

証券分野における潮流
- ISO20022/SWIFTの導入に向けて -

-SWIFT ビジネスフォーラム 2009-

平成21年7月8日

シティバンク銀行株式会社
グローバル・トランザクション・サービス本部
証券サービス部
古川 稔哉



シティバンク銀行のカストディ業務 ー従来ー

- ・ 主として、非居住の投資家、インベストメントバンクに対しサービスを提供
 - 比重の高いインベストメントバンクは、特に証券決済(クリアリング)を重視
 - 当行のカストディ業務は、決済件数の多さが特徴

- ・ SWIFTによるメッセージ標準化の重要性
 - 中心はMT54X
 - 限られた時間内で多数の決済を実行する為には、STP及びそれを可能とする標準化されたメッセージが不可欠

シティバンク銀行のカストディ業務 ー今後ー

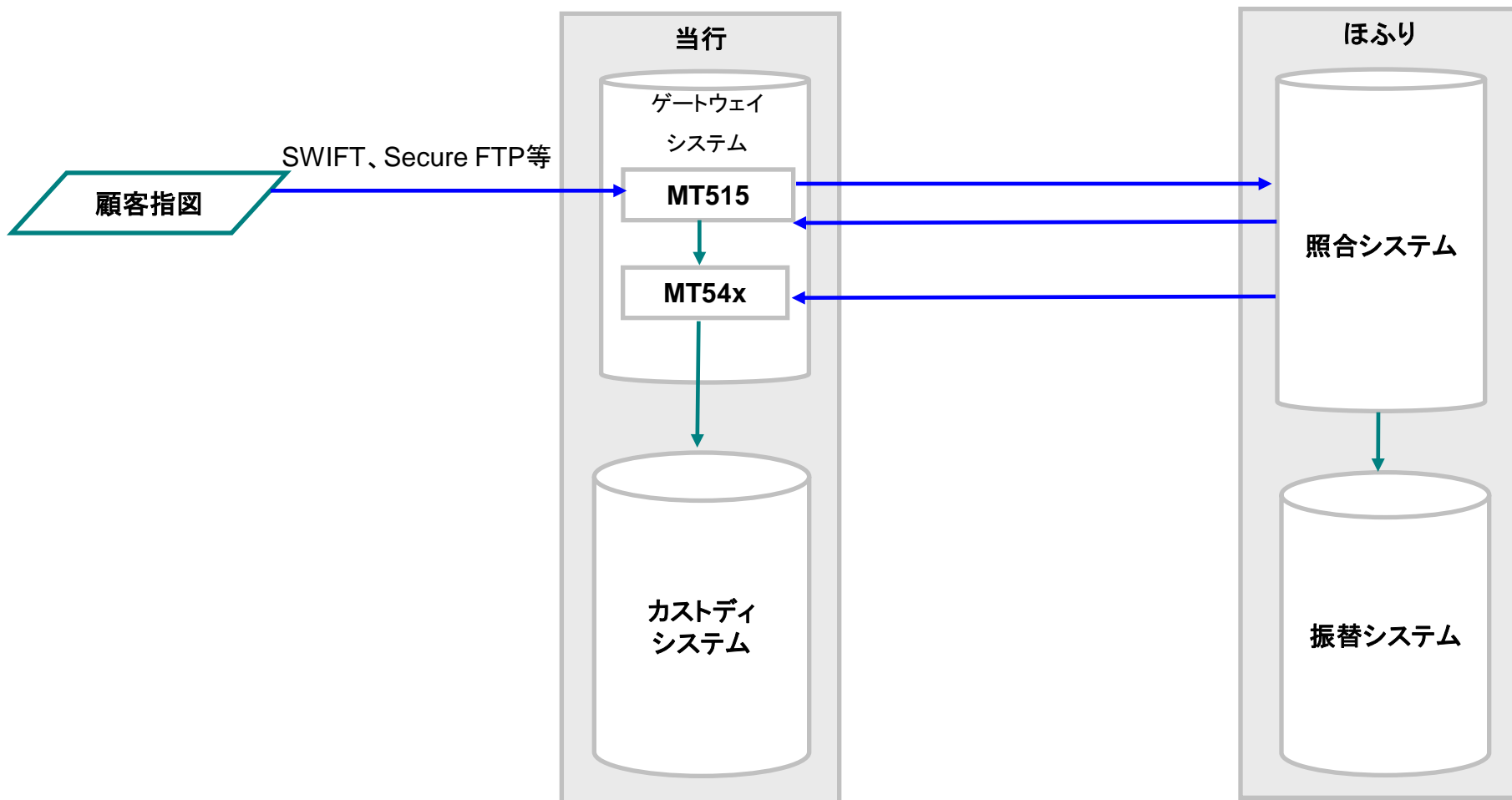
- ・ 対居住者サービス(特に証券決済)の拡充
 - 証券所取引(対日本証券クリアリング機構(JSCC)決済)
 - 国内株式取引(対ほふりクリアリング(JDCC)決済)
 - 国債取引(対日本国債清算機関(JGBCC)決済)
- ・ SWIFTによるメッセージ標準化の利便性
 - JDCC及びJGBCC決済においては、約定照合が必須(MT515)
 - 約定照合では、ISO15022に順ずるメッセージを使用するも、日本特有の部分も存在
 - 顧客⇔当行間のメッセージがSWIFTネットワークを通過できるよう、MT515等の使用を工夫

現行の約定照合データ例

決済情報ブロック		
43	決済情報ブロックの開始	:16R:SETDET
44	決済種類コード	:22F::SETR//TRAD
45	決済条件コード	
46	SSI無効化フラグコード	:17B::STAN//N

- ・ 17BはSWIFT標準メッセージにおいては、「コンファメーション情報ブロック」の項目
- ・ また、17Bは”Flag”を表示する項目ではあるが、”STAN”という用語は設定されていない
- ・ 従って、SWIFTネットワークを通す為には、工夫が必要

データフロー(国内株式取引)



今後に向けて

- ・ 決済照合システムへのISO20022/SWIFTNet導入検討に引き続き参画
 - 決済照合システム(非居住者取引)が当面の課題
 - 国内取引、特に約定照合のISO20022化が実現すれば、SWIFTネットワークを通す為の負担が軽減される

- ・ SWIFT参加者の拡大に期待
 - 現在、SWIFT未加盟顧客とのデータ送受信は、様々(Secure FTP等)
 - 複数の変換プログラムの維持・管理からの解放
 - より高品質のサービスを、より良い価格で提供することが可能に

内国歳入庁通達230号に関する開示：シティグループ・インク及びその関係会社は、税務又は法律に関する助言を提供しておりません。本資料に含まれる税務に関する内容は、(i) 貴社の追徴課税回避を目的として、若しくはかかる目的に使用されることを意図して記載されておらず、かつ、貴社において租税回避目的で使用若しくは依拠することが出来るものではなく、また(ii) 本資料記載の案件（以下「本案件」という）の「プロモーションおよびマーケティング」の一環として記載されたものであることがあります。従いまして、独立した税務の専門家から、貴社の状況に応じた助言をお受け下さい。

本案件に関する情報及び諸条件は、協議の対象として提示されているにとどまり、本案件に関して別途作成される最終的な契約書類に規定される確定条件に従うものとします。本プレゼンテーション資料は、弊社による本案件への参画、又は第三者による参画に向けた弊社のアレンジメントの約束、ならびにそのような約束の準備、交渉、若しくは実現に関する合意となるものではありません。弊社は、いかなる場合であっても貴社との信任・委任関係に立つものではありません。貴社は、本プレゼンテーション資料の受領をもって本案件の存在及び諸条件（本案件に関する具体的なライシング情報及び本案件に関連して弊社又は第三者に支払われる報酬に関する情報を含むがこれに限られない。）の機密性を保持することに合意します。本プレゼンテーション資料の他の規定にかかわらず、本案件に関する協議の開始より後、本案件の如何なる参加者も本案件に関する米国税務上の取扱い及び仕組みを開示することを制限されません。

貴社は本案件の実行に先立ち、弊社又は弊社の関係会社に依拠することなく、本案件の経済的リスクとメリット、ならびに法的・税務上・会計上の特性及び影響を検証し、貴社がかかるリスク等に耐えうるかを独自に判断しなければなりません。この点、貴社は、本資料の受領をもって以下の点について認識している旨を確認します。(a) 弊社が法務・税務・会計に関する助言を与えることをその業務としていないこと（及び貴社がそのような助言を弊社に求めないこと）、(b) 本案件につき、法律・税務・会計上のリスクが存在する可能性があること、(c) 貴社が独自に法務・税務・会計に関する適切な助言を別途専門家より受け、且つ、当該助言に依拠すべきこと、及び(d) 貴社が貴社の経営陣に対して、本案件に関する法務・税務・会計に関する助言（及び本案件に関連するあらゆるリスク）、ならびにかかる事項に関して弊社が責任を負わないことを知らせるべきこと。

弊社は、弊社と取引を頂くお客様に本人確認のために情報の取得、照合及び記録を義務付けられています。従いまして、貴社の正式名称、住所、納税者番号を始めとして、確認のために登記簿謄本その他の各種書類又は証明書をご提出頂くことがあります。

本資料中の価格又はレベルは当初の仮の条件として提示させていただくものであり、買値または売値となるものではありません。かかる仮条件は、あくまでも貴社の便宜・参考のためにご用意させていただいたものであり、事前に通知することなく適宜変更され得る性質のものであり、いかなる商品の購入又は販売に関する勧誘をも目的にしたものではないにご留意下さい。本プレゼンテーション資料に含まれる情報はその実現が不確定な将来の潜在的な事由を表象する数量モデルからの分析結果を含む場合があり、商品を代表するすべての重要な事実の完全な分析ではありません。本プレゼンテーション資料に含まれる予想は、現時点での弊社の判断によるものですが、通知なしに変更される場合があります。弊社や弊社の関係会社では、他の顧客のため及び自己勘定においてこれらの商品のマーケット・メイクを行なう場合があり、従いまして、かかる商品につき適宜ポジションを有することがあります。

本資料には、シティのコーポレート・ボンド・リサーチ、債券ストラテジー又は経済・市場調査グループが公表した情報が含まれている場合がありますが、シティのポリシーでは、(i) 従業員が、直接又は間接に取引又は報酬の対価又は誘引として、肯定的若しくは否定的なリサーチオピニオンを示し、又はオピニオンの変更を申し出ること、及び(ii) リサーチレポートに記載される特定の推奨又は見解に対してアナリストが報酬を受け取ることを禁じております。かかる利益の相反の可能性を低くするため、または利益の相反と見なされる機会を少なくするため、シティは、特定の状況において投資銀行部門とリサーチ部門の従業員間のコミュニケーションを制限するポリシーを施行しております。

〔シティバンク銀行株式会社と日興シティグループ証券株式会社の合同ピッチを伴うピッチ・マテリアルのためのディスクレマー文言〕

シティバンク銀行株式会社（以下「シティバンク」という）及び日興シティグループ証券株式会社を含むその関係会社は、日本国の銀行業または証券業に適用ある規則に定められている拘束条件付取引の禁止等の弊害防止措置に関する規定を遵守しております。従いまして、シティバンクは、日興シティグループ証券株式会社を含む証券業を営む関係会社から提供させていただく商品又はサービスをご購入いただくことを条件として貴社に商品又は金融サービスを提供したり、またはその条件を変更することはありません。

〔商標承認：該当する法人について適切な承認を使用すること〕

© 2008 日興シティグループ証券株式会社。金融庁によって監督及び規制を受ける法人。無断複写・転載を禁じます。

© 2008 シティバンク銀行株式会社。金融庁によって監督及び規制を受ける法人。無断複写・転載を禁じます。「シティ」及び「Citiと赤い円弧」の意匠は、Citigroup Inc.又はその関係会社の商標及びサービス・マークであり、世界中で使用・登録されています。

© 2008 シティグループ・グローバル・マーケット・インク。SIPCメンバー。無断複写・転載を禁じます。「シティ」及び「Citiと赤い円弧」の意匠は、Citigroup Inc.又はその関係会社の商標及びサービス・マークであり、世界中で使用・登録されています。

© 2008 シティグループ・グローバル・マーケット・リミテッド。英国金融庁によって監督及び規制を受ける法人。無断複写・転載を禁じます。「シティ」及び「Citiと赤い円弧」の意匠は、Citigroup Inc.又はその関係会社の商標及びサービス・マークであり、世界中で使用・登録されています。

2007年1月、シティはアメリカの金融機関としては初めて気候変動に関する見解を表明する声明文を発表しました。シティは、金融業界の継続的發展に関して指導的立場にある者として、気候変動という重要な課題に関して以下のような具体的な方策を取ることを決定しました。それらの方策とは(a)問題解決に向けて、代替エネルギーやクリーン・テクノロジーの開発、その他二酸化炭素排出削減など、気候変動を抑制する努力に対する投融資額の顕著な引き上げを行うことなどにより、向こう十年間に渡って500億ドルの支出を目指すこと。(b) 2011年までにシティが全世界で保有し又は賃貸している施設から排出される、温室効果の元凶となるガスの量を10%削減する努力を行うこと。(c) 2006年度中に、地球温暖化を促進しない(すなわち二酸化炭素を排出しない)発電手段による電力を5万2千メガ・ワット・アワー以上調達すること。(d) 民間セクターでの資本投資を再使用が可能なエネルギーやクリーン・テクノロジーの開発に向けて、持続可能性のある開発のための投資(SDI)を行うこと。(e) 再使用可能なエネルギーの開発・企画を目的とする投融資関連サービスを顧客に提供すること。(f) 気候問題に連携した投資調査業務を確立し、投資家にこの問題に関わるリスクと可能性に関わる情報を与えること。そして、(g) 幅広いステーク・ホルダーと共に、気候変動の問題に関する理解を深め問題解決の糸口を探る一助を担う責任を負うことなどです。

シティは温室効果に深い関わりをもつ業界の顧客らと、気候変動が及ぼすリスクを評価し、可能な範囲においてかかるリスクを軽減する方策を見極めるべく協働します。

効率、再使用可能なエネルギー、エネルギー削減