

Analytics API

イールドブックの分析モデルと
LSEG の分析ライブラリを集約した
包括的マルチアセット分析のための API

LSEG の Analytics API は、イールドブックの洗練された分析モデルと、Adfin および Price-It のアドバンスなプライシング・モデルとライブラリを集約したマルチアセット分析のシングル・ソースとして、お客様の金融モデル・インテリジェンスへアクセスを容易にし、さらにお客様のビジネスの価値創造を支援します。

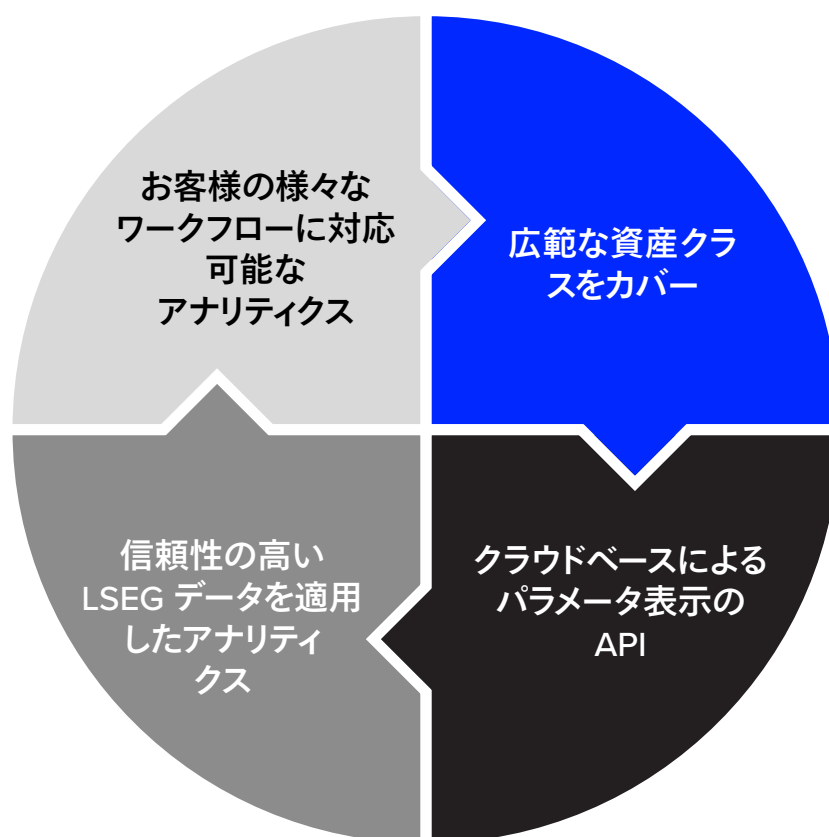
お客様のニーズ	LSEG Analytics のソリューション
柔軟性	- JSON および REST API コールをサポートするあらゆる環境やフレームワークからデータおよび分析モデルとライブラリにアクセス - 大量の銘柄数の分析計算の一括処理ができ、効率性の向上を実現 - シンプルでモダンなインターフェイスが、社内リスク管理部門とフロント部門間のワークフローのシームレスな連携をサポート
時間を選ばずいつでもアクセス	1日24時間利用可能* - 分析の前提に LSEG データの適用も可能
広範なマルチアセット・カバレッジ	- 債券のほか、金利、仕組み商品、為替、株式などのデリバティブズ商品を含む広範囲なマルチアセット・データベースから市場の深いインサイトを獲得 - LSEG の市場データとアナリティクスの両方をフロント、ミドル、バックオフィスのワークフローとシステムへインテグレーション

Analytics API の主な機能

価格・利回り計算	OAS、コンベクシティ、実効コンベクシティ、実効デュレーション、パーシャル・デュレーション等の債券銘柄のリスク指標値の算出と取得
シナリオ分析およびキャッシュフロー計算	ホライゾン期間、再投資利率、金利シフトのタイミングを設定し、イールドカーブにショックを与えて銘柄ごとのパフォーマンス予測値の算出と取得 ユーザー定義の金利シフト、スプレッド、通貨、ボラティリティ、期限前償還率に基づいてモーゲージ証券のシナリオ・キャッシュフロー計算およびリターンなどの予測値の算出と取得
高度なモーゲージ証券分析	CMO の担保のプール・レベルの詳細データの取得 実績値とモデル予測値の比較による期限前償還率モデル・パフォーマンス分析、WAL 感応度による PAC バンドのストレステストの実行
OTC デリバティブの価格設定	スワップ、キャップ／フロア、スワップションのプライシングおよびバリュエーション計算と取得
オプション価値分析	デリバティブズ商品（株式、外国為替、債券、コモディティ）のグリークスとオプション価値の算出と取得
カスタム・カーブ	ゼロ・クーボン・カーブ、為替フォワード・カーブ、コモディティ・カーブなどの構築、カスタマイズ、シフト
ボラティリティ・サーフェス	ボラティリティ・レベルの算出、ボラティリティ・スライスの生成、為替・金利・上場物のボラティリティ・サーフェスの取得

*日曜の午前6時から午後6時を除く（米国東部標準時間）





投資・運用の戦略とタスクに応じた Analytics API の活用方法は多岐にわたります。以下は活用事例の一部です。

リスク管理のレポートのためのオーバーナイト・バッチ処理

前日の引け値を基準とするリスク計測量レポートを翌営業日朝に使用できるようにするためのレポート・アプリケーション

コンプライアンスのための取引執行前分析と発注管理システム

コンプライアンス・システムと発注管理システムにおける取引執行前分析に Analytics API を活用

キャッシュフロー予測ツール

ユーザーが指定する金利カーブシフトおよび期限前償還率に基づいて、キャッシュフローやリターン の予測値を算出

システム・アーキテクチャ

アナリティクス: 個別銘柄の分析

インターフェイス: カスタム・アプリケーション

レポート: ユーザー独自のテンプレート

データ保存: カスタム・アプリケーションに保存

インストール: 不要

強化されたアナリティクスへのアクセス方法

現在イールドブックの REST API をカスタム・アプリケーション内でご使用のお客様に、Analytics API をアドオン・パッケージとしてご提供しています。詳細は、セールス担当者 sales@yieldbook.com までお問合せください。

lseg.com でも詳細をご覧ください。



LSEG DATA & ANALYTICS