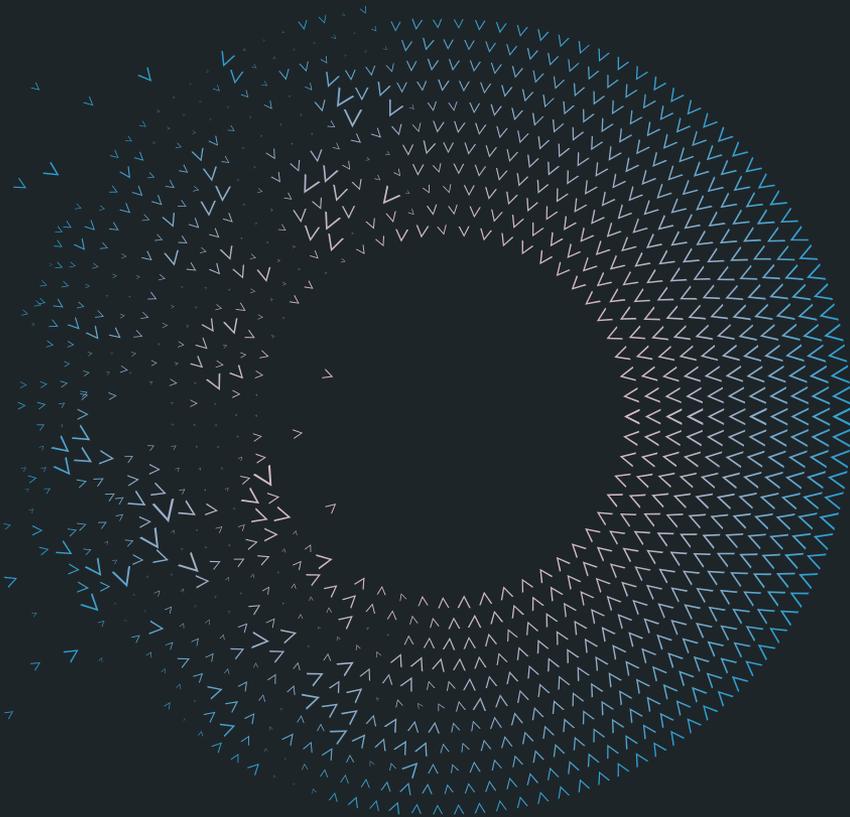


# リスクを低減。 資本を解放。

カウンターパーティリスクの最適化



## 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IMM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。

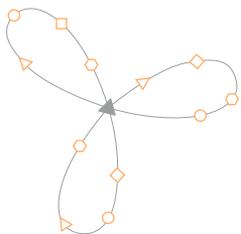
## 仕組み



### 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。

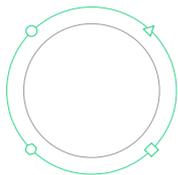
準備→実行→リバランス



### 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、ネットインの機会を拡大し、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、LOH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



カウンターパーティ・リスク・プロダクト・オブ・ザ・イヤー、Risk.net マーケッツ・テクノロジー・アワード2024



年間最優秀グローバル最適化サービス(アジア太平洋地域および欧州) 2024年Global Capital Derivatives Awards



ベストOTCデリバティブ・マージンソリューション、FTFテクノロジー・イノベーション・アワード2023



ISO 27017, ISO 27001 認証、AWS パートナーネットワーク セレクトテクノロジーパートナー

## 次回のラン、ぜひご参加ください

次回のカウンターパーティリスク最適化実行に参加して、Quantileのメリットをお確かめください。FXは毎週、金利は隔週、エクイティは毎月実行しています。

電話: +44 (0)203 917 7544(英国) | +1 929 526 4503(米国) | +31 (20) 399 7818(オランダ)

メール: [info@quantile.com](mailto:info@quantile.com)