

当初証拠金規制 閾値モニタリング サービス

IM所要額を計算しモニタリングする事による迅速な規制対応準備

提出された取引データに基づき、貴社のIM所要額を計算し、効率的なIM閾値に対するモニタリングサービスを提供いたします。

2019年3月にBCBS IOSCOより、グループ間でのIM交換閾値（€50 million）到達以前の契約書及びカストディ設定が不要との内容の声明が公表されました。

大手金融機関様におかれましては、各相手先グループとのIM交換閾値到達までに時間を要さないため、今声明による影響は限られます。よって引き続き、IM計算方法・サービスの選択及びIMマージンコールプロセスの確立を含む各種規制対応準備を進め、IM CSAの締結やカストディ設定を行う必要があります。

その他金融機関及びバイサイド様におかれましては、取引数が少なく、各相手先グループとIM交換閾値到達までに時間を要するため、今声明によって、IM所要額の計算と閾値に対するモニタリングにのみ集中する事が可能になると考えられています。

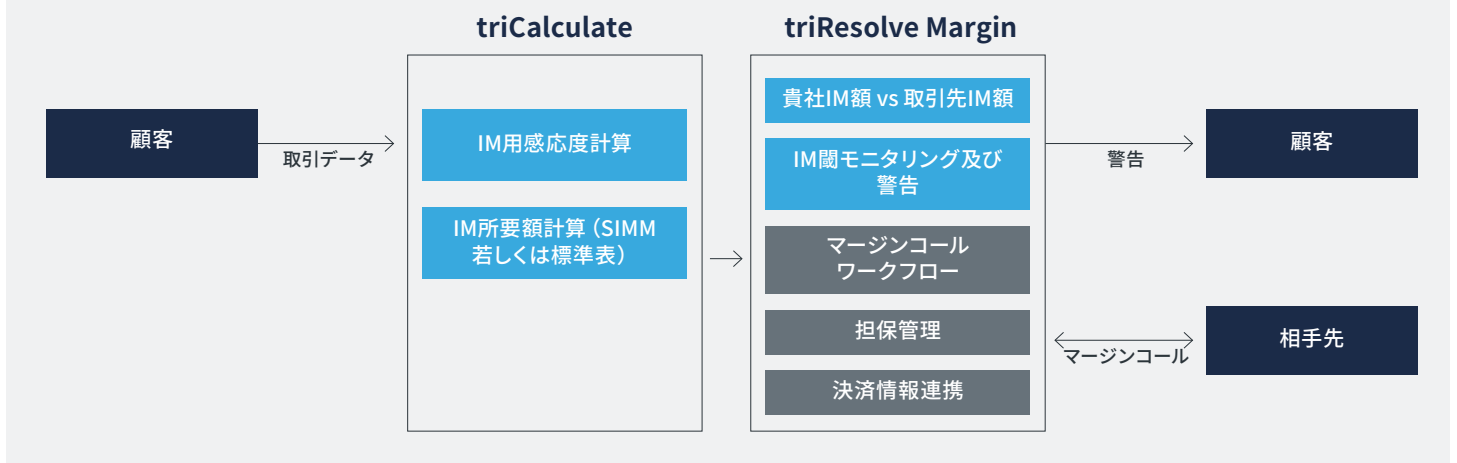
包括的なIM閾値モニタリングソリューション

取引ファイルの連携のみを必要とする簡潔なオンボーディングによって、TriOptimaは迅速なIM閾値モニタリング開始をサポートいたします。サービス概要は、以下の通りです：

- 貴社よりtriCalculateに取引ファイルを連携していただき、取引毎感応度を計算
- 規制対象取引に対するIM所要額を相手先毎に計算する（SIMM若しくは標準表）
- triCalculateにて計算されたIM所要額をtriResolve Margin上で相手先毎にモニタリングし、相手先の数値と比較
- triResolve Margin上にて事前に設定された相手先毎閾値に基づき、自動警告メールを送信し、IM規制関連設定を優先して行うべき相手先の特定をサポート

IM所要額が閾値に達した際には、モニタリングからIMマージンコールプロセスへサービスの切り替えが可能です。

- IMマージンコール額は自動計算され、MarginSphereを介して相手先に通知
- マージンコール合意結果に基づき、カストディアンへRQVを自動通知



サービスの主な特徴



貴社のIM所要額計算及び
モニタリング機能を一括提供



取引ファイルの連携のみで
サービスご利用開始が可能



モニタリングからマージンコール
プロセスへのサービス切替時にかかる
追加費用は無し



従量課金制 (規制対象取引及び
取引先数に応じて課金、
MarginSphere利用料金込み)



オンボーディング、サポート及び
アップデートにかかる追加費用は無し



自動化されたIM閾値モニタリング
サービスの使用により
事務負荷の削減をサポート

サービス詳細におきましては、info@trioptima.com 又は各地の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グループの一員です。

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 及び www.nex.com として www.cmegroup.com として www.cmegroup.com。