

イールドブック REST API

自社開発アプリケーションとイールドブックの融合

イールドブック REST API は、自社開発のアプリケーションからイールドブックの信頼できるデータや分析機能へのアクセスを実現します。

JSONやXML形式でのメッセージ送受信で直接自社開発アプリケーションとイールドブックのサーバーを結びます。

求められる要件	イールドブックREST APIのソリューション
柔軟性の確保	<ul style="list-style-type: none">- イールドブックREST APIはPythonや.NET、Javaなどの仮想プログラミング環境で実行できます- 自社開発のアプリケーション上で、複数銘柄または複数の種類の分析計算を同時に実行し、処理時間を高速化できます- 複数のアプリケーション・ユーザーがそれぞれ独立して計算処理を実行できるように設計することも可能です。イールドブックREST APIはリスク管理部門やトレーディングデスクに効率的なプロセスを構築するための最先端のツールです。
24時間365日のデータアクセス	<ul style="list-style-type: none">- イールドブックのサーバーに24時間365日接続が可能- 包括的な債券データへのアクセス。銘柄属性データやヒストリカル・プライス、イールドカーブ、モーゲージ証券の期限前償還率の予想と実績の比較データなど。
幅広い銘柄カバレッジ	<p>イールドブックの債券分野でのカバレッジは以下のように広範囲にわたります。</p> <ul style="list-style-type: none">- 国債、ソブリン債- 社債- 地方債- 証券化商品：米国エージェンシーRMBS、CMO、TBA、個別プール、米国ノンエージェンシーRMBS、信用リスク移転MBS、米国エージェンシーCMBS、米国ノンエージェンシーCMBS、米国ABS、ユーロABS、ユーロRMBS、住宅金融支援機構RMBS、オーストラリアRMBS- CLO（2022年第2四半期から）- 先物、フォワード、スワップ、オプション等のデリバティブ

主な機能と特徴

イールドブックREST APIは以下の機能をサポートしています。

プライス/ イールド計算	OASやコンベクシティ、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リスク指標の計算や分析データの取得
シナリオ分析および キャッシュフロー分析	<ul style="list-style-type: none"> 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銘柄ごとのパフォーマンスを評価 ユーザーが設定する金利シフト、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キャッシュフローやリターンの予測値を計算
高度なモーゲージ証券分析	<ul style="list-style-type: none"> CMOに関するプールごとの詳細など、担保情報の取得 実績とモデル予測を比較した、期限前償還率モデルパフォーマンスの分析 WAL感応度によるPACバンドのストレステスト

アプリケーション例

カスタマイズ可能なイールドブックREST APIでユーザーのニーズに合致したアプリケーションが作成可能です。以下はその例です

リスク管理レポートのバッチ作成

レポートング・アプリケーション: バッチ処理により複雑な工程を必要とするレポート作成を自動的に処理します

予想最大損失額 (VaR) 計算のシナリオ分析エンジン

リスクや潜在リターンの要因分解や計測を可能とするアプリケーション

コンプライアンスシステムと発注管理システムの取引執行前分析

コンプライアンスシステムと発注管理システムの入力情報の作成にイールドブックREST APIを組み込んで、取引執行前分析に活用

キャッシュフロー予測ツール

ユーザーが設定する金利シフトと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計算するアプリケーション

システムアーキテクチャ

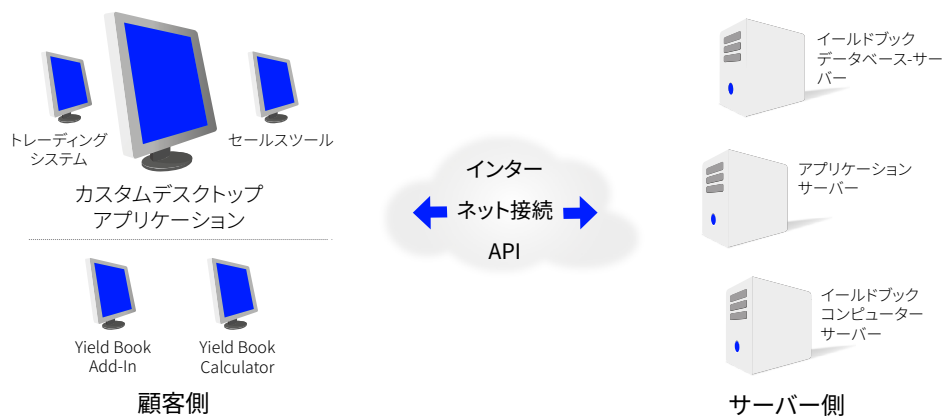
アナリティクス: 個別銘柄分析

インターフェース: ユーザーのアプリケーションに組み込み

レポート: ユーザー独自の表示形式でのレポート

データストレージ: ユーザーのアプリケーションへのデータ保存

インストレーション: 不要



出所: イールドブック。例示のみを目的としています。

Contact us

詳細については、Eメールで sales@yieldbook.com までお問い合わせいただくか、弊社ウェブサイト をご覧ください。: yieldbook.com

アメリカ +1 646 989 2200 | **アジア太平洋** +886 2 8729 5130

ヨーロッパ +44 20 7334 8963 **日本** +81 3 6441 1015

© 2023 London Stock Exchange Group plc and its applicable group undertakings (the “LSE Group”). All rights reserved.

“The Yield Book®” is a trademark and/or service mark owned or licensed by The Yield Book Inc., and all other trademarks and service marks used herein (whether registered or unregistered) are trademarks and/or service marks owned or licensed by the applicable member of the LSE Group or their respective licensors. Microsoft and Excel are trademarks of the Microsoft group of companies.

All information is provided for information purposes only. All information and data contained in this publication is obtained by the LSE Group, from sources believed by it to be accurate and reliable. Because of the possibility of human and mechanical error as well as other factors, however, such information and data is provided “as is” without warranty of any kind.

No member of the LSE Group nor their respective directors, officers, employees, partners or licensors make any claim, prediction, warranty or representation whatsoever, expressly or impliedly, either as to the accuracy, timeliness, completeness, merchantability of any information or of results to be obtained from the use of the Yield Book products, including but not limited to data and analytics or the fitness or suitability of the Yield Book products for any particular purpose to which they might be put. Any representation of historical data accessible through Yield Book products is provided for information purposes only and is not a reliable indicator of future performance.

No responsibility or liability can be accepted by any member of the LSE Group nor their respective directors, officers, employees, partners or licensors for (a) any loss or damage in whole or in part caused by, resulting from, or relating to any error (negligent or otherwise) or other circumstance involved in procuring, collecting, compiling, interpreting, analysing, editing, transcribing, transmitting, communicating or delivering any such information or data or from use of this document or links to this document or (b) any direct, indirect, special, consequential or incidental damages whatsoever, even if any member of the LSE Group is advised in advance of the possibility of such damages, resulting from the use of, or inability to use, such information.

No member of the LSE Group nor their respective directors, officers, employees, partners or licensors provide investment advice and nothing contained herein or accessible through Yield Book products, including statistical data and industry reports, should be taken as constituting financial or investment advice or a financial promotion. Past performance is no guarantee of future results. Charts and graphs are provided for illustrative purposes only.

This document may contain forward-looking assessments. These are based upon a number of assumptions concerning future conditions that ultimately may prove to be inaccurate. Such forward-looking assessments are subject to risks and uncertainties and may be affected by various factors that may cause actual results to differ materially. No member of the LSE Group nor their licensors assume any duty to and do not undertake to update forward-looking assessments.

No part of this information may be reproduced, stored in a retrieval system or transmitted in any form or by any means, electronic, mechanical, photocopying, recording or otherwise, without prior written permission of the applicable member of the LSE Group. Use and distribution of the LSE Group data requires a licence from Yield Book and/or their respective licensors.



LSEG DATA & ANALYTICS