

2021 年 2 月 9 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)

金融商品評価・分析ツール「FINCAD Analytics Suite 2021」 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・分析ツールの最新バージョンである「FINCAD Analytics Suite 2021」の国内販売を 2021 年 2 月 10 日より開始いたします。テクマトリックスは国内総販売代理店としてディーリング業務やリスク管理業務に携わる国内のお客様を対象に、FINCAD 製品の日本国内での販売、マーケティング、ユーザーサポート、コンサルティング、導入支援などの活動を展開してまいります。

FINCAD 社が開発している「FINCAD Analytics Suite」は、債券、金利、為替取引等の伝統的な金融商品から、各種デリバティブ商品、仕組債などの複雑な金融商品に至るまで、広範な金融商品の公正価値評価、リスク計測、将来キャッシュフローの予測等を可能とする金融商品評価・分析ツールです。ユーザーは、「FINCAD Analytics Suite」が提供する 1,900 を超える評価関数を使用することにより、高度な金融工学を個別に学習、実装する必要無く、金融商品の公正価値評価やリスク計測が可能です。

新バージョンの主要なアップデート内容について以下の通りご紹介いたします。

【FINCAD Analytics Suite 2021 の新機能について】

LIBOR からの移行の流れは継続しており、新指標を参照する商品も現出し始めています。「FINCAD Analytics Suite 2021」は、新指標を参照するカーブや商品を構築するためのアップデートが加えられています。また、COVID-19 の影響によるボラティリティの大幅な変動に対して、正確なプライシングと適切なリスク管理を可能とするべくカバレッジを拡大しております。

◇ LIBOR 廃止への対応準備

- ・三次スプライン補間機能を向上しました。
- ・FRN の評価機能を向上しました。
- ・スワップ並びにスワップションの評価において Payment delay、Lookback、Schedule shift に対応しました。

◇ スワップション・ボラティリティキューブ処理の機能強化

- ・マトリックス若しくはテーブルリスト形式で表されるスワップション・インプライド・ボラティリティキューブでの補間機能とユーティリティを向上しました。

Press Release

◇ ボラティリティ・デリバティブのカバレッジ拡大

- ・ Hestonモデルを使用したコリドー・バリエーションスワップに対応しました。
- ・ モンテカルロ・シミュレーションを用いたバリエーションスワップや相関スワップの評価関数を追加しました。
- ・ 前方ボラティリティ契約のプライシング並びにリスク計測が可能な関数を追加しました。

◇ その他

- ・ 新規関数を大幅追加
- ・ サンプルワークブックの充実化
- ・ Pythonサポートの強化

【製品ラインナップ】

FINCAD Analytics Suite は下記 3 種類の製品ラインナップをご用意しており、お客様のご利用形態に応じて、最適な製品をご提案させていただきます。

FINCAD Analytics Suite for Excel

- FINCAD ライブラリを Microsoft Excel 上にてご利用可能な Excel アドイン・アプリケーションです。
- ユーザーは当製品をご利用する事により、Microsoft Excel 上で様々な金融商品の評価・リスク分析を実現する事が可能です。
- 当製品内には導入後すぐにご利用可能なテンプレート・ワークブックが 200 枚以上同梱されております。

FINCAD Analytics Suite for Developers

- FINCAD ライブラリを各種アプリケーション上に実装可能なソフトウェア開発用ツールキット (SDK) です。
- ユーザー (=ソフトウェア開発者) は当製品を活用いただく事により、金融工学を個別で学習する必要無く、効率的、かつ迅速に金融工学関連のアプリケーションを構築することが可能になります。

FINCAD Analytics Suite for End User

- FINCAD Analytics Suite for End User は FINCAD Analytics Suite for Developers で開発されたアプリケーションを利用するために必要なクライアント・アクセス・ライセンス (CAL) です。

【FINCAD Analytics Suite の特長】

FINCAD Analytics Suite は主に下記 3 点の特長を有しております。

広範な金融商品カバレッジ

金利、外国為替、債券、エクイティ、コモディティ、クレジット等の様々な種類の金融商品に対応するため、FINCAD Analytics Suite には 1,800 を超えるライブラリが内蔵されており、ユーザーにて自由に選択、利用が可能な製品設計となっております。確かな金融工学理論に裏付けされた FINCAD Analytics Suite の評価・分析ロジックを用いる事により、的確に保有資産の公正価値、リスクを把握する事が可能となります。

透明性の高い評価ロジック

対外的な説明責任を担保するため、FINCAD Analytics Suite では透明性の高い評価ロジックを実装しており、ユーザーから第三者への説明を容易にいたします。

Press Release

ワールドワイドな導入実績

FINCAD は現在世界 80 カ国、35,000 以上のお客様にご愛用いただいております。金融商品の評価・分析ツールのデファクト・スタンダードとして高い評価をいただいております。また国内においても 2,000 ユーザーを超えるお客様にご利用いただいております。

■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

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。