



# 创造力与投资

洞悉市场波动，聚焦风险与机遇

**CriterionStar Monitor**

---

[Secfortune.com](http://Secfortune.com)









## 更好，更安全的投资决策

我们努力捕捉金融市场的风险，让投资者做出更好的决策。

我们力求为动态和日益复杂的金融市场带来清晰和确定性。

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。



从容驾驭当今复杂的投资世界

# 博闻强识 敦行致远

我们致力于投资可持续性和交易安全。我们创新的产品和服务，使我们的客户能够做出更明智的投资决策。

## 投资安全

投资者使用我们的风险管理分析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。通过我们的风险管理系统研究和应用，我们提供见解，分析和工具，以支持包含可持续性考虑因素的投资流程。

## 持续创新

随着金融市场的发展，我们不断创新指标风险分析和风险分析模型的研究。

## 独立研究

我们的研究团队将创新理念应用于客户最紧迫的挑战。结合学术理论和实践经验，我们专注于跨交易和策略的投资安全问题。我们的独立性使我们能够专注于客户的需求。

## 数据研究

我们致力于确保我们的数据准确，可靠和严谨。我们从证券市场收集市场数据，分析市场波动性，长短期数据以及数据在交易模型上的微妙变化。



# 定盘星全球股票观察系统

专注于监控和研究全球的证券市场，商品期货和现货市场，贵金属市场，外汇市场以及债券市场。我们的优势源于：

## 研究

我们的研究团队具备丰富的资本市场专业知识和交易经验，同时拥有全面的分析技能与卓越的探索精神。

我们的研究涵盖多行业，多领域。

透过媒体平台定期发布全球战略思想领导力研究报告，提供及时、相关的行业洞察。利用独有的技术和数据科学研究模式，推动产品开发与可扩展的解决方案。

## 解决方案

多维度研究分析模型，使客户始终如一地构建和评估投资组合。

从产品开发到风险管理，再到绩效归因分析，我们支持贯穿于主要资产类别的整个投资流程。

我们的产品、数据、分析和决策支持工具，有效帮助我们的客户做出更明智的投资决策。

## 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。

提供高效的交易托管和实时监控。







# 让投资者 洞悉金融世界脉动

创新理念应用于现实世界的投资交易，我们提供决策支持工具以及严格的研究、透明的方法，以及全球的视角，力求帮助客户解决投资问题。

我们的客户，资产管理人、资产所有者、银行、财富管理和其他金融中介机构通过我们的研究分析做出更明智的投资决策。

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。我们的目标是塑造我们所涉及的每个领域的领导力。

我们为有下列需求的客户提供决策支持工具：

- 提升投资绩效
- 强化市值管理战略
- 控制波动风险
- 符合监管报告要求
- 创新方法，以整合可持续的投资战略

# 洞察力、创造力与

# 投资决策

## 创新

在二十多年前推出开拓性全球股票监控系统以来，我们持续研究更新大量数据存储库，以不断改善我们的模型、数据分析和风险指数，目前已形成了稳定的监控模型，为金融工具提供风险控制基准。

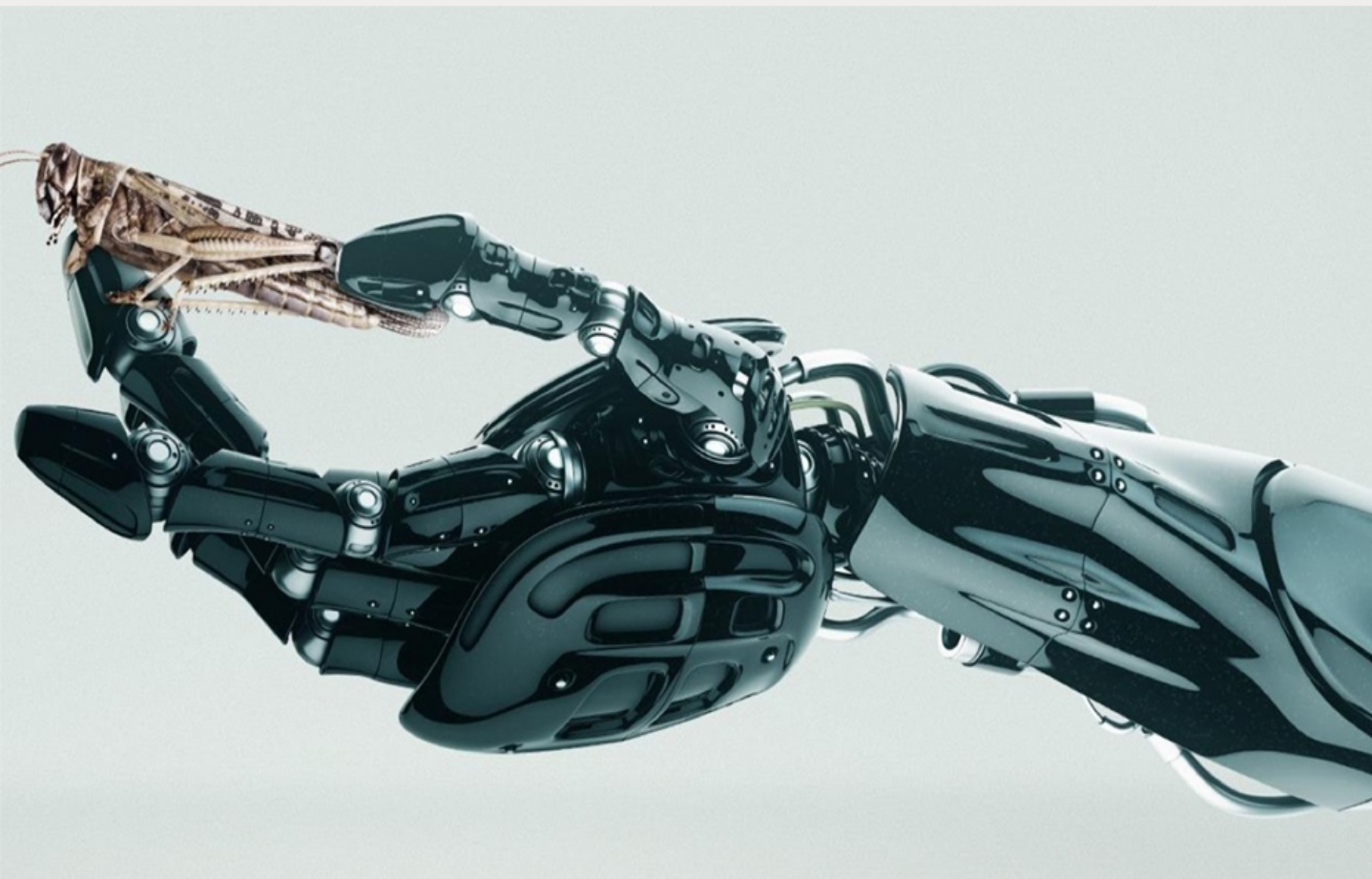
## 风险分析

多市场资产和指数风险和绩效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，增强他们对所有主要资产类别的市场，信贷，流动性和交易对手风险的理解和分析，涵盖短期，中期和长期时间范围。







## 独特研究

通过充分利用我们在资本市场的专业知识和采用人工智能及其它先进技术的科学方法，使我们富含数据的内容里包括了多种流动性、非流动性全球资产类别。

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，增强他们对所有主要资产类别的市场，信贷，流动性和交易对手风险的理解和分析，涵盖短期，中期和长期时间范围。

## 提供可行方案

我们支持投资流程的方方面面，通过将无数数据点转化为可行的洞察力和解决方案，让投资者洞悉全球金融市场波动。

全球股票观察系统通过一致的框架和工具来评估其投资组合，从而帮助养老金，主权财富基金，保险公司和其他机构做出更好的投资决策。

# 分享

## 洞悉市场波动，解读曲线背后的语言

为  
**上市公司股东**  
提供股价走势跟踪分析

### 客户需求：

一家美国的上市公司在某阶段成为市场上持有看跌期权最多的公司，为此公司希望改变外界对公司的看法，密切跟踪公司股价波动的趋势变化，并通过希望不断调整公司发展战略来吸引投资者的关注。

### 解决方案：

我们为客户设计了一套跟踪分析方案，以获取解读公司股价曲线背后的语言。

### 成果：

我们灵活的技术协助客户清晰了解了投资者对公司股价的定位，低估还是高估。正是公司了解了投资者的买卖交易的原因，不断将公司的未来发展战略传递给投资者，为此伴随着公司业务的发展，股价在200多美元/股起步上涨，一年多时间股价涨幅近10倍。







## 改善 主权财富基金 风险管理框架

---

### 客户需求:

欧洲地区某主权财富基金希望提升其投资的风险分析质量，他们自己无法执行某些更复杂的计算，开始寻找一位可以帮助其简化这些复杂任务的供应商。

### 解决方案:

我们开发了一个独特的解决方案，能够提供执行内部复杂计算所需的数据。该解决方案结合了CriterionStar的定义指数股票分析，风险指数与一项定制化实时跟踪分析实施措施，将我们的风险研究与客户达成实时链接。

### 成果:

复杂的数据分析成功在客户公司内部运行，丰富的数据补充了其内部可视化和决策制定流程，从而对公司的投资带来更严格的风险分析。

## 支持 量化投资经理 增强风险研究能力的愿望

---

### 客户需求:

一家总部位于美国、专门从事定量投资的全球投资管理公司在寻找一种增强其深度研究风险管理能力的途径，以获取对全球金融风险能客观理性地预判。

### 解决方案:

我们提供了一项包括风险指数、定义研究、波动轨迹跟踪分析和数据分析的强大分析组合，以及投资组合构建和报告的数据分析。

### 成果:

客户在其股票投资组合以及单独管理的账户中成功做到了提前预判风险，以此管理好持仓头寸。



## 风险监控管理解决方案

定盘星全球股市监控系统（CriterionStar Global Stock Observation System）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交易回报来源提供了无缝，现代和完全整合的视图。

监测全球投资市场，在密切关注细微波动是否会引发更大的风险的同时也考虑到反映各地区条件，市值规模，行业和组合的变化。

定盘星风险因子监测分析系统是由Secfortune创建的波动风险因素模型，用于衡量与市场相关证券的整体风险，密切关注指数和股票的波动，分析波动是否超出安全边际。





定盘星风险因子监测风险指数分析模型使用单一风险值来衡量证券的相对风险。该风险值由数字代表：0到100之间的百分位数。

#### 定盘星股市风险指数

针对全球所有市场， 0表示最稳定，  
100表示最不稳定。

- 0-20 表示波动稳定，无风险，投资安全阶段；
- 21-50 表示波动能承受，低风险，投资安全阶段；
- 51-60 表示波动开始不稳定，风险增加，投资开始谨慎阶段；
- 61-80 表示波动过大，风险剧增，投资易亏损，注意对冲工具使用的阶段；
- 81-90 表示波动剧烈，市场进入高风险状态，投资必须停止，对冲工具使用的阶段；
- 91-100 表示市场已经进入或者即将进入暴跌阶段。

例如，风险值为65的证券被计算为风险剧增，波动过大，注意投资亏损，考虑对冲工具使用。

定盘星风险因子监测分析系统包含多个数据指标，包括成交价格，股票交易额，盈利增长和高级债务评级等。该模型重点监测成交价格和股票交易额，同时监测三个主要组成部分相关的风险因素：行业风险，不同投资主题风险和公司特定风险。

投资者和投资组合经理在评估市场或投资组合时进行审查的一个因素是投资风险。识别和衡量投资风险是决定投资哪些资产时采取的最重要步骤之一。这是因为所采取的风险水平决定了资产或资产组合在交易周期结束时的回报水平。因此，最广泛接受的财务原则之一是风险和回报之间的权衡。

投资组合经理可能用来衡量投资风险的一种方法是评估一系列广泛因素对各种资产或证券业绩的影响。使用因子模型，证券的回报生成过程由各种常见基本因素的存在以及资产对每个因素的独特敏感性驱动。由于一些重要因素可以在很大程度上解释投资的预期风险和收益，因此可以使用因子模型来评估投资组合的回报中有多少可归因于每个公因子风险。因子模型可以分解为单因子和多因子模型。可用于衡量投资组合风险的一个多因素模型是定盘星风险因子监测分析模型。

定盘星风险因子监测分析模型中包含了许多可用于预测和控制风险的因素。多因素风险模型使用了许多代表投资特征的关键基本因素。其中一些因素包括收益率，盈利增长，波动性，流动性，动量，市盈率，规模，杠杆和增长；用于描述投资组合或资产的风险或收益的因素，从定量但未指明的因素转变为易于识别的基本特征。

# 视角

## 独特的视角，特有的研究模式

在投资领域，捕捉任何因素的变化，任何特征的改变，有助于释放资产的长期风险和投资回报的保障。我们旨在捕捉市场的波动风险因素以保护投资收益。

在投资流程中使用准确且一致的风险管理工具是充分理解和捕获所有风险和回报的独特驱动因素的关键。

监测波动和发现投资机会是定盘星全球股市监控系统工作重心。我们的定盘星全球股市监控系统采用创新的维护方法构建，可以稳定地跟踪指数波动以实现投资的平衡，该系统足够灵活，可以快速调整以适应不断变化的机会集。



### 我们跟踪全球范围内的各主要市场指数和股票

#### 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，帮助上市公司股东、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。

#### 资产经理

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。风险因素可以将数据点转化为可操作的见解。

#### 银行

我们的研究，分析和索引通过提供您自信地驾驭复杂性所需的工具和解决方案，帮助您做出更好的投资决策。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，充满信心地浏览复杂的法规。我们的托管服务，银行向我们的专业人员外包数据处理，系统管理和风险分析研究。

#### 财富管理

我们的研究，分析和风险管理为您提供构建，监控和调整投资组合的工具，以满足客户的需求并帮助他们实现目标。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。





## 应对投资世界挑战的工具

### 风险研究

风险因子监测系统主要密切关注指数和股票的波动，分析波动是否超出安全边际。监控工具主要核心部分包括：定盘星风险因子监测风险指数分析模型；定盘星风险因子定义指数股票分析模型和定盘星风险因子监测运行轨迹分析模型

### 交易管理

交易管理系统主要适用于指数,ETF和股票的买入和卖出交易，期权交易，股指期货以及商品期货。其系统的特点是定义多空，定义交易结构，多空转折点，多空生命线，交易的细节管理，交易阶段策略，交易各阶段对冲工具使用



## 数据分析

### 数据模型

借助研究增强型内容和模型工具，我们的分析为投资者提供应对风险和回报的综合视角，以帮助其理解和控制所有主要资产类别和投资回报期的风险。我们独有的模型工具力求更加理性客观分析和预判，帮助投资者及时调整投资策略。

### 解决方案

我们创建了一个用于评估、实施和报告因子敞口的框架。我们的因子解决方案包括股票、期货、外汇和多资产类别。它们帮助投资者更好地了解其整体投资组合和单个持有资产的风险和收益驱动因子，以优化和构建基于因子的解决方案。

**我们为总资产逾9,940亿美元的投资者提供数据分析服务和风险管理研究**





## 投资管理

### 投资管理

旗下的基金以股票型基金为核心，  
总管理资产逾1,030亿美元

投资重点关注美国股市和欧洲股市

投资新兴市场的资产规模逾300亿美元

### 跨越风险

凭借我们独有的数据分析模型，使投资管理更加安全，成功跨越全球金融市场的震荡风险



投资者正面对波动剧烈和日益复杂的金融市场，如何做出更好的决策，以防范金融市场的风险，捕捉投资机会非常关键，正因如此如何准确地解读曲线背后的语言，是市场各方参与者所关心的

我们正是通过不断创新，努力捕捉到曲线背后的任何信息，力求发现市场波动的脉络

**SECF诠释完美的创造力与投资，  
从容驾驭当今复杂的投资世界，  
博闻强识敦行致远。**

---

SECF是一家为全球投资者提供关键决策支持的数据分析服务商。凭借超过20年的研究、数据分析和交易追踪的经验，帮助客户正确了解市场交易的风险和机会，客观识别关键驱动因子，协助客户并支持客户做出更明智的投资决策。

我们创造了业内独有的风险研究模式、研究并创建风险管理监测系统，协助客户在整个投资流程中深入洞察市场波动的风险和机会，并提高透明度。

如需了解更多信息，请联系我们，或访问我们的网站[secfortune.com](http://secfortune.com)

E-mail: [info@secfortune.com](mailto:info@secfortune.com)

欧洲地区 +45 7188 7808

北美地区 +1 778 806 6399

©2022 Secfortune.com. 保留所有权利。