

すでに市場リスク管理システムをご導入のお客様

■現状お使いのマーケットリスク管理システムにおけるモデルの検証や高度化を支援します。

現状モデルの特性の分析(理論)	現状システムで使っているモデルを理論面から分析します。分析対象は、各商品を評価するモデルと、ヒストリカルデータからリスクを算出する枠組みの2点です。分析の観点は、主に、モデルの前提の確認、前提の妥当性検討、前提が成立しない場合の影響分析などです。
現状モデルの特性の分析(データ分析)	実データを用いて、上記の分析を定量的に実施します。分析に用いるプログラムは、過去の研究やコンサルティングにおいて作成した資産を有効活用して、当社が作成します。
モデル高度化の方針検討	上記の分析結果に基づき、限られたコストで最も効果的のある項目について高度化の方針を検討します。
最新モデルの調査	主に、文献調査により、最新の市場リスク管理モデルを調査します。
新モデルの特性分析	上記で調査したモデルに関する特性を分析します。分析の観点は、モデルの前提やその妥当性、評価に必要なデータの入手コスト、システムにおける実装コスト・計算コストなどです。

新規に市場リスク管理システムの導入を検討中のお客様

■富士通グループでは、市場リスク管理システムとして「EVOLUO-RelationStage/マーケットリスク管理*」を販売しています。当社では、同システムの導入支援として、下表のような支援サービスを提供します。

マーケットリスク管理モデル講習会	RiskMetricsを中心として、マーケットリスク管理の理論をわかりやすく解説します。
モデル選定支援	分散共分散法、モンテカルロ法、ヒストリカル法など各種リスク計測モデルのトレードオフを踏まえモデルを選定するための支援を実施します。
商品評価方法検討支援	リスク対象とする各金融商品の評価方法の検討を支援します。

■システムのインストールやデータの移行などのシステム導入は、富士通グループの担当部門が実施します。

■導入後は運用支援として、下表のような支援サービスを提供します。

統合リスク管理への活用支援	リスク資本の割当やコスト控除後収益の算出など、統合リスク管理への活用方法検討を支援します。
アドバイザリコンサルティング	リスク管理モデルに関する各種質問にお答えします。当局からの質問への回答支援も実施します。

(*) 詳細は下記URLを参照してください。

<http://jp.fujitsu.com/group/fasol/services/c0103-ginko-875-rs-market-risk.html>