

Press Release

平成26年7月28日

報道関係者各位

テクマトリックス株式会社

FINCAD、エンタープライズ評価・リスク分析ソリューションF3プラットフォームを発表

規制への対応と競争上の優位性獲得に向け、評価・リスクの全体像を当日ベースで正確に把握することが可能に

2014年4月23日 バンクーバーOTCデリバティブのプライシングとリスク管理ソリューションの主要プロバイダーであるFINCADは本日、エンタープライズ評価・リスク分析ソリューションF3プラットフォームを発表しました。F3プラットフォームは、金融業界を苦しめる情報のサイロ化を克服する、エンタープライズ全体のリスク、マージン、担保要件の概要を提供します。企業はこの先進的なプラットフォームにより、多様な取引場所を最適化し投資機会を最大限に活用する一方で、効果的にリスクを管理し新規制に対応することができます。

FINCADの社長兼最高経営責任者であるBob Park氏は、以下のように述べています。「2008年の金融危機の余波として徐々に施行されてきたドッド・フランク法 や、欧州市場インフラ規制などの規制枠組が金融業界に変革をもたらしてきました。断片的なテクノロジー導入の歴史が情報のサイロ化を招き、その結果、資産価値やリスクエクスポージャーを企業全体として把握することは実質不可能になっています。過去に機能していたかもしれないこのアプローチを支持することは、もはやできません。規制に対応するにはリスクを全体論的に捉えることが求められますし、競争力の維持とは当日ベースで正確な分析能力を持つことと同義です。F3プラットフォームは業界有数のパフォーマンスにより、評価・リスク両方を包括的に把握することで、オンデマンドレポートという課題に対処しようというものです。」

Celent Researchのセキュリティ投資グループ担当リサーチ・ディレクター、Cubillas Ding氏は以下のように述べています。「資本制約環境という新たな継続的事実に企業が直面する今、金融資産、資本、リスクを企業全体レベルで効果的に管理することは、競争上の必要性になりつつあります。」

F3 プラットフォームは、あらゆるタイプのトレーディングをモデル化し、一貫した手法で評価・リスク計測を実施することができます。すなわち一元化され共有や監査が可能な、信頼性の高い財務分析のソースを得ることができます。F3プラットフォームは、エクスポージャーについての総合的な情報を企業に提供することができ、例えばマージンや担保条件をいかに最適化するのかについて、より優れた意思決定が可能となります。F3 プラットフォームは不正確でエラーの生じやすい複雑な集計方法を用いなくても、法的要件への対応を効果的に手助けします。Park氏は次のようにも述べています。「F3プラットフォームが可能にすることをひとたびご理解いただければ、従来型のトレーディングにおける意思決定の多くは目をつむって空を飛ぶようなものだとお感じになるでしょう。」

F3プラットフォームはまた、その他のソリューションが要件とする完全な置換アプローチではなく、既存システムとのシームレスな連携と増え続けるシステム導入に対応するよう設計されています。「全般的に見て、組織は会社全体の分析を行うためのソリューションの展開についてはその必要性を認識していますが、いつどのようにそれを実行するのかという非常に大きな問題に行き詰っています」とPark氏は述べています。

モスクワ証券取引所(MOEX) は、F3プラットフォームを最も早く採用した企業のひとつです。MOEXのマネージング・ディレクター、Roman Sulzhyk氏は、次のように述べています。「OTCデリバティブを決済・取引する世界の主要取引所と競争するうえで、我々は単に正確というだけではなく十分な透明性を持った分析プラットフォームを必要としていました。FINCADの F3プラットフォームは、実証済みの精度を誇る世界有数のソリューションであり、十分な透明性を備えています。当社にはこのソフトウェアを活用する金融アナリストやリスクマネージャーがおり、誰もが導入しやすく使いやすくと感じています。」

比類の無いパフォーマンスを誇る特許取得済みURT™

F3 プラットフォームの分析は、2014年3月にFINCADが特許権を取得したUniversal Risk Technology™ (URT)を基盤としています。URT はあらゆるモデルと評価手法を活用するもので、ヴァニラからエキゾチックまでの金融商品、またシングルトレードからポートフォリオまで、様々な評価を行ううえで迅速な分析エクスポージャーの計測を保証しています。これは独自の一般的アーキテクチャを利用しており、従来のモデルやトレード固有のアプローチに取って代わるものです。Cerebraの共同パートナーである Amrish Ganatra氏によれば「その結果が実際には同等であった」とはいうものの、URTの速度はバンピングよりも2000倍速いことがテストで証明されています。

さらに重要なのは、大規模あるいは複雑なポートフォリオのリスク計測や信用評価調整 (CVA) など、コンピュータ上の集中的なアナリティクスにおいて、この種の処理速度が一定に維持されているということです。この結果、計測は当日リアルタイムで容易に遂行され、ユーザーはトレーディングと投資における決定を、正確な情報に基づいて行うことができます。

FINCADが誇る業界有数の財務分析ライブラリ上に構築されたF3プラットフォームは、ポートフォリオやハイブリッド商品など最も幅広い調達手段や資産クラスに対応しています。業界標準のプライシングモデル、市場慣習、統計データ、リスクモデルによりあらゆる種類の調達手段もパーチャルに分析することが可能となりました。加えてFINCADの洗練されたハイブリッドモデリングエンジンを利用することで、1つのプラットフォーム上で全てのリスクエクスポージャーを把握することができるようになります。資産クラス、デスク、ポートフォリオといった包括的分析を統合することで、F3プラットフォームは多くの企業が現在支払っている重い間接費を支払うことなく、企業全体の分析に要求される規制要件への対応を行うことが可能となります。

FINCADについて

FINCADは、全世界に数千のユーザー企業を持つ世界有数の評価・リスク管理ソリューションプロバイダーです。FINCAD社のテクノロジーは、主要ソフトウェアプロバイダー80社の自社ソリューションに採用されています。FINCADは包括的かつ透明で精度の高いタイムリーな情報を提供することにより、幅広い機関の財務意志決定者を支援しています。FINCADは、ニューヨーク、ロンドン、北京、ダブリン、バンクーバーに拠点を置いています。

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
URL 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 金融ソリューションチーム
担当: 高田 光範
TEL 03-5792-8607 FAX 03-5792-8707
E-MAIL: fincad@techmatrix.co.jp