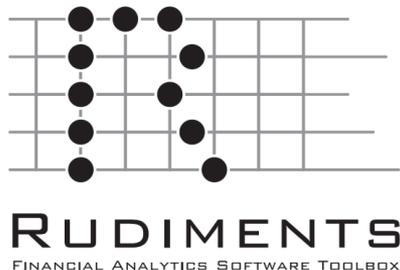


Introduction to “Rudiments”

金融工学計算ライブラリ「Rudiments」サービス体系

自社開発エンジン提供



- 大手行含めた複数行への導入実績あり
- CVA / LIBOR廃止のようなクリティカル・トピックに対応
- 自社開発のホワイトボックスで、ロジックについて詳細に回答可能
- 両端計算のような日本固有ルールに対応
- ライブラリ提供のため、サービス形態に合わせて柔軟に導入可能

保守 & コンサルサービス

- 日本拠点開発のため、日本時間・日本語での円滑なコミュニケーションが可能
- 新商品対応やロジック変更への相談も受け付け

コンサルティング・数値検証

- 外資系含む他社製品導入時のコンサルティングや数値検証を実施
- ロジックのみならず、業務・規制の有識者も在籍
- ブラックボックス・システムの数値検証実績あり
- 詳細な報告書やロジック資料、検証ツールを納品

対象機能

複雑なキャッシュフロー展開に対応

- 多様な日数計算、キャッシュフロー展開コンベンションに対応
- 手補正したキャッシュフローを取り込んだ計算も可能
- シンジケートローン・特殊融資のフィー計算にも対応

多様な商品に対するプライシング・ロジック

- 資金、為替、有価証券（株式 / 債券 / 仕組債）、デリバティブの主要商品を網羅
- マルチカーブ、LIBOR Market Model、リスク・フリー・レート参照ロジックにも対応

業務・規制に求められるポートフォリオのリスク評価

- VaR / ES算出、バックテスト、ストレステスト
- CVA / DVA算出

市場系以外でのモデル構築実績もあり

- 入出金データに基づくデフォルト予測モデル
- コア預金モデル、ローンプリペイメントモデル

導入方法

オンプレミス/クラウドなど環境に応じて柔軟に導入可能です。

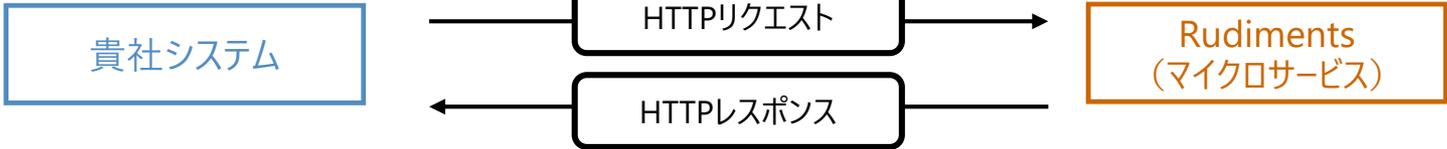
・DB/ファイル連携



・DLL呼び出し



・API連携



※開発言語：C#、 フレームワーク：.NET 6 / .NET Core 2.1 / .NET Framework 4.8

今後の展望

NEW

機能拡充

- XVAファミリー（FVA / CoIVA / KVA / MVA / …）
- CVA / DVAの誤方向リスクへの対応
- 業務の自動化、シミュレーション（自動ヘッジ取引生成、異常検知、リバース・ストレステスト）
- ESG、気候変動リスクへの対応

NEW

先端テクノロジーの導入

- 準モンテカルロ法によるシミュレーションの高速化
- データドリブン・アプローチ（Deep Learningのプライシング、キャリブレーション、XVAへの応用）
- 量子コンピューティング（最適化、モンテカルロ・シミュレーションへの適用）