

triCalculate IM分析サービス

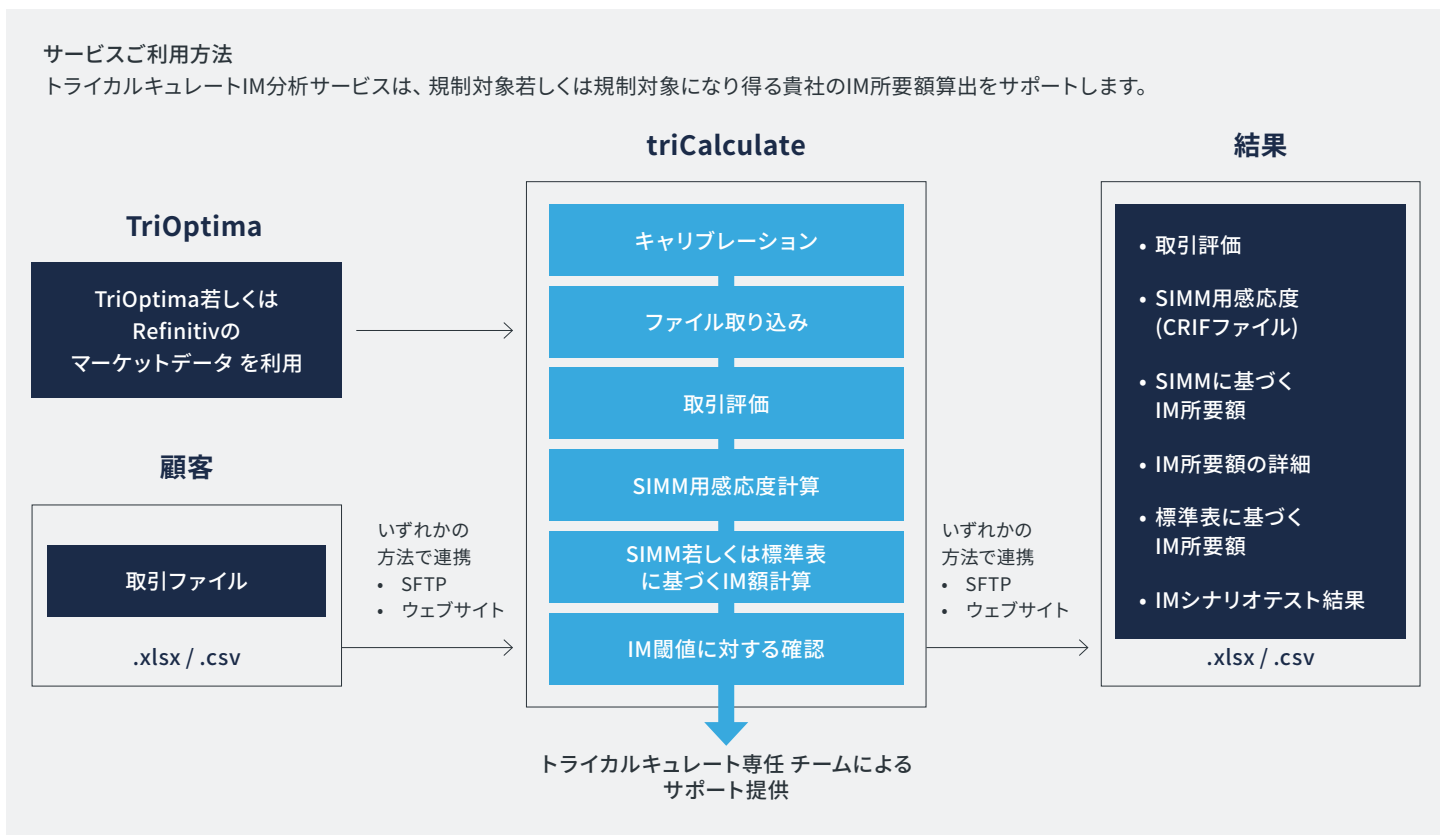
当初証拠金 (IM) 規制は、2021年及び2022年にかけて1,000超のエンティティに適用される事となります。規制対象となるエンティティは、当初証拠金計算及びIM交換に伴う様々な業務上の課題と向き合う事が必要とされます。トライカルキュレートは、貴社が規制に備え、適格な意思決定を行えるよう、IM分析サービスを提供いたします。

規制開始に向けた準備

トライカルキュレートIM分析サービスは、IM計算方法決定、規制対象となる相手先の特定・優先順位付け及びIMにかかる将来コスト削減をサポートします。

皆様の需要に応じたサービスを提供

トライカルキュレートIM分析サービスは、貴社の需要に応じて、結果を定期的若しくはアドホックで提供いたします。初期費用はかからず、実若しくは仮想ポートフォリオの含まれた取引ファイルをご準備いただければ、サービス利用開始が可能です。



トライカルクレイトIM分析サービス活用方法

SIMM vs標準表

貴社は、まず、ISDA Standard Initial Margin Model (SIMM)と標準表のどちらの方法でIM所要額を計算するかを、事前取引先と合意します。トライカルクレイトはSIMMと標準表のどちらの計算方法もサポートしており、IMに係るコストを計算方法毎に分析する事により、貴社の計算方法決定をサポートします。

SIMM計算結果サンプル

party_id	counterparty_id	site	risk_class	instrument_type	bucket	trade_count	pledgor_in	secured_in
DEMO	TEST COUNTERPARTY					13	4,984,055,924	4,853,955,789
DEMO	TEST COUNTERPARTY	RussPF FX				9	4,175,607,489	4,509,875,343
DEMO	TEST COUNTERPARTY	RussPF FX	Vega			4	111,244,995	111,244,995
DEMO	TEST COUNTERPARTY	RussPF FX	Vega	EURGBP		2	128,754,147	128,754,147
DEMO	TEST COUNTERPARTY	RussPF FX	Vega	USOGBP		2	422,254,187	422,254,187
DEMO	TEST COUNTERPARTY	RussPF FX	Curvature			4	65,732,246	0
DEMO	TEST COUNTERPARTY	RussPF FX	Curvature	EURGBP		2	2,762,246	1,763,165
DEMO	TEST COUNTERPARTY	RussPF FX	Curvature	USOGBP		2	9,876,162	9,876,162
DEMO	TEST COUNTERPARTY	RussPF FX	Delta			9	3,999,402,248	3,999,402,248
DEMO	TEST COUNTERPARTY	RussPF FX	Delta	USD		7	3,997,103,887	3,997,103,887
DEMO	TEST COUNTERPARTY	RussPF FX	Delta	EUR		2	106,488,572	106,782,858
DEMO	TEST COUNTERPARTY	RussPF IR				19	354,090,846	354,090,846
DEMO	TEST COUNTERPARTY	RussPF IR	Delta			13	354,090,846	354,090,846
DEMO	TEST COUNTERPARTY	RussPF IR	Delta	GBP		11	499,780,955	499,780,955
DEMO	TEST COUNTERPARTY	RussPF IR	Delta	USD		7	100,443,189	100,443,189
DEMO	TEST COUNTERPARTY	RussPF IR	Delta	EUR		2	42,452,690	42,152,650

標準表計算結果サンプル

party_id	counterparty_id	Asset class	IM requirement (% of notional exposure)	trade_count	Gross_IM	Party Mtm	NetReplacementCost Pledgor Party	GrossReplacementCost Pledgor Party	NetReplacementCost Secured Party	GrossReplacementCost Secured Party	pledgor_im	secured_im
DEMO	TEST COUNTERPARTY	Credit: 0-2 year duration		2	0	0						
DEMO	TEST COUNTERPARTY	Credit: 2-5 year duration		5	0	0						
DEMO	TEST COUNTERPARTY	Credit 5+ year duration		10	0	0						
DEMO	TEST COUNTERPARTY	Commodity		15	0	0						
DEMO	TEST COUNTERPARTY	Equity		15	0	0						
DEMO	TEST COUNTERPARTY	Foreign Exchange		6	8	3,155,478,000						
DEMO	TEST COUNTERPARTY	Interest Rate: 0-2 year duration		1	2	504,250,000						
DEMO	TEST COUNTERPARTY	Interest Rate: 2-5 year duration		2	3	852,638,000						
DEMO	TEST COUNTERPARTY	Interest rate: 5+ year duration		4	0	0						
DEMO	TEST COUNTERPARTY	Other		15	0	0						
DEMO	TEST COUNTERPARTY			13	4,512,366,000	735,534	0	925,000	735,534	899,500	1,804,946,400	4,018,842,084

IMに係る将来コストを把握

将来のIMコストを適切に認識する事が重要視されています。トライカルクレイトIM分析サービスは、貴社の仮想ポートフォリオに対するIM所要額を計算し、IMに係る将来コストの見積及び把握をサポートします。

規制対象となる取引先と閾値到達時期を確認

閾値に到達した取引先とはIMマージンコールが発生する事となります。トライカルクレイトIM分析サービスは、IM CSA締結の優先順位付けのため、各取引先毎のIM所要額計算結果を提供いたします。

IM規制関連サービスを包括的に提供

トライカルクレイトIM分析サービスをご利用いただく事により、計算方法決定、対象取引先特定、及びIMに係るコスト削減が実現されます。IMマージンコール発生後は、TriOptimaの提供するIM規制関連サービスが、貴社のIM所要額計算、マージンコール管理及びディスピュート管理をサポートします。

サービス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。

ロンドン
+44 20 7382 2200

ニューヨーク
+1 646 744 0400

シンガポール
+65 6372 8181

ストックホルム
+46 8 545 25 130

東京
+81 35511 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<http://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)を対象としたものではありません。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 AB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 AB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<<http://www.nex.com>>そして www.cmegroup.com<<http://www.cmegroup.com>>.