

報道関係各位

2008年2月20日

株式会社フィデッサ

三菱UFJ証券、フィデッサ・ブルーボックスによる アルゴリズム執行サービス導入の第1段階を完了

2008年2月20日 東京・ロンドン発 全金融資産取引対応のトレーディング・システムを運用会社及び証券会社双方に提供する株式会社フィデッサ(本社英国ロンドン、日本支社東京都千代田区、チーフ・エグゼクティブ: イアン・チルトン、以下フィデッサ)は本日、三菱UFJ証券株式会社(以下、三菱UFJ証券)が、フィデッサのアルゴリズム取引プラットフォーム「フィデッサ・ブルーボックス」を用いたアルゴリズム執行サービス導入の第1段階を無事に完了したことを発表しました。

2007年に発売されたフィデッサ・ブルーボックスは、OMS(注文管理システム)と完全に統合されたアルゴリズム執行プラットフォームです。市場標準のアルゴリズム執行戦略モデルの使用に加え、付属の戦略モデル開発ツールを使用することにより、証券会社独自の戦略モデルを容易に開発することができます。また、レイテンシーを最小化した市場データの配信および執行市場への接続といった周辺要素の統合を実現しており、アルゴリズム取引サービスに新規参入する証券会社に対し、費用対効果の高い、短期構築が可能なソリューションを提供します。

三菱UFJ証券の市場商品本部研究開発部長、新長義己氏は、「電子取引の拡大とトレーディング・テクノロジーの急速な発展に伴い、アルゴリズムエンジンの利用によって数多くの、より効果的な執行戦略が存在しています。最高の執行サービスでこれらの執行戦略へのニーズに対応することが当社の使命であり、アルゴリズム取引は顧客へのサービス提供において、必須の執行チャネルだと考えています」と述べています。

三菱UFJ証券は、短期的にはヘッジファンドをはじめとする海外のバイサイド、中期的には国内の資産運用会社からのアルゴリズム取引の発注需要拡大を見込んでいます。今回、アルゴリズム取引サービスの第1段階を完了したことにより、三菱UFJ証券は、トレーダー仲介による執行サービスとして、TWAP(時間加重平均価格モデル)と空売り戦略、及びそれらの併用戦略を顧客に提供できます。また、次の段階では、VWAP(出来高加重平均価格モデル)およびVolume-In-Line(ボリューム・インラインモデル)等も順次追加される予定です。

また、新長氏は次のように続けます。「市場へ参入するまでの時間は、当社にとって非常に重要な要素です。アルゴリズム執行機能を開発する上で問題となるのは、注文管理システムとのスムーズな連携です。当社は、フィデッサ・ブルーボックスを採用することにより、システム間の連携に伴う問題を解決し、プロジェクト始動から約3カ月でアルゴリズム取引サービスの第1段階を完了することができました。」

フィデッサのマーケティング統括部長 松原弘は、「2007年初頭の発売以来、当社のアルゴリズム取引プラットフォームは国内を含む世界中の有力証券会社に採用されています。市場での標準的アルゴリズムモデルを実装し、かつ顧客独自のモデルを迅速に開発できる環境を実現することで、ブルーボックスのユーザー企業は、ますます競争が激化する執行市場において、優位性を確保することができます。三菱UFJ証券が当社のブルーボックス導入により、アルゴリズム執行サービス導入の第一段階を完了されたことを、大変喜ばしく思います」と述べています。

新長氏は、最後に「当社のアルゴリズム執行サービス提供はまだまだ初期段階ですが、現在、自動取引機能の全般的な拡大に取り組んでおり、今後、当社独自の戦略モデルの開発を充実させていく予定です。ブルーボックス・フレームワーク上では、既成の戦略の適用だけでなく、当社独自のアルゴリズムモデルを開発し、実装することが可能なため、当社ならではの執行付加価値サービスを顧客に提供することができるものと考えています」とつけ加えています。

三菱 UFJ 証券株式会社

三菱 UFJ 証券は、三菱証券と UFJ つばさ証券の合併により発足しました。三菱 UFJ フィナンシャル・グループ (MUFG グループ) の中核証券会社として、有価証券の売買および引受、各種デリバティブ取引、M&A や資産の証券化に関わるアドバイスなど、幅広い業務を展開しています。証券・投資銀行業務のグローバル化を目指して、国内 119 の営業拠点に加え、欧州、米州、アジアの主要な都市に現地法人や駐在員事務所を配置し、国内外のお客さまにサービスを提供しています。

フィデッサ・グループについて

フィデッサ・グループは、全金融資産取引対応トレーディング・システム (OMS/EMS)、ポートフォリオ管理、投資意思決定支援、コンプライアンス管理、マーケットデータ、グローバルコネクティビティ (グローバル運用に適応したネットワーク接続) を包括する世界最高水準のトレーディング・ソリューションを提供しています。シンプルなワークステーションの形態から、個別の顧客要求に応じた統合型アプリケーションまで様々な形で提供が可能です。フィデッサおよびフィデッサ レイテントゼロは、フロントおよびミドルオフィス・ソリューションとして幅広い機能と広範なサービス領域を、セルサイド、バイサイドのあらゆる規模の顧客企業に提供するという理念のもとに構築されています。

現在、トレーディング・ソリューション、注文/発注管理システム、マーケットデータ、グローバルコネクティビティ (グローバル運用に適応したネットワーク接続) を提供しているフィデッサは、世界大手証券会社の 85% により使用されています。

また、フィデッサ・レイテントゼロは世界最大の資産運用会社やヘッジファンドにより使用され、包括的なポートフォリオ分析、モデリング、発注管理、事前/事後取引過程のコンプライアンス管理を司るソリューションをバイサイドに提供しています。

フィデッサのグローバル・ネットワークは、現在、月に 9,500 万件以上のメッセージを配信、約 1,500 のバイサイド企業、255 のブローカー、92 の取引所間の電子取引フローをカバーしています。

株式会社フィデッサについて

株式会社フィデッサは、2000 年 1 月にフィデッサ®を提供する英フィデッサ・グループ plc の日本法人として設立されました。フィデッサ・グループ plc は、1981 年の創立で、現在、ロンドン (本社)、サリー (英)、ニューヨーク、ボストン、東京、香港、パリ、トロントを拠点に、約 1,100 人の従業員を要し、1997 年よりロンドン証券取引所に上場しています。2007 年にレイテントゼロ社を買収しました。グループ全体の売上は、2 億 7,000 万ドルです。 <http://www.fidessa.com/JP>

【この件に関するお問い合わせ先】

株式会社フィデッサ マーケティング部 松原 弘 ・ 本橋 幸 電話: 03-4550-1000 (代)
株式会社バーソン・マーステラ 来島 一男 ・ 松元 涼子 電話: 03-3264-6701 (代)