

FINCAD 社が日本の金融機関向けに CVA サービスの提供を開始

金融商品のプライシング、モデリング、リスク分析を提供するパイオニアであるカナダの FINCAD 社は、2021 年 2 月 24 日付けで、日本の金融機関向けに信用評価調整（CVA/DVA）の評価・レポートニングを実施する新しいクラウドベースのサービスを開始することを発表しました。CVA および DVA は、2021 年 4 月より日本にて適用される企業会計基準を満たした時価評価に関する規定で、最初の報告は 2021 年 6 月に予定されています。

FINCAD 社の次世代分析ソリューションである FINCAD CVA サービスを利用することによりユーザーは、ポートフォリオの大きさや複雑さを問わずデリバティブ取引における CVA を計測することができます。また、金融機関は複雑な CVA 計測のための実装を不要とし、容易に会計報告に必要なレポートが提供されます。

デリバティブまたは証券金融取引に従事する金融機関は、カウンターパーティの信用力低下による評価損を被るリスクにさらされています。バーゼル III の枠組みでは、カウンターパーティの信用スプレッドの変化もしくはその他の市場リスクによる潜在的な損失は、多くの場合 CVA リスクと呼ばれます。

CVA の計測や管理は容易ではなく、複雑な計算と数千回に亘るシミュレーションが必要です。FINCAD 社の最高経営責任者である Mark D'Arcy は次のように述べています。「FINCAD 社のワールドクラスの金融商品評価・分析力をネイティブクラウドテクノロジーと組み合わせることにより、ユーザーに拡張性と費用対効果の高い分析ユーティリティを提供し、業務効率化を実現します。テクマトリックスと協力することにより、複雑なポートフォリオを有する日本の金融機関のニーズに合わせてサービスを提供できることに大きな期待を抱いています。FINCAD CVA サービスは、アナリティクス Fintech クラウドソリューションとして提供するクラウド評価サービスの一つであり、その他各種の金融商品評価サービスも提供可能です。」

2020 年にリリースされた FINCAD CVA サービスは、2021 年 4 月から日本の複数の銀行にてサービスの利用が開始され、以下のサービスを提供します。

- ◇ 会計CVA報告の必要性の判断のためのCVA試算サービス
- ◇ 継続的にCVAを計測してレポートニングするCVA計測サービス
- ◇ 市場のボラティリティに対する期待エクスポージャーの継続的な計測サービス
- ◇ 20年以上に亘る日本市場におけるパートナーであるテクマトリックス社による導入支援とサポート

※ 本記事は、FINCAD 社のプレスリリース「FINCAD LAUNCHES ACCOUNTING CVA SERVICES FOR JAPANESE FINANCIAL INSTITUTIONS」を翻訳したものになります。

原文はこちら(https://fincad.com/fincad_launches_accounting_cva_services_for_japan?platform=hootsuite)をご覧ください。

■ FinancialCAD 社について

FinancialCAD 社は、アナリティックス分野において 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。

<https://fincad.com/>