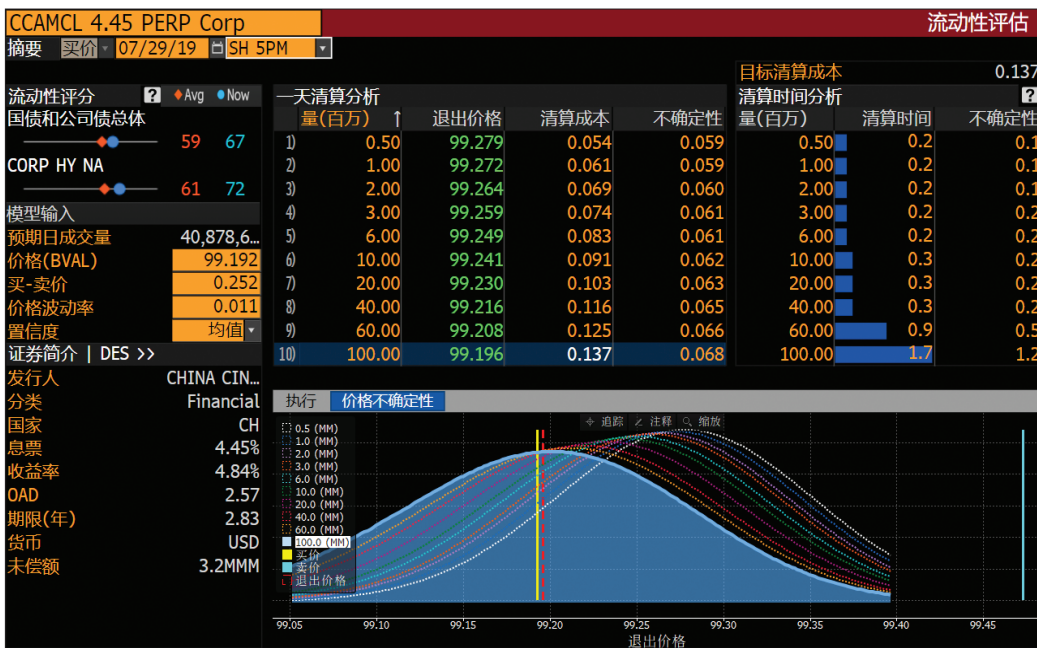


彭博流动性评估(LQA)

彭博屡获殊荣的流动性评估(LQA)解决方案能让您定量评估多个资产类别的市场流动性。LQA符合全球监管要求,为风险管理和投资过程增添价值:

- 在头寸层面估算清算成本和期限
- 在全球覆盖面下跨资产类别对标准一致的流动性分析进行比较
- 自设输入参数并分析市场情景



覆盖全球

- 政府和机构债务
- 公司债券
- 地方债券
- 全球股票和ETF

LQA分析

- 清算成本
- 清算时间期限
- 预计日成交量
- 各项输出的置信度
- 相对与绝对流动性评分

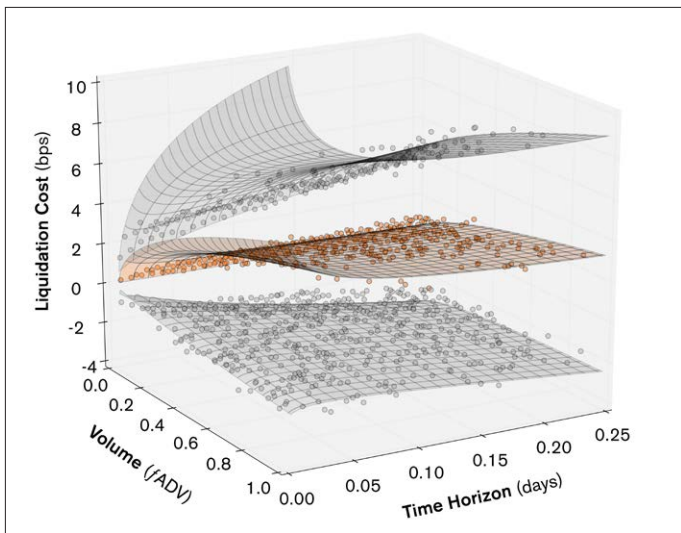
LQA <GO>

全面评估您业务的流动性

清楚了解流动性风险敞口是构建强大的企业风险管理框架所必不可少的一环。借助LQA,您可以深入了解并分析所持资产的流动性,明智把握市场流动性风险。

彭博采用数据为先的方法来衡量流动性,在整个企业范围内提供可靠一致的分析,方便您完成:

- 监管报告
- 赎回和申购分析
- 压力测试和情景分析
- 监控流动性风险限额
- 跨投资组合的相对流动性比较
- 预警指标
- 投资组合构建和优化
- 交易成本分析
- 独立的公司治理
- 面向投资者关系的流动性披露

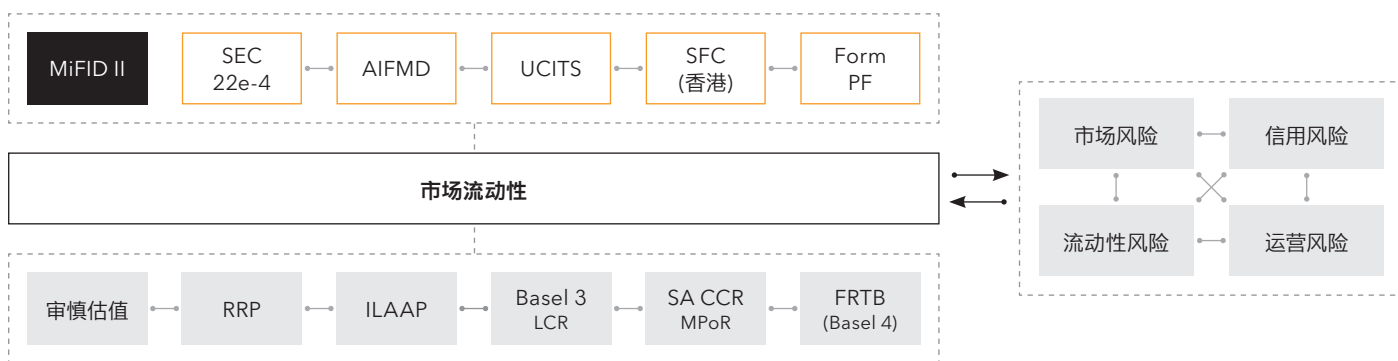


数据为先的方法

LQA采用强大的金融数据集和大数据框架，确保妥善考虑影响流动性的各项相关因素。这一独特方法甚至可用于交易活动有限的金融工具，对其进行流动性估算。自设输入参数能够实现用户指定情景的计算。

北美股票的清算层面显示了与清算成本、时间和成交量相关的LQA模型，并按照平均值 \pm 标准差元拟合委托单交易数据。

超越监管要求 — 整合式企业风险管理



流动性成为一个可衡量的风险因素

在新常态下，除了MiFID II等市场监管规定外，公司还需遵守众多流动性相关的全球监管规定，其中包括买方需遵守的美国证券交易委员会(SEC)第22e-4条、可转让证券集合投资计划(UCITS)、《另类投资基金经理指令》(AIFMD)和香港证监会规定，以及卖方需遵守的《巴塞尔协议III》流动性覆盖率(LCR)、《交易账户全面审议》(FRTB)、审慎估值和个别流动性适足性标准(ILAAP)。这些规定，以及市场流动性的明显降低，增加了开展业务的复杂性。彭博提供最佳实践方法对此加以评估，并使行业能够持续评估、管理和报告跨资产类别投资组合的流动性风险。

彭博LQA解决方案

- 成本、时间和成交量相关的清算层面
- 跨资产类别的一致分析
- 能够自定义输入参数并进行情景分析
- 符合监管规定的数据集
- 您可以在彭博终端®上的LQA <GO>获取分析、透明度和各类文档
- 定量产品支持和疑难解答服务台
- 整合于彭博专业®服务
- 可通过彭博企业数据传输获取

彭博企业服务

为在市场上立于不败之地，如今金融机构必须应对传统方法无法解决的挑战。这些机构需要世界级解决方案，针对前台、中台和运营方面整合人员、流程、信息及技术。彭博与这些机构共同合作，帮助他们保护和利用数据、管理风险、提供良好的透明度并控制成本。依托丰富的企业级专业知识和三十年资深行业经验，彭博利用创新性技术将数据转化为战略性资产，为客户创造真正价值。

了解该解决方案

如需详细了解我们如何帮您的公司自动处理数据需求，请发送电子邮件至eprise@bloomberg.net联系我们。

迈出下一步。

如需了解更多信息，请在彭博终端上按<HELP>键两次。

北京
+86 10 6649 7500
上海
+86 21 6104 3000
香港
+852 2977 6000

伦敦
+44 20 7330 7500
迪拜
+91 22 6120 3600
纽约
+1 212 318 2000

旧金山
+1 415 912 2960
圣保罗
+55 11 2395 9000
法兰克福
+49 69 9204 1210

新加坡
+65 6212 1000
悉尼
+61 2 9777 8600
东京
+81 3 3201 8900