

2020年5月25日

報道関係者各位

テクマトリックス株式会社  
(東証一部 / 証券コード: 3762)

## LIBOR 廃止を見据えた金融商品評価・分析ツール「F3」 最新版の国内販売を開始

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、カナダ FinancialCAD 社（本社：カナダ ブリティッシュコロンビア州、最高経営責任者：Mark D'Arcy、以下 FINCAD 社）が開発した金融商品評価・分析フレームワークの最新バージョンである「F3 9.1」の国内販売を2020年5月25日より開始します。

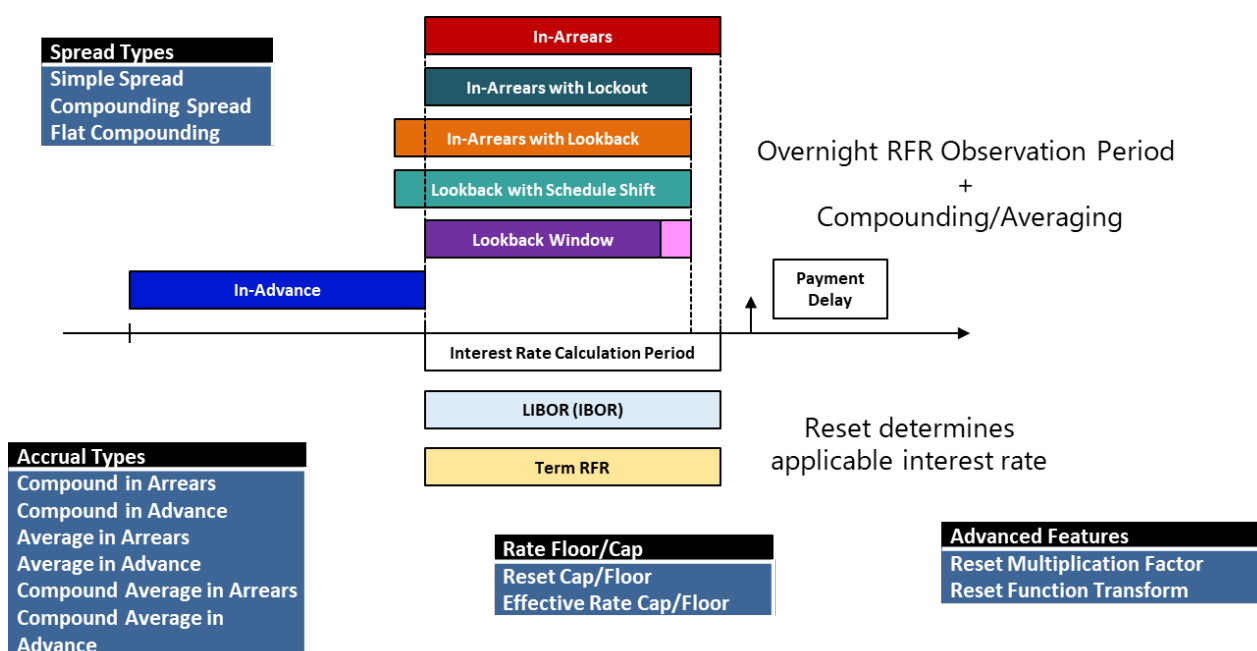
FINCAD 社が開発している「F3」は、複雑な金融商品や大量のポートフォリオ等の評価・分析業務に、高い柔軟性と高速演算処理機能を有したシステムフレームワークをご提供する金融商品評価・分析ツールです。金融商品や市況情報等の「オブジェクト」を組み合わせることで多彩な評価・分析が可能です。

F3 では、以前より LIBOR 廃止に向けて SOFR や SONIA を始めとした各種リスクフリーレートへの対応を進めておりましたが、F3 9.1 ではより LIBOR 代替を意識したアップデートが行われました。

### 【F3 9.1 の新機能について】

#### ◇ 代替レートの計算方法

- ・F3 9.1では、金利の決定タイミングが後決めの場合における計算方法として、以下の図に記載の通り、金利の観測期間を数営業日短縮するIn-Arrears with LockoutやLookback Window、金利の観測期間と金利の計算期間の日数を一致させ、金利の観測期間を数営業日前にスライドするIn-Arrears with LookbackとLookback with Schedule Shiftなどの計算方法に対応可能となりました。



# Press Release

## ◇ 代替レートへの自動切替

- 以下の図のようにxIBORとそれに代替する各種リスクフリーレートのインデックスを定義することで、カットオフ日以降自動で適用する、という設定が可能となりました。これにより、代替レートに移行した後を考慮した上で、時価評価や各種リスク分析を行うことが可能です。

CreateSpreadToAlternativeIndexValuationSpecification																																																		
ValuationMethodName	LiborReplacementValSpec																																																	
UnderlyingValuationMethod	DefaultClosedForm																																																	
CutoffDate	1/3/2022																																																	
IndexMap	<table border="1"> <tbody> <tr><td>LiborJPY1m</td><td>TONARCompounded</td></tr> <tr><td>LiborUSD1m</td><td>SOFRCompounded</td></tr> <tr><td>LiborGBP1m</td><td>SONIACompounded</td></tr> <tr><td>Euribor1m</td><td>ESTRCompounded</td></tr> <tr><td>LiborJPY3m</td><td>TONARCompounded</td></tr> <tr><td>LiborUSD3m</td><td>SOFRCompounded</td></tr> <tr><td>LiborGBP3m</td><td>SONIACompounded</td></tr> <tr><td>Euribor3m</td><td>ESTRCompounded</td></tr> <tr><td>LiborJPY6m</td><td>TONARCompounded</td></tr> <tr><td>LiborUSD6m</td><td>SOFRCompounded</td></tr> <tr><td>LiborGBP6m</td><td>SONIACompounded</td></tr> <tr><td>Euribor6m</td><td>ESTRCompounded</td></tr> <tr><td>LiborUSD12m</td><td>SOFRCompounded</td></tr> <tr><td>LiborGBP12m</td><td>SONIACompounded</td></tr> <tr><td>Euribor12m</td><td>ESTRCompounded</td></tr> </tbody> </table>	LiborJPY1m	TONARCompounded	LiborUSD1m	SOFRCompounded	LiborGBP1m	SONIACompounded	Euribor1m	ESTRCompounded	LiborJPY3m	TONARCompounded	LiborUSD3m	SOFRCompounded	LiborGBP3m	SONIACompounded	Euribor3m	ESTRCompounded	LiborJPY6m	TONARCompounded	LiborUSD6m	SOFRCompounded	LiborGBP6m	SONIACompounded	Euribor6m	ESTRCompounded	LiborUSD12m	SOFRCompounded	LiborGBP12m	SONIACompounded	Euribor12m	ESTRCompounded	<table border="1"> <tbody> <tr><td>TONARCompounded</td></tr> <tr><td>SOFRCompounded</td></tr> <tr><td>SONIACompounded</td></tr> <tr><td>ESTRCompounded</td></tr> <tr><td>TONARCompounded</td></tr> <tr><td>SOFRCompounded</td></tr> <tr><td>SONIACompounded</td></tr> <tr><td>ESTRCompounded</td></tr> <tr><td>TONARCompounded</td></tr> <tr><td>SOFRCompounded</td></tr> <tr><td>SONIACompounded</td></tr> <tr><td>ESTRCompounded</td></tr> <tr><td>SOFRCompounded</td></tr> <tr><td>SONIACompounded</td></tr> <tr><td>ESTRCompounded</td></tr> <tr><td>SOFRCompounded</td></tr> <tr><td>SONIACompounded</td></tr> <tr><td>ESTRCompounded</td></tr> </tbody> </table>	TONARCompounded	SOFRCompounded	SONIACompounded	ESTRCompounded	TONARCompounded	SOFRCompounded	SONIACompounded	ESTRCompounded	TONARCompounded	SOFRCompounded	SONIACompounded	ESTRCompounded	SOFRCompounded	SONIACompounded	ESTRCompounded	SOFRCompounded	SONIACompounded	ESTRCompounded
LiborJPY1m	TONARCompounded																																																	
LiborUSD1m	SOFRCompounded																																																	
LiborGBP1m	SONIACompounded																																																	
Euribor1m	ESTRCompounded																																																	
LiborJPY3m	TONARCompounded																																																	
LiborUSD3m	SOFRCompounded																																																	
LiborGBP3m	SONIACompounded																																																	
Euribor3m	ESTRCompounded																																																	
LiborJPY6m	TONARCompounded																																																	
LiborUSD6m	SOFRCompounded																																																	
LiborGBP6m	SONIACompounded																																																	
Euribor6m	ESTRCompounded																																																	
LiborUSD12m	SOFRCompounded																																																	
LiborGBP12m	SONIACompounded																																																	
Euribor12m	ESTRCompounded																																																	
TONARCompounded																																																		
SOFRCompounded																																																		
SONIACompounded																																																		
ESTRCompounded																																																		
TONARCompounded																																																		
SOFRCompounded																																																		
SONIACompounded																																																		
ESTRCompounded																																																		
TONARCompounded																																																		
SOFRCompounded																																																		
SONIACompounded																																																		
ESTRCompounded																																																		
SOFRCompounded																																																		
SONIACompounded																																																		
ESTRCompounded																																																		
SOFRCompounded																																																		
SONIACompounded																																																		
ESTRCompounded																																																		
	LiborReplacementValSpec																																																	

カutoff日 → (CutoffDate)
 xIBOR → (IndexMap)
 各種リスクフリーレート → (IndexMap)

## ◇ 各種リスクフリーレートへの広範な対応

- 現時点で以下のリスクフリーレートに対応しております。
  1. SOFR
  2. SONIA
  3. ESTER (EONIA)
  4. SARON
  5. TONAR
  6. RBA Cash

## 【F3 ソリューションラインナップ】

F3 は下記のソリューションラインナップをご用意しております。お客様のご利用形態に応じて、最適なソリューションをご提案します。

### F3 CVA 試算/計測サービス

- F3 CVA 試算/計測サービスは、お客様よりご提供いただいた取引データ及びマーケットデータ等を利用して当社にて CVA を算出して、結果レポートをご提供するサービスです。
- CVA の算出は、当社が AWS 上に構築した環境にて行います。
- お客様は新たにシステムやツールを導入することなく、容易に CVA を試算することが可能です。また、試算サービスをご利用後、CVA 試算サービスで設定した取引やマーケットデータ等は、基本的に再利用できます。そのため、容易且つコストを抑えた形で CVA 計測サービス(定期利用)をご利用いただけます。

### F3 Excel Edition

- F3 Excel Edition は、あらゆる金融商品の組成業務や分析業務などに対応するために、ユーザーに柔軟なプラットフォームを提供する Excel アドインソリューションです。

# Press Release

- 金融商品の取引前の価格検証、分析や他プライサとのベンチマーキング、または組成業務におけるプロトタイピングなどのシーンで絶大なパフォーマンスを発揮します。

## F3 SDK Edition

- F3 SDK は、C++、C#、Java 等のプログラム言語上から、F3 のアーキテクチャをご利用可能となる開発用ツールキットです。
- F3 Excel Edition と併せてご利用いただく事により、アプリケーション開発において Excel 上でのプロトタイピング結果を開発中のアプリケーションに反映させることが容易になります。

## F3 WorkStation/F3 Platform

- F3 WorkStation は、オブジェクト指向型プライシングソリューションである「F3」の強力な分析機能をベースにした、金融商品評価、各種リスク分析のための WEB アプリケーションです。
- フロント部門のポートフォリオ管理やクオンツ運用、ミドル部門の損益、収益管理等のリスク分析業務にてお使いいただけます。
- F3 Platform は、計算やデータ管理の基盤となるシステムであり、F3 WorkStation とは API により連携されています。

## 【F3 の特長】

F3 は、お客様に柔軟なシステムアーキテクチャと圧倒的なコストパフォーマンスをご提供することで市場に流通するあらゆるデリバティブ商品の評価・分析を支援します。

### オブジェクト指向型プライシングソリューション

F3 ソリューションは商品評価・分析において、商品の構造（クーポンスケジュール、早期償還条件等）やそれに付随する評価モデルを、搭載されたオブジェクトの組み合わせにより構築することが可能です。アプリケーション開発現場においては、オブジェクト指向を意識した再利用性、柔軟性および市場整合性を持った開発が可能です。

### 搭載モデルの透明性確保

FINCAD 製品は全ての搭載ロジック、モデルをドキュメントに明示しており、内外を問わず第三者への説明責任を果たすシーンにおいても絶大なパフォーマンスを発揮します。

### 包括的なポートフォリオリスク分析機能

トレード別/ポートフォリオ全体での VaR や CVA（担保考慮/非考慮）等に代表されるリスク指標を算出可能です。また、使用する評価モデルや計算手法に関わらず、各マーケットグリッドポイントのファーストオーダーリスクを算出する事も可能です。

## ■テクマトリックス株式会社 について

テクマトリックス（東証一部：3762）は、クラウドコンピューティング時代に技術革新をもたらす情報基盤技術のインテグレーションを提供する「情報基盤事業」と、ソフトウェア技術を駆使し顧客の抱える問題領域におけるベストプラクティスを実装したアプリケーションの提供を行う「アプリケーション・サービス事業」を提供しております。金融分野では、金融商品時価・リスク分析サービス提供には 20 年以上の実績を持っています。

## ■FinancialCAD 社について

FinancialCAD 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。1990年に設立されて以来、FINCAD社は各種金融機関に透明性の高い金融商品評価ロジックを提供しております。

FinancialCAD Corporation

<http://www.fincad.com/>

<本件に関するお問い合わせ先>

テクマトリックス株式会社 ビジネスソリューション営業部 金融システム営業課

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

TEL/FAX : 03-4405-7846 / 03-6436-3546

\*本原稿に記載されている社名及び製品名等は、各社の商標または登録商標です。