

案例研究

洛克菲勒资产管理公司
美国
资产管理

为资产管理公司开发新的环境、 社会和治理 (ESG) 因子优化 和指数构建

挑战

洛克菲勒资产管理公司 (RAM) 希望开发一种新颖的定量 ESG 解决方案，以补充其现有的强大基础研究方法。该方案涉及大量的 ESG 数据专业知识和创建定制的方法。

解决方案

数字化进口供应链平台 KKS 建立了一个阿尔法 (alpha) 生成的 ESG 改善因子，可用于公司的量化、基本面、只做多和做空策略，涉及开发和回溯测试企业 ESG 评分方法 (指数纳入方法的基础)，以及评估来自 ESG 数据提供商的大量数据集。改善评分和相关的量化分析也构成了最近 Bloomberg Rockefeller 美国资本多因素 ESG 改善指数的基础。

奖项

dss+ 与 Rockefeller 的合作被提名为 2021 年负责任投资原则 (PRI) 年度 ESG 整合计划奖



目标

开发定制的定量解决方案，在整个公司的投资战略中执行 Rockefeller 的 ESG 改进理念



咨询

ESG 整合战略支持，重要性评估，ESG 数据评估



结果

dss+ 帮助建立了企业 ESG 评分方法，并因此产生了洛克菲勒相关性排序™ (Rockefeller's Relevance Ranking™) (现已获得专利) 和 ESG 改善评分™ (Improvers Score™)。改善评分和相关的量化分析也构成了最近 Bloomberg Rockefeller 美国资本多因素 ESG 改善指数的基础

dss+

Protect. Transform. Sustain.



更多关于 dss+ 解决方案, 欢迎联系我们

021 5068 2805
info.cn@consultdss.com
www.consultdss.com



dss+