

平成 26 年 10 月 8 日

各 位

会 社 名 株式会社エクスネット  
代 表 者 名 代表取締役社長 茂谷 武彦  
(コード番号 4762 東証第一部)  
問 合 せ 先 管理本部チーフマネジャー 坪田浩司  
(TEL 03-5367-2201)

## 投信法改正「デリバティブ取引等に関わる投資規制」対応のリスク計測サービスを提供

株式会社エクスネット(東京都新宿区 代表取締役社長 茂谷武彦、以下「XNET」)は、2014年12月より施行される投信法の改正に伴う「デリバティブ取引等に関わる投資規制」への対応として、「XNETサービス」ご利用のお客様を対象に、オプション機能としてリスク計測サービス(サービス名:「IM デリバティブリスク計測」、以下 本サービス)を2014年10月より提供します。

本サービスは、他社の投信計理システムご利用のお客様であっても、当該機能に限定して「XNET サービス」を利用することが可能です。

投信ファンドにかかるデリバティブのリスク相当額を計測する手法として、以下の3つの方法が挙げられます。

- ① 簡便法
- ② 標準的手法(金融庁告示第59号第四条に準拠)
- ③ バリュアットリスク(VaR)方式

①は保有するデリバティブ資産がヘッジ目的時に限定される為、多くの投信委託会社様では②③の手法を選択することになると考えられます。また計測に関しては日々計測を行うことが求められます。

本サービスではデリバティブ取引のリスク計量について以下の対応を予定しています。

### [Point]

- ① XNET の投信計理サービス(IM バックサービス)をご利用頂いていない投信委託会社様も当該機能のみをスポットでご利用頂くことが可能です。  
(他社システムからのポジションデータをファイルアップロードするアプリケーションがございます。)
- ② リスクの状況を、お客様が必要とする形式で(プリント・ファイル・PDF ファイル)で出力することが可能です。
- ③ 計測方法は「標準的手法」と「バリュアットリスク方式」がございます。

#### (1) 標準的手法

「株式リスク相当額」「金利リスク相当額」「外国為替リスク相当額」「コモディティリスク相当額」を個別に計算し、リスク量を算出します。

また計算の過程を明確にするために、資産毎のリスク量表示も選択により可能です。

(2) バリュアットリスク方式

- ・分散共分散法を基軸に、VaR 計測、ストレス VaR を計測し、市場リスク相当額を計測します。
- ・VaR の計測方式(分散共分散法・ヒストリカル法)については、生損保様、投資顧問会社様で数多くの実績を重ねています。
- ・保有期間や乗数はユーザー様ごとに任意に設定することも可能です。

株式会社エックスネットについて

株式会社エックスネットは、「アプリケーションアウトソーシング事業」が日本ではまだ一般的に知られていなかった1991年に東京で創業しました。

「サービス」として業務アプリケーションを提供するビジネスモデルサービスを徹底的に追求し、すでに多くのお客様にご利用いただいています。

2004年には東京証券取引市場第一部に上場し、さらにサービスを拡大しながら、銀行を含む金融機関全般にユーザー層を広げています。

サービスに関するお問い合わせ先

投信計理担当:石澤・今村

Tel : 03-5367-2203

Fax : 03-5367-2215

E-mail : [xnet04@xnet.co.jp](mailto:xnet04@xnet.co.jp)