

2019 年 3 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)

金融商品評価・分析ツール「F3」「FINCAD Analytics Suite」 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: Robert Park、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「F3 8.0」および「FINCAD Analytics Suite ver.2019」の国内販売を本日(2019 年 3 月 25 日)より開始致します。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「F3」および、「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。オブジェクト指向による柔軟な計測機構の構築や、金融商品の種別、用途毎に用意された 1,800 を超えるライブラリにより、ユーザーは当製品を活用する事により高度な金融工学を個別に学習、実装する事無く、容易に金融商品の公正価値評価やリスク分析が可能となります。

新バージョンの主な特長を以下に記載致します。

【F3 8.0 の主な特長】

オプションポジション評価の強化

現物決済 (Physically-settled) のエクイティオプションおよびコモディティオプションに対応しました。エクイティ、コモディティの属性やオプションの属性等を詳細に選択可能です。

将来時点の評価

将来時点の評価日とした計算に対応しました。将来時点でのマーケットデータの推定方法や、現時点～将来時点までのキャッシュフローの取り扱い等の設定が可能です。

通貨オプションのプレミアム調整デルタ (Premium Adjusted Delta)

通貨オプションのプレミアム調整デルタの計算に対応しました。
これにより通貨ペアのいずれの通貨建てでもヘッジ額を決定することが可能となります。

LIBOR 代替指標 SOFR 先物への対応

3 ヶ月 SOFR 先物の商品タイプが追加されました。これは新しい関数「CreateQuarterlyCompoundedFuturesContractType」を使用して構築される新たな先物取引タイプをベースと

しております。この機能により、取引開始月から始まる3ヶ月複利のSOFRレートを参照する取引の定義と評価が可能となります。

スワップが内包するバリアオプションの解析解対応

スワップが内包するバリアオプションについて、解析解による計算に対応しました（(Shifted) Blackモデル、Vanna-Volga、およびBackward evolutionによる評価の場合）。この対応により、バリアオプションを内包するスワップについて、処理速度が大幅に改善しました。

F3 Platform との連携強化について

F3 Excel Edition は、F3 Platform 上のオプションおよび先物取引の管理に利用することが可能となりました。

【製品ラインナップ】

F3 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。

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。
- 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致します。

F3 SDK Edition

- F3 SDK は C、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、F3 Toolbox use for MATLAB と併せてご利用いただく事により、Excel や MATLAB 上でのプロトタイプからシームレスに SDK と連携する事も可能です。

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・分析を強力に支援致し、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致します。

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全て独立したオブジェクトとして定義できるオブジェクトアーキテクチャによって構成されており、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。

Press Release

搭載モデルの透明性確保

F3 SDK では全てのファンクションコールをロギングしており、開発後のデバッグの効率化や監査証跡保存の観点からも貢献致します。また、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致します。

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。

【FINCAD Analytics Suite 2019 の主な特長】

新規関数の追加について

主要な関数について以下の通りご紹介致します。

機能	説明	New Function
Overnight curve (dependent discounting)	オーバーナイトおよび無担保xIBORのカーブを構築する新しいカーブ関数。先物のコンベクシティ調整、ベースス・スワップ処理、カーブの延長、Bumpのユーティリティをサポート致します。	aaDFCurve_Dep
CSA curve (xccy basis)	為替フォワードおよびクロスカレンシーベーススのスワップのクォートを使い、多通貨CSA契約のある価格契約に適用できるマージンレグの割引カーブを計算致します。	aaDFCurve_AddXCBasis Spreads3_dgen
Offshore curve	NDF (non-deliverable forwards) およびNDS (non-deliverable swaps) を使い、他通貨で担保される商品に適用可能なオフショア市場の割引カーブを計算致します。	aaDFCurve_Offshore
Constant maturity spread option (cap/floor)	2つのCMSインデックスに対するスプレッドオプションの価値とリスク指標を計算致します。	aaCaplet_CM_spread_LV

Python 2.7 and 3.6 の追加

FINCAD Analytics Suite for Developers で、Python アプリケーションとユーザー環境において FINCAD 関数を呼び出すことが可能になりました。

Press Release

【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 上で自由に金融商品の評価・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 枚以上内蔵されています。

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 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 には主に下記 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致します。

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。

Press Release

【最新バージョンリリースキャンペーンのお知らせ】

「F3 8.0」「FINCAD Analytics Suite 2019」のリリースを記念し、期間限定の最新バージョンリリースキャンペーンを実施致します。初めてFINCAD製品をご利用される方も、バージョンアップをご検討の方も是非、この機会をご利用ください。

特別価格：ライセンス定価価格の（10%OFF）にて提供致します。

キャンペーン期間：2019年4月1日～2019年4月30日

対象製品

- FINCAD Analytics Suite for Excel / Developers
- F3 Excel Edition / SDK Edition

【販売開始日（製品出荷可能日）】

2019年3月25日

■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なう「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。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致します。

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 カスタマー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 : 03-4405-7846 / 03-6436-35346

*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。