市场，包括全球各主要市场和商品期货领域。

指数监测均使用全球行业分类标准创建，监测各市场的指数和ETF基金，提供了风险监测的通用框架。它们提供了对可投资机会集的详尽报道，其中包含波动蕴藏的机会和风险。

覆盖

适用于每个市场的一致方法。我们的监测系统使用短期波动性指标来评估市场的动态，同时也使用长期风险评估模式，我们认识到发达市场和新兴市场之间波动性的差异，以及提高指数的可投资性和可复制性。我们通过使用规模和波动性强调其指数的可投资性和可复制性。

定盘星全球股票市场观察

定盘星全球股票市场观察

-- 最新方法 --

定义指数

定义指数帮助您在投资过程中清楚了解指数的长期和短期趋势。

定义指数正在引入风险监测工具和数据分析，旨在帮助机构投资者衡量其投资的可持续性。

定义指数重点关注：

波动，交易量，

基本面，

赋权，业绩和治理。

定义指数旨在确定指数投资的风险波动，定义指数服务可帮助投资者制定阶段性投资策略。

根据定义指数可持续影响指标，投资者可以更新自己的指数多空交易策略。可持续定义指数解决方案可以提前预估投资风险。



交易数据分析

我们备受推崇的交易数据分析工具每小时、每天、每周和每月为客户提供广泛的风险计算。

我们独有的分析模型之一是交易数据分析，它计算在给定时间段内投资者买入和卖出交易带来的市场波动的预期风险测算。

2012年10月，我们提出了四种方法来测试投资者交易行为下产生的波动对风险预期分析。这些测试通常需要存储更多信息，但不会引入任何概念限制或计算困难。



我们的方法

服务

高度灵活的研究分析，使客户能够快速获取自定义报告并执行临时分析以识别风险区域。

由专门的团队提供的可操作的解决方案，可以提供定制的报告。

我们是提供风险管理工具以帮助资产管理者构建和管理更好的投资组合的领导者。

资产所有者使用我们的研究，数据，基准和多资产类风险管理工具来确定他们雇佣的经理是否提供适当的风险调整回报。

资产经理使用我们的模型和绩效归因工具来了解其投资组合中的回报驱动因素。



风险分析报告

我们使用盘前，盘中和收盘报告来识别和沟通市场，了解波动，流动性和交易对手风险方面拥有的共同语言

研究报告分为每小时版，午间版，每日收盘报告，每周研究报告，每月研究报告五种形式

报告涉及

指数，各股及投资组合的风险指数
运行轨迹的最新定义
交易数据分析
短周期波动风险分析

中长周期波动风险分析

交易持仓分析

交易策略分析

综合性资讯分析

风险因素管理分析





投资安全的守护者

适用于我们的风险研究

资产所有者使用我们的研究，数据，指数和多资产类风险管理工具来确定他们雇佣的经理是否提供适当的风险调整回报。

首席投资官使用我们广泛的高质量数据来开发和测试投资策略。他们还使用我们的模型和绩效归因工具来了解其投资组合中的回报驱动因素。

基金管理者依靠我们的风险管理要素模型，数据和投资组合构建和优化工具来构建投资组合并使其与投资目标保持一致。

指数基金经理使用我们的指数数据分析，股票因子模型和优化器来构建其指数基金和ETF。

首席风险官选择我们的风险管理系统来理解，监控和控制他们所保护的投资组合中的风险。



风险管理的解决方案

资产所有者

定盘星全球股票观察监测系统通过一致的框架和工具来评估其投资组合，帮助上市公司，养老金，主权财富基金，保险公司和其他机构做出更好的投资风险管理决策。

日内交易分析，通过定盘星全球股票观察监测系统的工具和服务获得清晰度。

风险指数，有效地评估市场波动风险。

强大的风险管理支持，多市场风险管理平台。

基金经理

定盘星全球股票观察监测系统通过我们在多市场类别，风险因素和交易管理方面的研究，帮助管理人员应对当今金融业所面临的无与伦比的转型。

风险因素管理，风险因素可以将数据点转化为可操作的见解。

交易投资管理，考虑投资过程中的各种因素，实施交易管理策略。

风险指数，有效地评估市场波动风险。

金融机构/监管机构

我们的研究和分析提供给您驾驭复杂性所需的工具和解决方案，帮助您做出更好的决策。

多市场风险因子模型，清楚地确定复杂，动态策略中的风险和回报的驱动因素。

定盘星全球股票观察监测系统的监管解决方案

定盘星全球股票观察监测系统的托管服务，向我们的专业人员外包数据处理，系统管理和报告。

创新是我们一直在做的事情

这些创新对全球经济的影响促使我们继续向前发展。

我们的信念是，投资安全也意味着社会回报，可持续发展和我们共同的未来。

我们的重要任务是帮助投资者做出明智的决策。



探索更多创意，塑造当今和未来的世界。

以投资风险数据和超过20年的投资情报为后盾。

**我们将创新理念应用于现实世界的
投资交易。我们风险管理模型的发展为
行业范围内的许多定量和风险管理实践铺平道路。**

**我们的分析研究为投资者提供了从风险角度看市场，
资产类别和个人证券之间联系的新见解。**

**为了帮助客户取得卓越成果，我们
不断开发对全球市场和行业的新见解。**

我们的目标是帮助和塑造独有的风险管理理念。

理性与客观是我们所涉及每个领域的准则

解读曲线背后的语言，驾驭投资风险

定盘星全球股票观察监测系统，投资安全的屏障

了解更多定盘星全球股票观察监测系统的详细情况，欢迎
发送电子邮件给我们客户经理，邮箱：info@secfortune.com

