



Quantifi クレジットデリバティブのスペシャリスト

Quantifi社は、グローバルのクレジット市場向けに最先端のモデル、プライシングツールやリスク分析を提供するリーダー企業です。当社の統合ソリューションは、市場で検証された中立的なプライシングとともに、市場にいち早く対応するという利点を提供します。

Advanced Tools for Credit Derivatives



Quantifi XL

Quantifi XLは、クレジットデリバティブ市場に最適なプライシングとストラクチャリングのためのツールです。パワフルかつ使いやすいエクセルアドインの機能とアプリケーションにより、プライシング、ストラクチャリングや感応度分析が実行できます。



Quantifi XLは、経過利息の計算から最先端のバスケットプライシングや感応度分析まですべてをカバーする数百の機能から構成されています。

アドインには、オンラインヘルプ、自習用教材やワークシートのサンプルが含まれており、それらをビルトインされたメニューに従って利用することにより、Quantifi XLを初めての方にも簡単かつ直観的に活用することができます。

Quantifi XLは、市場でテストを受け、承認されたモデルの広範かつオープンなライブラリーであるQuantifiツールキットを使って開発されています。このことにより、ユーザーが独自のモデルを構築したり、既存のモデルやデータと容易に統合できる、他に例を見ないパワフルかつ拡張性のあるプラットフォームを提供します。

Quantifi RISK

Quantifiリスクは、ストラクチャード・クレジット・プロダクトを対象にしたフロントオフィス用のプライシング、ヘッジ、リスク分析をキー操作で可能にするシステムです。

Quantifiリスクは、導入、利用、サポートが容易で、日々の評価やリスク分析のプロセスを自動化する管理と監査が可能な環境を提供します。取引や過去のマーケットデータ、リスク分析結果のデータベースが含まれています。

Quantifi XLと同じく、プライシングモデル、ストラクチャリングやリスク管理を通して、一貫性を維持できるように、Quantifiリスクも、Quantifiツールキットを利用して、構築されています。

広範な先進的な分析がサポートされており、スプレッド、コリレーション、回収率、デフォルトイベント、金利、為替レート、時間、キャリー、P&Lの複雑な感応度分析が含まれています。

Quantifiリスクは、効果的なクレジットリスク管理には極めて重要である広範なwhat-if分析を可能にする独自のシナリオ分析機能を利用し、様々なリスクレポートを提供できるように設計されています。



Quantifiリスクは、ウォールストリートの大手金融機関のために、ミッションクリティカルなリスク管理システムや独自のトレーディングシステムを構築した幅広い経験を持つプロフェッショナルチームによって設計、開発されています。

商品のカバー範囲

- CDO (IO, PO, ロングショート、変動、アモチ、固定回収率型を含む)
- CDS、債券、NTD、CDOスクエア
- クレジットインデックス (CDX/iTraxx)
- スワップ、キャップ・フロア、スワプション
- オプション (LCDS、LCDX、シンセティックCLO)
- ABS (ABCDs, ABX、CDO of ABCDs、TABX)
- エキゾチック (CMCDS、CPDO、リカバリースワップ、Quanto、ハイブリッド)

高度な機能

- 広範なポートフォリオヘッジと感応度分析
- 最新のベースコリレーションプライシングとヘッジテクニック
- 加重現在価値とバーベルコリレーションをブレンドした広範なビスポーク型のトランチプライシング
- CDSとCDOのカウンターパーティーリスク
- Markit社のデータ取り込み

広範なモデルライブラリー

- CDOとCDOスクエアのモンテカルロとセミアナリティックモデル
- ベース、ファクター、ペアワイズ、インダストリーコリレーション構造
- ローカル、リモート、グリッド分散型のプライシングと感応度分析

サポートしているプラットフォーム

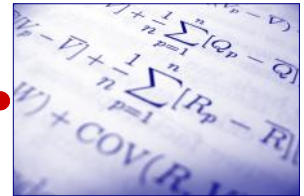
- ウィンドウズ2000/XP/Vista、リナックス、ソラリス
- Excel (2000/XP/2003/2007/2003サーバー)





Quantifi クレジットデリバティブのスペシャリスト

Advanced Tools for Credit Derivatives



Quantifi ツールキット

Quantifiツールキットは、現在利用可能な最速でもっとも正確なクレジットデリバティブのプライシングモデルのセットです。

ツールキットには、業界のベストプラクティスを我々独自のシングルファクター、マルチファクター分析とともに組み込んだ、市場でテストされ検証されたすべてのモデルが含まれています。

柔軟なオープンアーキテクチャーを利用して設計されていますので、Quantifiツールキットは、新しいモデルを市場に送り出す時間を劇的に削減し、既存の社内システムとシームレスに統合することを可能にする簡潔で拡張可能なインターフェースを提供します。

Quantifiツールキットは、スピードと正確さを高度に最適化した広範な金融と数学的ルーティンの基礎に立って構築されています。スレッドセーフで、使用手引き、参考文献、段階別の活用例を完備した文書が提供されます。

急速に発展するクレジット市場では、新商品をタイムリーにプライシングしサポートする能力が、成功のカギを握ります。Quantifiは、新しいモデルを市場に最初に送り出すことによって、ユーザーに業界の最新開発状況を知らせてきた確かな実績があります。

Quantifi トレーニング

Quantifiは、クレジットデリバティブについての、1日または2日間のトレーニングクラスを提供しています。プログラムは、市場、商品入門から最新の先端的アプリケーションまで、すべてをカバーしています。

Quantifi コンサルティング

Quantifiは、クレジットや債券のプライシング、リスク管理分野での豊富な経験を活かしたコンサルティングサービスも提供しています。

Quantifi Inc について

Quantifi社は、グローバルのクレジットデリバティブ市場向けに最先端のモデル、プライシングツールやリスク分析を提供するリーダー企業です。

当社の包括的に統合されたプロダクトやサービスは、高度なプライシングやリスク分析で業界標準となる高速、正確かつ革新的なソリューションを提供しています。

2002年の会社設立以降、世界中の何百というトレーダーが、複雑なクレジットデリバティブの取引前と取引後のプライシング、ストラクチャリングやリスク分析をするために、日々Quantifiを頼りにするようになっています。

当社の顧客には、北米、欧州、中東、アジアの銀行、ヘッジファンド、アセットマネジメント、保険会社といった活発な市場参加者が含まれています。

Quantifiの強みは、経験の深さ、広範な製品群、革新を遂げてきた実績、顧客と密接に協力しニーズにマッチしたソリューションを提供できる力にあります。

Japan

リッキーマーケットソリューション
〒100-0005 千代田区丸の内2-2-1
岸本ビル 10階
+813-3282-7721
Email: info@rickie-ms.com

Europe

St. Martins House
16 St. Martin's Le Grand
London, EC1A 4EN
+44 (0) 207 397 8788

North America

17 Union Place
Summit, NJ 07901
+1 908 273 9455

www.quantifisolutions.com

© 2008 Quantifi Inc. All Rights Reserved. Quantifi and the Quantifi logo are registered trademarks of Quantifi Inc. Other product names mentioned in this publication may be the trademarks or registered trademarks of their respective companies.

