



平成 23 年 11 月 18 日

各 位

会 社 名 テクマトリックス株式会社  
代表者名 代表取締役社長 由利 孝  
(コード：3762、東証第二部)  
問合せ先 企 画 部 長 森脇 喜生  
(TEL. 03-5792-8601)

## ハイブリッド金融商品分析ソフトウェア「F3」の

### 販売開始のお知らせ

記

当社は、カナダの FinancialCAD 社が新たに開発した、ハイブリッド金融商品分析ソフトウェア「F3」の販売を開始いたしますので、添付の通り、お知らせいたします。

当社は世界 80 カ国、45,000 ユーザ以上の導入実績を誇る金融商品評価とリスクマネジメントをサポートするソフトウェアベンダー FinancialCAD 社の国内総販売代理店です。F3 は従来の製品で対応していたスワップやオプション等の伝統的な金融商品から、これら金融商品を組み合わせた仕組み債等の複雑な金融商品の両方（ハイブリッド）の評価・分析に対応できる革新的なソフトウェアです。予め製品に搭載された小さなソフトウェアを組み合わせることにより、様々な金融商品が組み合わせられ複雑化した金融商品の時価評価やリスク計測、シミュレーションにも柔軟、迅速に対応できます。

以上

平成23年11月18日

報道関係者各位

テクマトリックス株式会社

## テクマトリックス、ハイブリッド金融商品分析フレームワーク「F3」の販売開始

～ 広範囲な金融商品の組成シミュレート、公正価値算出、リスク分析業務の効率化をサポート ～

テクマトリックス株式会社(本社:東京都港区、代表取締役社長:由利孝、以下テクマトリックス)は、FinancialCAD社(本社:カナダ ブリティッシュコロンビア州、CEO:Robert Park 以下FINCAD社)が新たに開発したハイブリッド金融商品分析フレームワーク「F3」の販売を2011年11月14日より開始いたします。

FINCAD社は1990年の創業以来、デリバティブ商品の分析ツール「FINCAD Analytics Suite」の開発、販売を手掛けており、世界80か国、45,000ユーザー以上の導入実績を誇るリーディングカンパニーですが、2010年より新たな主力ソリューションとして「F3」の提供を開始しており、既に欧米地域を中心に非常に高い評価を得ております。これに伴い、国内においてもFINCAD社の国内総販売代理店であるテクマトリックスがF3製品の国内販売、サポート、導入支援のご提供を開始することとなりました。

「F3」は同ソフトウェアが提供している多数のオブジェクト群を、ユーザーが自由に組み合わせる事により、あらゆる金融商品の時価評価やリスク計測、組成シミュレーションに柔軟、迅速に対応できる革新的なプライシングフレームワークです。加えて、商品別に個別性が強いクーポンスケジュールや権利行使判定等の条件も、F3が提供するスクリプト言語を利用する事により容易に対応する事が出来ます。

### 1. 製品ラインナップ

- F3 SDK  
F3の機能を、C,C++,C#,Java等の開発環境からご利用いただけるソフトウェア開発キットです。更に後述のF3 ExcelやF3 Toolbox for MATLABと合わせてご利用頂く事により、開発負荷の軽減に大きく寄与します。
- F3 Excel  
Microsoft Excelの環境上にF3の機能をアドインする事が可能な製品です。主にプロトタイピングや組成シミュレーション、他製品やスクラッチ開発によるプログラムとのベンチマーキングにご利用いただけます。
- F3 MATLAB  
Mathworks社が提供する「MATLAB」の環境上に、F3の機能をアドインする事が可能な製品です。

### 2. F3ソリューションの概要

前述のとおり、F3 (FINCAD Financial Framework) は、FINCAD社が新たに開発した金融商品分析フレームワークであり、FINCAD Analytics Suite に代表される従来のプライシングツールと比べ、より専門的かつ柔軟性に富んだ製品設計となっております。具体的にはF3に対して以下の4点の情報(オブジェクト)を定義いただく事により様々な商品分析、評価に対応する事ができます。

No	情報名	区分
1	Model	マーケットデータ定義とカーブ構築手法
2	Product	金融商品個別の契約属性
3	Method	金融商品に対する評価手法
4	Requests	結果として得たい指標

表 1 F3 における金融商品評価に必要な情報

F3とは、これらの情報の組み合わせによって金融商品の評価を表現するための枠組み（＝フレームワーク）であり、定義された各オブジェクトを「ValueProduct」と呼ばれる、F3の共通インタフェースに受け渡すことで、金融商品の評価を汎用的に行う枠組みをご提供しております。

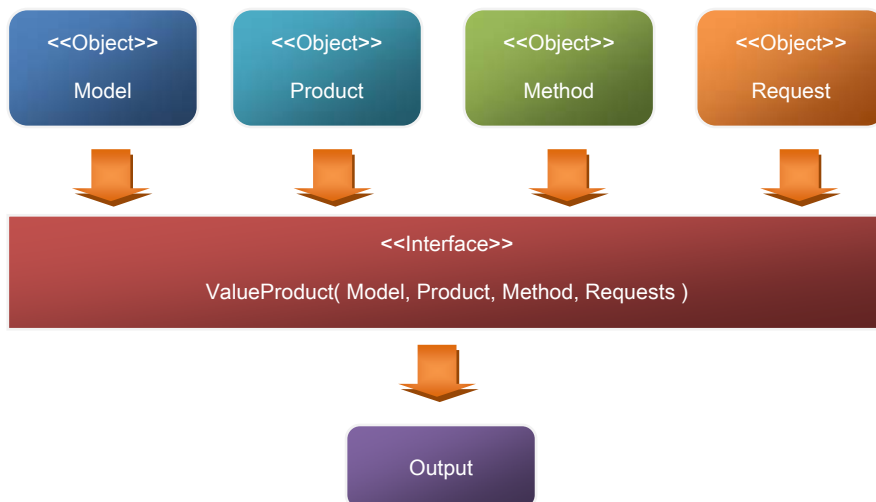


図1 F3における金融商品の評価

### 3. F3ソリューションの特長

- 広範なカバレッジ
  - F3が提供するオブジェクトを自由に組み合わせる事により、ヴァニラからエキゾチックまで広範な金融商品への対応が可能
  - F3スクリプトを利用する事により、商品の個別性にも柔軟に対応
- ロジックの透明性
  - 搭載ロジックすべてに詳細な解説ドキュメントを装備。第三者へのロジック説明やベンチマーキング業務をサポート
- クォンツ業務とプログラム開発業務の分離
  - F3 Excel / F3 MATLABで構築したモデルを、F3 SDKが読み込めるフォーマットでXML形式ファイルを自動生成
  - Excel/MATLAB上でのプロトタイピング結果を、即座にアプリケーションに実装可能に

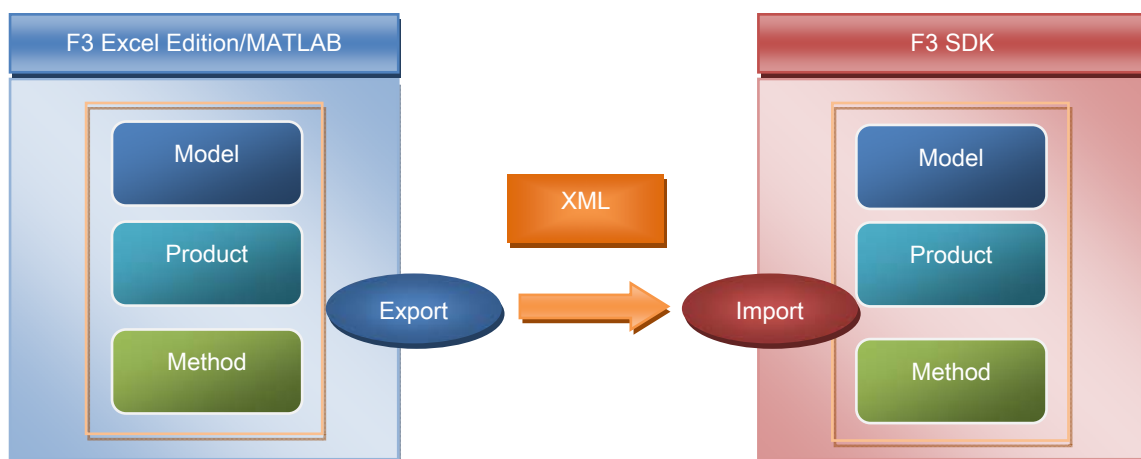


図2 F3における商品追加の概念図

- グローバルでの評価と実績
  - FOW Award 2010においてBest Innovation賞を受賞
  - 欧米地域を中心に飛躍的に導入が加速
- 国内ソリューションプロバイダーによる充実したサポート体制
  - サポート、コンサルティングをテクマトリックスによる専門チームが対応
  - F3を用いたシステム開発も含めてトータルに支援

#### ■ テクマトリックス株式会社(東証二部：3762)について

テクマトリックス株式会社は、IT 分野において、最先端の製品とソリューションを提供する総合的なソリューションプロバイダーです。金融商品時価・リスク分析、ソフトウェア品質管理、ネットワーク、インターネット、セキュリティ、データベースといった分野の製品を海外より輸入し、日本国内に提供するためのローカライゼーション、コンサルティング、技術サポート、教育などさまざまな付加価値を付けてご提供します。この中で、金融商品時価・リスク分析サービス提供には 15 年の実績を持っています。また、通信分野、エレクトロニクス・コマース分野において、お客様のニーズに適合したソリューションの提供、インテグレーション、システム受託開発などのサービス提供、さらには、コールセンターシステム、医用画像システムなどの自社製品の開発も行っております。

テクマトリックス株式会社(本社)

東京都港区高輪4-10-8 京急第7 ビル

TEL 03-5792-8600 FAX 03-5792-8700

URL <http://www.techmatrix.co.jp>

#### ■ FINCAD社について

FINCAD社は、金融商品評価とリスクマネジメントをサポートするためのソフトウェアとサービスをワールドワイドで提供する独立系ソフトウェアベンダーです。FINCAD社は透明性の高い金融商品評価ロジックを社会に提供することにより、IFRS等の新しい法規制に対して確実で的確なアプローチ方法をご提供します。

FINCAD 社

E-MAIL [sales@fincad.com](mailto:sales@fincad.com)

URL [www.fincad.com](http://www.fincad.com)

#### 【この発表に関するお問合せ先】

テクマトリックス株式会社

カスタムメイドソリューション事業部 カスタマーソリューション営業部 金融システム営業課

TEL 03-5792-8607 FAX 03-5792-8707

E-MAIL: [fincad-f3@techmatrix.co.jp](mailto:fincad-f3@techmatrix.co.jp)

URL: <http://www.techmatrix.co.jp/financial/fincad-f3>