

Markit 投資組合估值：CVA 計算服務

一項獨立、多方報價和經過驗證的風險計算托管服務

綜合全面的 CDS 資料、強大的托管估價平台，
以及屢獲嘉獎的 OTC 衍生商品模擬引擎。

國際會計準則《IFRS 13》自 2013 年 1 月 1 日起，已要求在評估 OTC 衍生商品公允價值時，須提交信用價值調整 (CVA) 和借記價值調整 (DVA) 報告。

審計團體和監管機關已加強審查 CVA 和 DVA 計算假設、方法論證和所採用市場數據的正確性和穩定性。目前業內的最佳實踐是使用以模擬為基礎的方法，以及通過交易對手 CDS 市場報價推論出的隱含違約機率，來代替以現值為基礎的簡化方法，以及以歷史數據估算的違約機率。

服務係完全托管、端對端解決方案，涵蓋市場數據來源、數據清理和儲存、低流動性交易對手信用曲線市場隱含估算、充分調整的定價模型之內部分析工具程式庫、屢獲嘉獎的模擬引擎，以及靈活的工作流程和設置工具。

綜合全面的信用數據

Markit CDS 所提供的數據範圍廣泛，包括基於共識價格創建的流動性較好交易對手之 CDS 曲線，以及通過嚴謹框架對流動性較低交易對手之 CDS 曲線進行市場隱含估算。

屢獲嘉獎的模擬引擎

屢獲嘉獎的 Markit 市場及信用風險模擬引擎分析工具，為 CVA 計算之基礎。Markit 分析工具已成功部署並協助全球各地諸多頂尖銀行計算 CVA。

跨資產涵蓋範圍

CVA 計算服務可應用於一系列 Markit 投資組合估值涵蓋下的跨資產類別的陽春型和複雜型工具

快速客戶上線和報告編制周期

新客戶投資組合將由經驗豐富的分析師在幾個星期內編製生產級別品質報告，為其上線做好準備。現有客戶可以利用交易對手資訊來補充其交易上傳資料，以獲得 CVA 報告。

公認的投資組合估值服務

Markit 健全的投資組合估值平台，提供跨資產、以盯市計算的衍生商品估值、橫跨全球各地上千檔基金的現金和複合證券，並提供 CVA 計算服務。用於估值的市場數據、報價和校準方法，與 CVA 計算無縫接軌並具一致性。

190 萬筆以上

每日 CDS 報價

2,600 支

CDS 實體

300,000 筆

OTC 和現貨部位的估值

470 萬以上

每個月獨立的估值

**SSAE16 類型 II
和 ISAE**

已審核的估值流程

客戶

審計人員
公司
基金管理人和托管機構
基金經理人
區域銀行

詳情

有關 Markit 的產品詳情和服務，請電郵至 sales@markit.com，或撥打任一地區的辦公室電話與我們連絡：

倫敦	+44 20 7260 2000
紐約	+1 212 931 4900
阿姆斯特丹	+31 20 50 25 800
波德市	+1 303 417 9999
達拉斯	+1 972 560 4420
法蘭克福	+49 69 299 868 100
香港	+852 3478 3948
東京	+81 3 6402 0130
多倫多	+1 416 777 4485
新加坡	+65 6922 4200
雪梨	+61 2 8076 1111

markit.com