

triCalculate SIMM™ Sensitivities

トライカルキュレートは、SIMM計算に必要なデルタ及びベガを
いずれの商品クラスに対しても算出・提供いたします。

SIMMのための感応度計算の負荷を軽減

“Standard Initial Margin Mode (SIMM)”はISDAによって開発された当初証拠金計算のための業界標準のフレームワークです。今フレームワークを使用する場合には、全ての規制対象取引に対してデルタとベガを算出します。また、SIMMに合わせてISDAによって作成されたCRIF (Common Risk Interchange Format) の規定する形式にて感応度を算出するため、対象金融機関の対応が求められています。

トライカルキュレートは、貴社の取引感応度を計算します。貴社の取引明細ファイルをアップロードしていただくと、最新バージョンのSIMMに沿って感応度を算出します。トライカルキュレートをご利用いただきますと、後続のIM Exposure ManagerとtriResolve Marginへ算出結果が自動連携されます。(裏面を参照) またSFTPやAPIによって、自社システムへ自動接続する事も出来ます。

トライカルキュレートは、貴社の迅速かつ費用対効果の高い規制対応を実現します。

トライカルキュレートの特徴

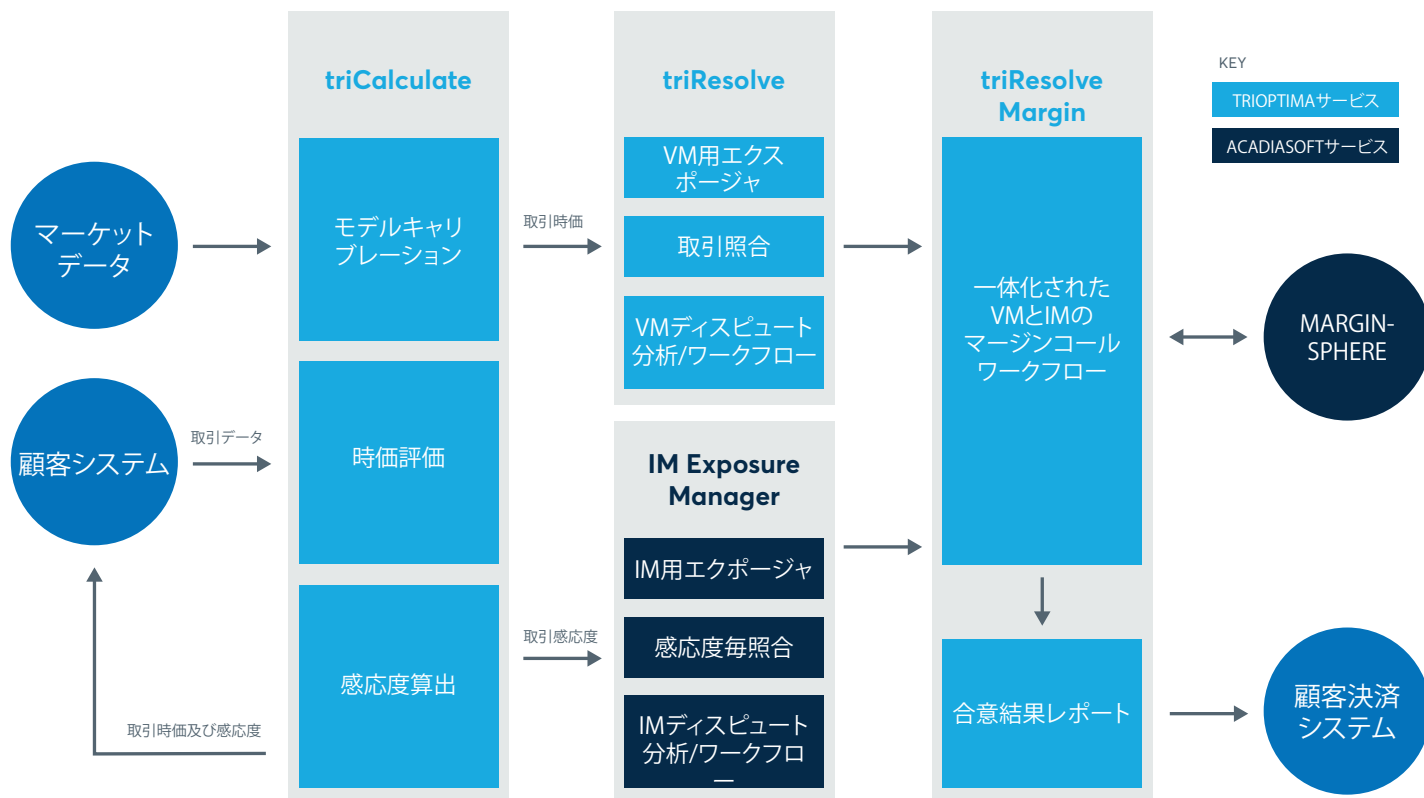
- 貴社のファイル形式をサポート
- マーケットデータを提供
- ISDA CRIF に沿った形式で算出結果を提供
- IM Exposure Manager への自動連携
- タームシートに沿った感応度計算に対応
- モンテカルロ法によるプライシングに対応

トライカルキュレートをご利用いただく利点

- 常に最新バージョンのSIMMモデルを採用
- 感応度と時価の提供
- ソフトウェアやハードウェアのインストールが不要
- 最短1か月での導入実績
- 従量課金制 (初期導入費用やアップグレード費用は無し)



ハイパフォーマンスかつ拡張性の高いソリューション



なぜトライカルキュレートが選ばれているのか？

定評のある顧客サポート

弊社評価分析チームが、取引データ取り込みから結果開示まで随時サポートします。

また必要に応じて、計算に使用したモデルやマーケットデータを開示いたします。

精度の高い計算とシュミレーション

各パラメーターは日次でキャリブレートされた後、時価評価とシュミレーションに使用されます。

迅速なサービスインと定期的なアップデート

トライカルキュレートはウェブベースのサービスであり、ご利用開始時にソフトウェアやハードウェアのインストールは不要です。

アップデートは定期的に行われ、全てのお客様が最新バージョンをご利用いただけます。

透明性の確保

計算に使用されるモデル詳細を提供いたします。

トライカルキュレートの詳細におきましては、info@trioptima.com 又は下記のTriOptimaオフィスまでご連絡下さい。

ニューヨーク
+1 646 744 0401

ロンドン
+44 20 7382 2738

ストックホルム
+46 85 452 5148

シンガポール
+65 6372 8181

東京
+81 3 5511 6688

TriOptima (www.trioptima.com)は、CMEグループ傘下の会社です。

世界をリードし、最も多様なデリバティブ市場を提供するCMEグループ (www.cmegroup.com)は、先物、オプション、現物およびOTC市場の取引、ポートフォリオの最適化、さらにデータ分析を可能にし、それによって、世界中の市場参加者に効率的なリスク管理と取引機会を提供しています。CMEグループの取引所は、金利、株価指数、外国為替、エネルギー、農産物および金属など、主要資産クラスを原市場とする、世界指標となるプロダクトを幅広く提供しています。同社はCMEGlobex®プラットフォームによる先物取引、BrokerTecによる債券取引、およびEBSプラットフォームにおける外国為替取引の先物およびオプションを提供しています。さらに、世界有数の清算機関であるCME Clearingを運営しています。CMEグループは、取引の時間軸全体をサポートする様々な商品やサービスを提供しており、TriOptimaによる最適化および調整サービス、そしてTraianaによる取引処理サービスも提供しています。

ここに掲載されている全ての情報（「情報」）は、その提供のみを目的とした特殊情報であり、CME Group Incおよび/またはそのグループ会社（「CME」）の知的財産です。この情報は、同等の取引相手および専門的顧客のみを対象としており、非専門的顧客（スウェーデン証券市場法（lag: 2007: 528）または関連法域での定義）を対象としたmpではありません。この情報は、いかなる商品、投資、証券またはその他の金融商品の売買または特定の取引戦略に勧誘するためのものではなく、またそのように解釈されるべきものでもありません。情報は、完全性、適時性、正確性、商品性、または特定の目的への適合性に関して、明示的にも暗示的にも依拠するものではなく、またそれを保証するものでもありません。全ての表明および保証は明示的に否認されています。CMEの書面による事前の承認なしに、意図した受領者以外が情報にアクセスすることは許可されておらず、開示、コピー、または再配布も禁じられています。この情報を誤って受け取った場合は、直ちにその全てのコピーを削除して送信者に通知してください。いかなる状況においても、CMEは、間接的または直接的な損失、あるいは結果として生じる損失または損害、またこれらに限定されない業務の喪失または利用から生じる利益、情報の不正使用、または情報の不正確性について、責任を負うものではありません。CMEおよびCMEのロゴはCMEグループの商標です。TriOptima ABIは、複数の金融商品に関連した注文の受領および送信に関し、スウェーデンの金融監督管理局によって規制されています。TriOptima ABIは、取次ブローカーとしてCFTC（米商品先物取引委員会）に登録された業者です。詳細については以下を参照：www.nex.comおよびwww.cmegroup.com。