

2021年6月22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)

日本政策投資銀行がテクマトリックスの「FINCAD CVA 計測サービス」を導入

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、株式会社日本政策投資銀行(本社:東京都千代田区、代表取締役社長:渡辺一、以下「日本政策投資銀行」)が、「FINCAD CVA 計測サービス」を採用し、2021年3月に導入が完了したことをお知らせいたします。

金融機関は、2019年7月4日に企業会計基準委員会より公表された企業会計基準第30号「時価の算定に関する会計基準」に関する新たなガイダンスに従い、2021年度より時価算定に関して、取引相手先の信用リスク(「Credit Value Adjustment」以下CVA)を計測することが求められております。上記に伴い、日本政策投資銀行には、会計基準対応の一環として本サービスをご採用いただきました。

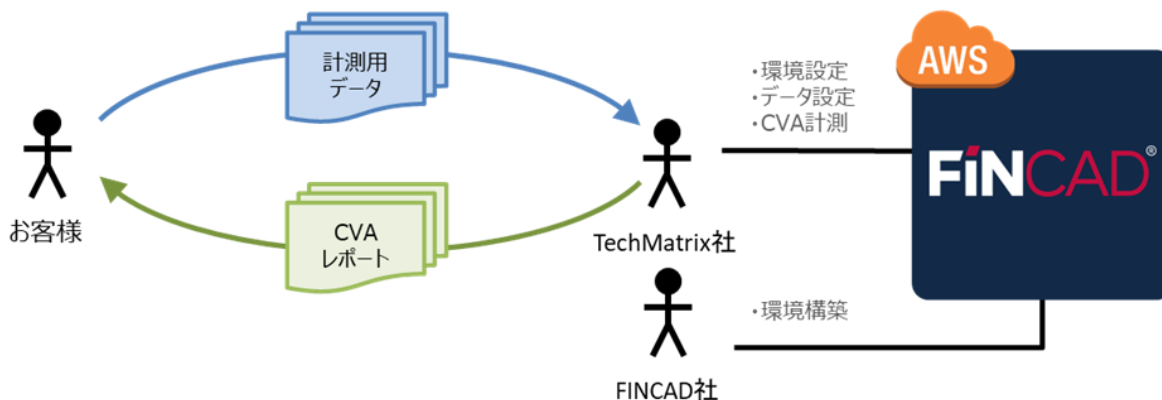
■ 株式会社日本政策投資銀行 リスク統括部からのメッセージ

今回テクマトリックス様のご提案を採用した理由としては、FINCAD社様を始めCVA計測における実績が豊富にあることに加え、データの受渡方法等を当行の既存システムに合わせて調整できることが大きな理由でした。導入に際しては、スケジュール管理を含めてテクマトリックス様に主導していただき、都度生じた論点等についても柔軟な対応をいただけて、円滑に導入することができました。今後も最新動向に即した様々な規制対応等を迅速に行っていただけることや使い勝手の向上等を含むバージョンアップにも期待しております。

【FINCAD CVA 計測サービスについて】

- FINCAD CVA 計測サービスは、当社にてCVA計測を行い、定期的(四半期毎や月次)に結果レポートを提供するサービスです。
- お客様より提供いただいた取引データ及びマーケットデータを利用してCVA計測を行います。
- CVA計測は、テクマトリックス及びFINCAD社がAWS上に構築した環境にて行います。

※本サービスの詳細はこちら https://www.techmatrix.co.jp/product/f3/f3_cva.html



Press Release

■株式会社日本政策投資銀行について

- ・ 所在地：東京都千代田区大手町1丁目9番6号 大手町フィナンシャルシティ サウスタワー
- ・ 代表取締役社長：渡辺 一
- ・ URL：<https://www.dbj.jp/>

日本政策投資銀行は、出資と融資を一体的に行う手法その他高度な金融上の手法を用いることにより、長期の事業資金に係る投融資機能を発揮し、長期の事業資金を必要とするお客様に対する資金供給の円滑化及び金融機能の高度化に寄与します。

■テクマトリックス株式会社 について

- ・ 所在地：東京都港区三田3丁目11番24号 国際興業三田第2ビル
- ・ 代表取締役社長：由利 孝
- ・ URL：<https://www.techmatrix.co.jp>

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 Corporation について

- ・ 所在地： Central City, Suite 1750 13450 102nd Avenue Surrey, BC Canada V3T 5X3
- ・ 代表取締役社長：Mark D'Arcy
- ・ URL：<https://fincad.com/>

FINCAD社は、アナリティクス分野において30年以上の経験をもち、アセットマネジメント、銀行、保険、ヘッジファンドの金融機関や企業財務部門に対し、プライシング、モデリング、リスク分析を提供するパイオニアです。FINCAD社は標準的な商品から複雑な金融商品までのあらゆるデリバティブの課題を解決するための金融工学の専門知識を有しており、FINCAD社は、グローバルからローカルあるいはデスクレベル、また、複雑なポートフォリオからシンプルなポートフォリオにおいて、容易且つ柔軟な金融商品の評価と分析を介して、リスクとリターンを最適化します。デリバティブおよび債券商品のプライシングにおける高い正確性と透明性、且つ拡張性のあるテクノロジーの提供とともに、FINCADサポートチームはお客様のニーズに合致したハイクオリティなサポートを提供します。

<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。