

Post Trade Solutions | Optimise

リスクを低減。 資本を解放。

カウンターパーティリスクの最適化



LSEG

カウンターパーティリスクの最適化

Quantileのマルチラテラルカウンターパーティリスク最適化 サービスは、カウンターパーティリスク、資本要件、IMの ファンディングコストを削減します。

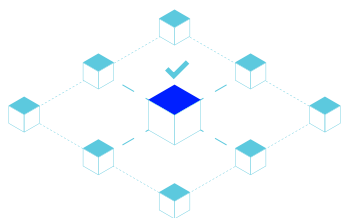
当社独自のアルゴリズムにより、SA-CCRとIMに基づく清算済み・未清算のIMとリスクベース資本を最適化します。

その手段として、参加者間の取引リスクを分析し、新しいマーケット リスクニュートラル取引でポートフォリオをリバランスすることにより、リスクを低減し資本を解放します。

1回の実行、1セットの制約、1つの予約プロセスによりマージンと資本を 同時に最適化することで、効率性をさらに高めます。Acadiaやその他の 業界パートナーとの連携も可能です。

当社の広範なネットワークは急速に拡大しており、世界トップレベルの グローバル銀行、各地域の銀行、その他の大手機関投資家がすべて含まれています。又、バイサイドの参加者を積極的にオンボーディングし、サービスを継続的に進化させ、ネットワーク全体での一層のコスト削減と 効率性向上を図っています。

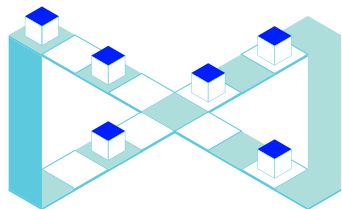
仕組み



データ提出と検証

参加者は、直接またはAcadiaを通じてデータをQuantileに提出し、リスクの制約を設定します。

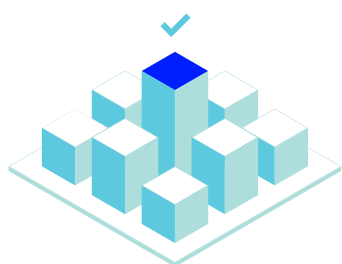
準備→実行→リバランス



リスク再構築プロポーザルの作成

当社は高速でインテリジェントな最適化エンジンを駆使し、新しいマーケットリスクニュートラル 取引のセットを含む提案を作成します。

準備→実行→リバランス



承認と実行

当社の最適化提案が参加者によって検証・承認されると、新規取引が予約されます。これによって、カウンターパーティリスク、資本要件、IMのファンディングコストを 削減できます。

準備→実行→リバランス

最適化の対象。

清算済みポートフォリオと未清算ポートフォリオの両方において、以下などの分野でカウンターパーティリスク、資本要件、IMのファンディングコストを削減できます：

- 為替
- 株式
- 金利

他社との違い



迅速。明快。無駄がない。

市場をリードする当社の サービスでは、1回の実行、1セットの制約、1つの予約 プロセスによってマージンと 資本を同時に最適化できます。



より効率的に、より少ないリスクを。

当社のプロセスは、リスクをLCH SwapAgentに連携する最初のもので、これにより、リスクをより効率的に保有し、ネットティングの機会を拡大し、必要資本を削減することができます。



市場をリード。革新的なサービス。

当社はお客様のニーズに応じて 進化し続けており、LCHとCMEにおけるFXや金利の複数CCP最適化を 実行できます。



変化に対応 先手を打って革新を起こす

当社は大きな成果につながる 最適化の機会を特定します。フレキシブルで客観的な機能により、規制の変化に合わせて 複数の資本モデルと指標に 対応できます。



卓越した成果。

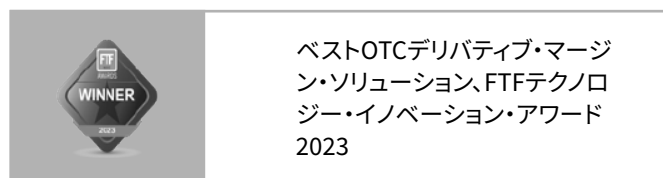
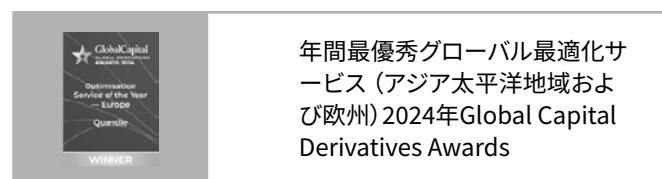
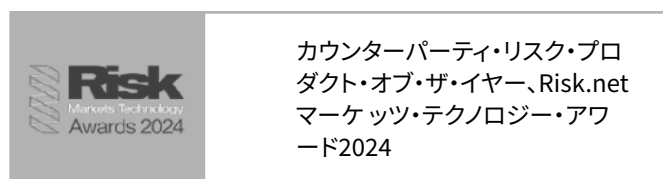
市場をリードする当社の サービスは、バイラテラルおよび清算ポートフォリオ全体にわたり、資本要件とマージンコストの 大幅な削減を実現します。多くの場合、削減幅は50%を超えます。



有能なチーム。独自の考え方。

ロンドン、ニューヨーク、アムステルダム、シドニー、東京(近日設立予定)のオフィス から、90人以上のチームが24時間体制でサポートします。

「信頼できる優れた」企業



Book a demo or contact us for more information.

Email contact_posttradesolutions@lseg.com

© 2025 LSEG. Reproduction or redistribution of LSEG content, including by framing or similar means, is prohibited without the prior written consent of LSEG. LSEG is not liable for any errors or delays in LSEG content, or for any actions taken in reliance on such content. LSEG logo is a trademark of LSEG and its affiliated companies.

lseg.com/en/post-trade/solutions

LSEG

Post Trade Solutions