

(MUFG)、FINCAD F3の採用で複雑なバーゼルIIIレポートを簡略化

要点

お客様

MUFG Bank (Europe) N.V.

業務目標

- ・ バーゼルIII レポート要件を満たす
- ・ カウンターパーティー向けCVA計測に正確で効率的なソリューションを導入する

要件

- ・ 信頼性の高い正確なCVALレポート
- ・ 信頼できる外部委託プロバイダ

FINCADソリューション

- ・ F3 CVA サービス

FINCADの特徴

- ・ CAVはほとんどリアルタイムで計測され規制要件に適合される
- ・ CAVを社内で処理、もしくはFINCADへ委託することが選択可能

成功の要因

- ・ 専門家へ業務委託することによるBasel III向けCVALレポートの簡素化
- ・ CVAの手計算または表計算の必要性を排除して時間を節約
- ・ 戦略的業務ヘリソースをフォーカスさせるためにFINCADプロフェッショナルサービスチームを利用

背景

MUFG Bank (Europe) N.V. (以下、MBE) はヨーロッパ大陸におけるMUFGの商業銀行部門です。

バーゼルIIIの要件を準拠するためにMBEはCVA (信用評価調整) レポート用のソリューションを探する必要がありました。MBEは、取引のある様々なカウンターパーティ向けにCVAを計算する必要があったのです。

当初、MBEは自社でレポート業務を行う予定でしたが、社内に自社で行うだけのリソースと時間が不足していました。MBEには最適な技術に加えて、レポート業務に初めから終わりまで対応可能な完全なサービスを提供するCVAプロバイダを必要としていました。

FINCADソリューション

MBEは、業界内で信頼のあるパートナーとの協業を希望していました。すでにFINCADのInsightソリューションを評価していたため、FINCADのCVAサービスを検討するのが自然な選択でした。MBEはソリューションが自社の要件を満たしており、CVALレポート業務をFINCADプロフェッショナルサービスチームへ進んで委託契約しました。

FINCADは、F3による評価・リスクソリューションを用いて正確なCVALレポートを提供します。F3を用いることで、CVAはほぼリアルタイムで計算され、バーゼルIIIの規制基準に適した運用が可能です。また、クライアントはCVAを自社で管理するか、あるいはFINCADに委託するか選択することも可能です。

「FINCADのソリューションは使いやすく、とても信頼できます。ほかにも、サポートチームによる見識ある回答や迅速なサービスの提供は、我々にとって大きな意味を持っています。これらがFINCADのCVAサービスを採用する際、大きな決め手となりました。」

MUFG Bank (Europe) N.V. 国債部アソシエイト・ディレクター ロナルド・ハート氏

About FINCAD

An established leader with more than 20 years of experience, FINCAD provides innovative and trusted financial analytics software to organizations worldwide. With deep market understanding, a client-centered business approach, and unmatched quantitative and software engineering expertise, FINCAD is uniquely positioned to lead the market in enterprise valuation and risk technology. FINCAD serves more than 1,000

Global Support

Vancouver
New York
London
Dublin

FinancialCAD
Corporation

FINCAD[®]

成果

MBEからFINCADへ、約2,200件の外為先物契約に加え、金利スワップ、ベースス・スワップ、およびクロス・カレンシー・スワップの帳簿に対して正確で効率的なCVA計測と報告業務を委託しています。

四半期ごとにMBEは対象となるマーケットデータをFINCADに提供し、FINCADはそれをCVAモデルに組み込みます。その後、FINCADのスタッフはモデルに従って作業し、適切な規制報告書を作成します。このレポートはMBEが自社のカウンターパーティごとに抱えている信用リスクを示しており、MBEがバーゼルの要件を準拠するための価格及び資本決定の助けとなっています。

「FINCADからCVAレポートに関するサポートを得たことは、我々にとって戦略的かつ有益な決断でした。我々のデータを提出し、バーゼルⅢの規制要件を満たすためのレポートを返信してもらう過程はシームレスに運用されています。」と、ハート氏はコメントしています。「代替案であった手作業でのCVA計測やエクセルの使用は、我々にとって現実的ではありませんでした。FINCADを利用することによって、ビジネスを前進させるための作業に使える時間が飛躍的に増えています。」