

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+