



SWIFTが提供する ファンドソリューション

2008年12月17日

SWIFT Japan

藤村 和久

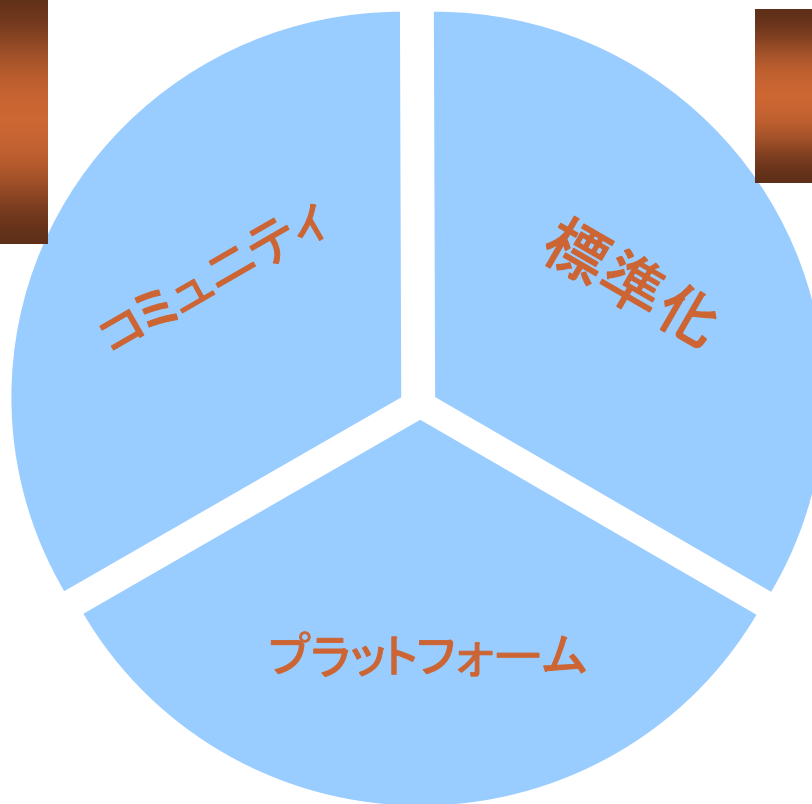
ご説明項目

- **SWIFTについて**
- **SWIFTのファンドソリューション**
- **ファンドメッセージ**
- **ヘッジファンド業務への対応**
- **業界の対応**
- **ファンド講習会**

SWIFTについて

SWIFTサービスの基盤

金融業界の
協同組合団体
ユーザーが出資者
本部はベルギー



金融業界の
標準化推進母体

高度に安全な
金融情報メッセージサービスを
安価に提供



SWIFT の現状 (2008年10月末現在)

年間32億件メッセージ

8,721ユーザー

209ヶ国

1日平均15.3百万メッセージ

ピーク日 17.9 百万メッセージ(2008年10月15日)

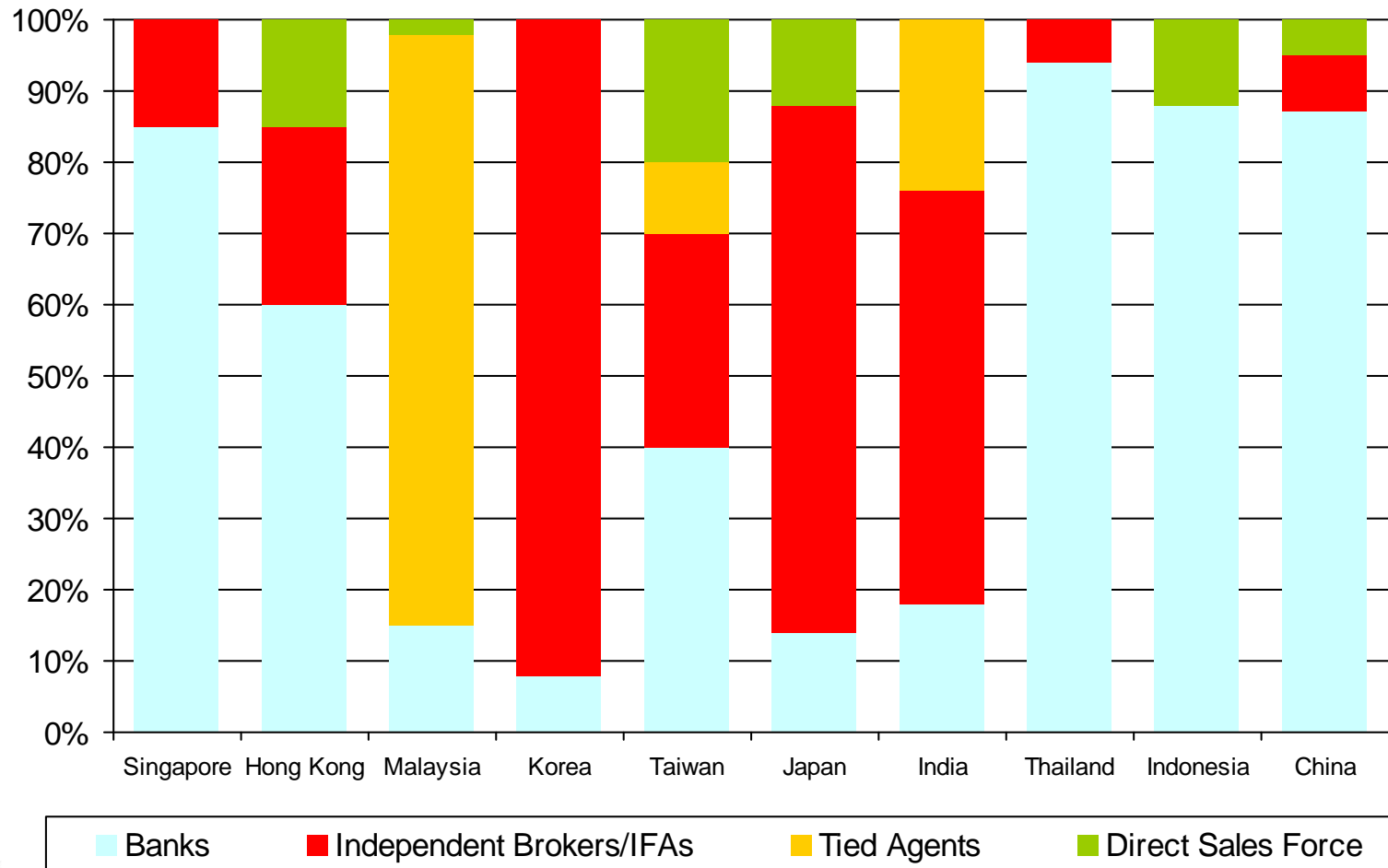


SWIFTのファンドソリューション



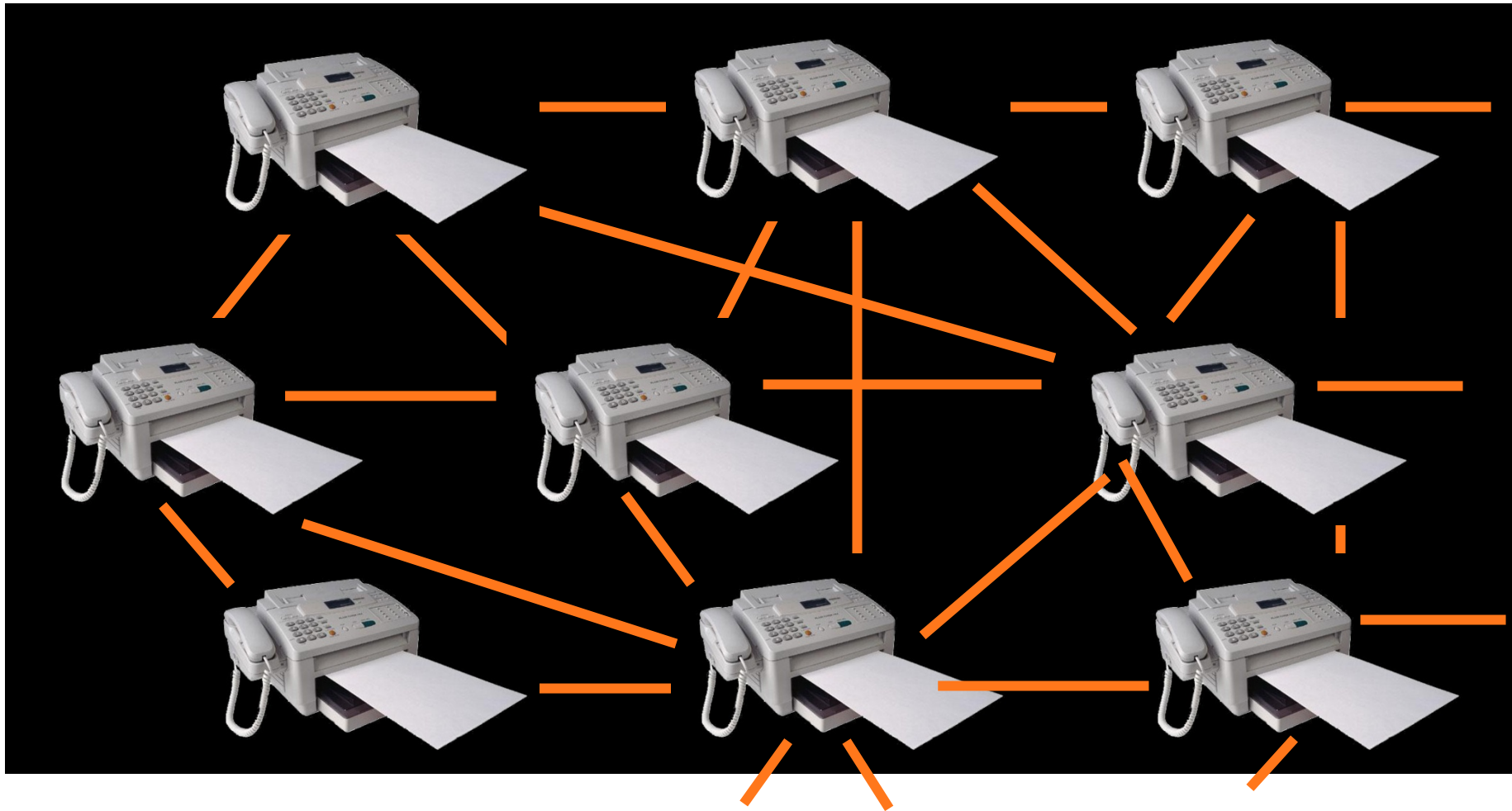
アジアで拡大する外国籍ファンド販売

Mutual Funds - Distribution Channel Mix Across Asia



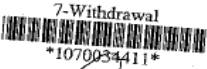
ファンド・オペレーションの世界


海外取引相手とのFax, Fax , Fax



ファンドの設定・解約・発注・コンファメーション

- Faxによるマニュアル処理





ABC
 Financial
 Group

ENTERED
 08 AUG 2006
AUTHORISED

Australian Office
 PO Box 001
 Sydney
 Telephone (02) 8000 8000
 Fax (02) 8000 8001

To: Australian Investments Australia Limited
 Attention: Unit Registry
 Fax no: 1300 755 712
 From: One Person/A N Other

Date: 7 August 2006
 Time: 1:58 PM
 No of Pages Incl. Cover:
 Telephone: (02) 8000 8000

 *** TX REPORT ***

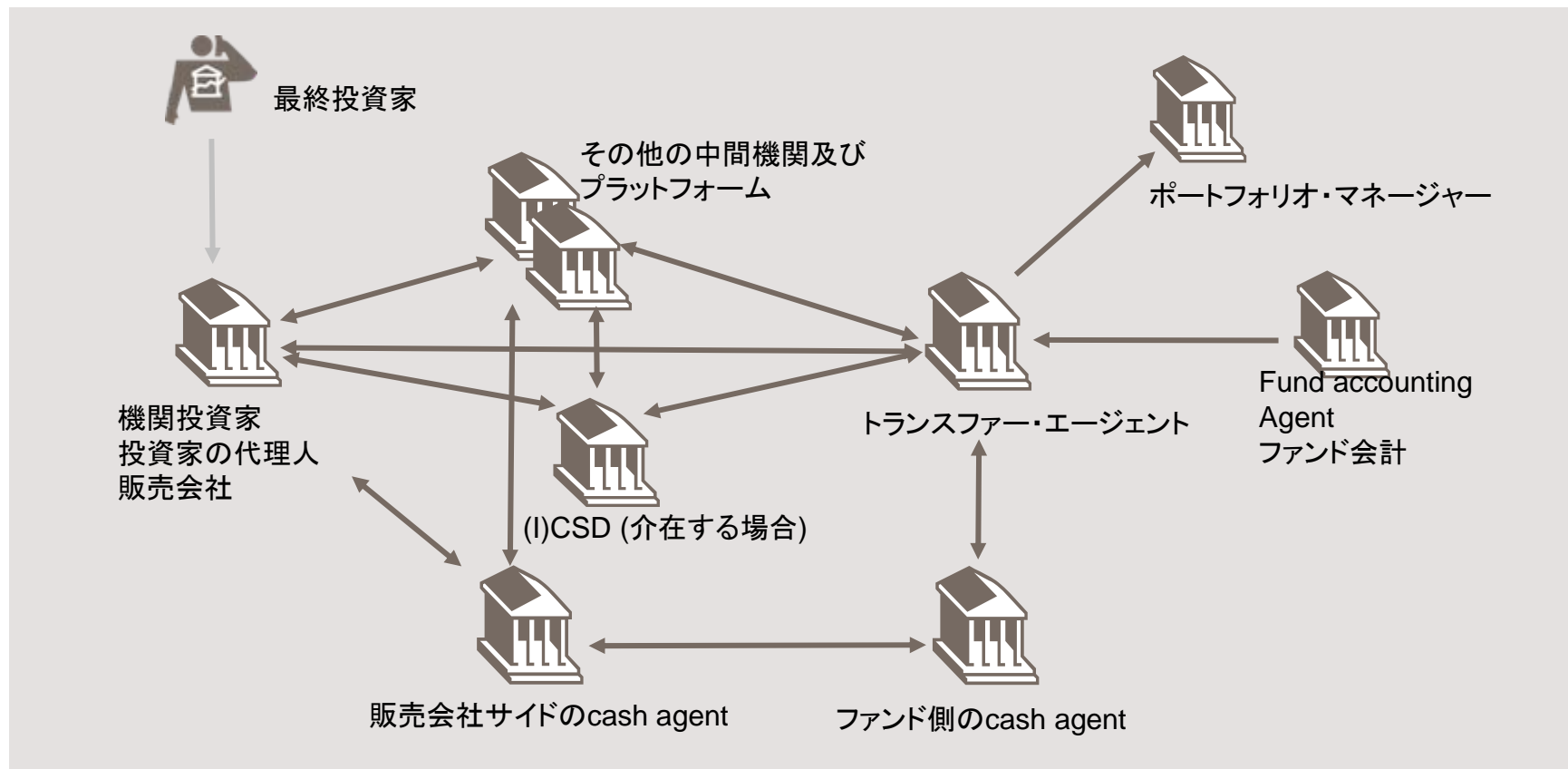
TRANSMISSION OK

TX/RX NO 4563
 CONNECTION TEL
 SUBADDRESS
 CONNECTION ID
 ST. TIME 12/08 17:23
 USAGE T 00'28
 PGS. SENT 1
 RESULT OK



ファンド事務の自動化へのソリューション

SWIFTによる自動化が可能なフロー

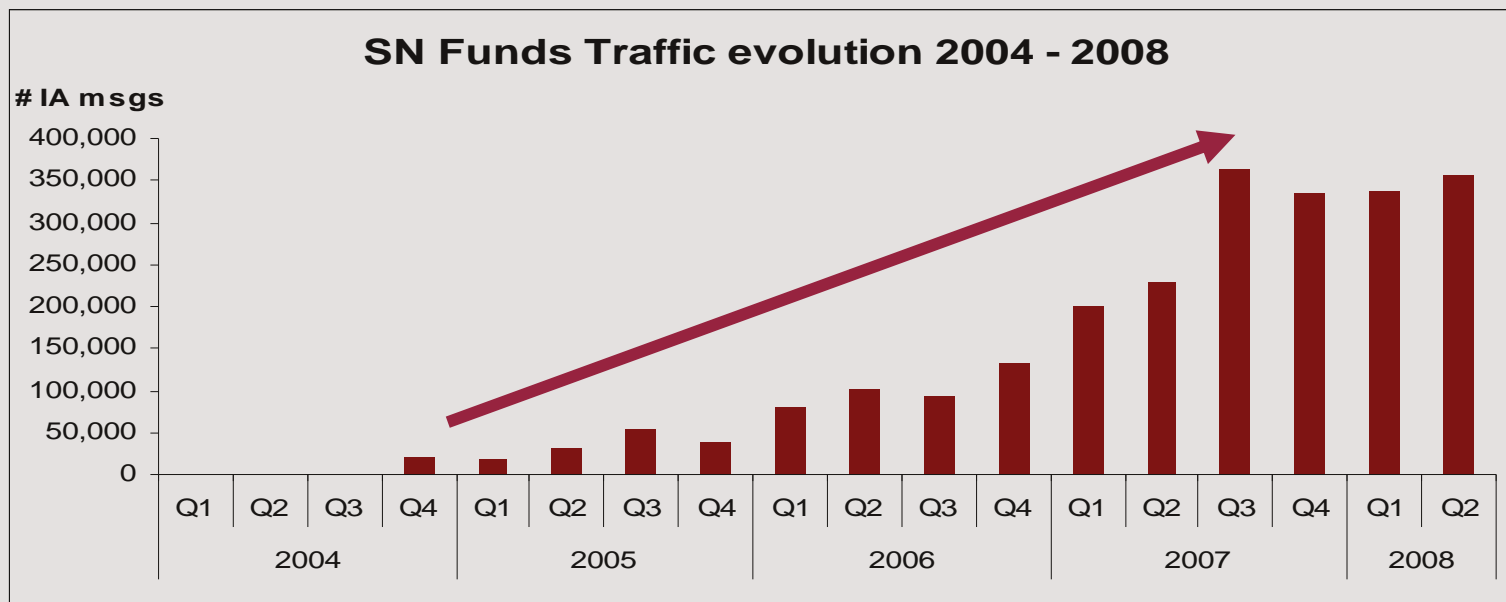


設定・解約注文関連、決済、残高通知、NAVレポート、移管、口座開設、予定資金流入、コーポレート・アクション、ファンド関連資金移動、近くFPP

Fundsソリューション(ISO20022)の普及拡大

- 2007年に比して54%の伸率(2008年)
- 51のライビューザー
- 新規7ユーザー(2008年)
- 20の新規テストユーザー(2008年)
- 年末までで2百万のISO20022 Funds MXsメッセージ予想

2008



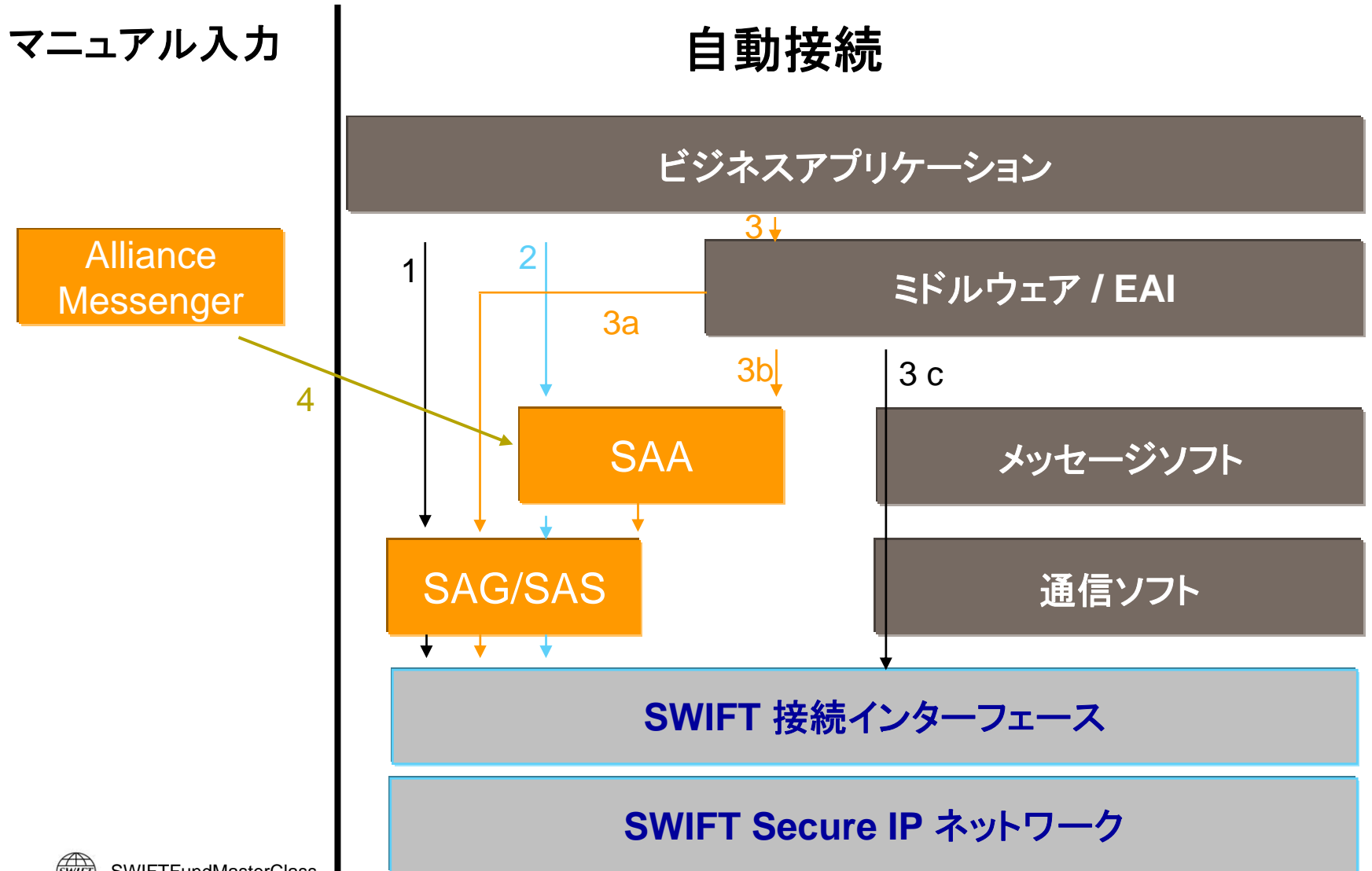
ファンド業務フロー・メッセージ・タイプ (ISO 20022 MX)

ライブ・実装済み	追加予定のメッセージ
<ul style="list-style-type: none">• 口座管理(acmt MX)• 設定・解約注文、その状況及び確認 (setr MX)• NAVレポート (reda MX)• 予定資金流入 (camt MX)• ユニットの移管(setr MX)• 再登録-英国(setr MX)• 残高通知(semb MX)• 注文執行履歴 (semb MX)• Fund Passport Platform (Live Q1 09)	<ul style="list-style-type: none">• 販売手数料レポート• 総資産評価レポート (G/L, MT535,536,537,950,NAV等を統合して提供)• その他ステートメント？• その他業務フロー？

* UNIFI (ISO 20022) specifications



ネットワーク接続への選択肢



Alliance Messenger Version 6.0画面イメージ

SWIFT Alliance Messenger Help Logout
You are logged in as: Kemal on SAA (beim0467)

Create Messages

03 - setr.004.001 - Redemption Order V03

Header Application Header **Body** Comments

OrderReference

ClientReference

OrderType **Min Occ.: 0** **Max Occ.: 10** **Created: 0** New Occ. ⌵

FinancialInstrumentDetails ⌵

Identification ⌵

ISIN ⓘ

Name

SupplementaryIdentification

ClassType

SecuritiesForm

DistributionPolicy

ProductGroup

SubAccountForHolding

⌵

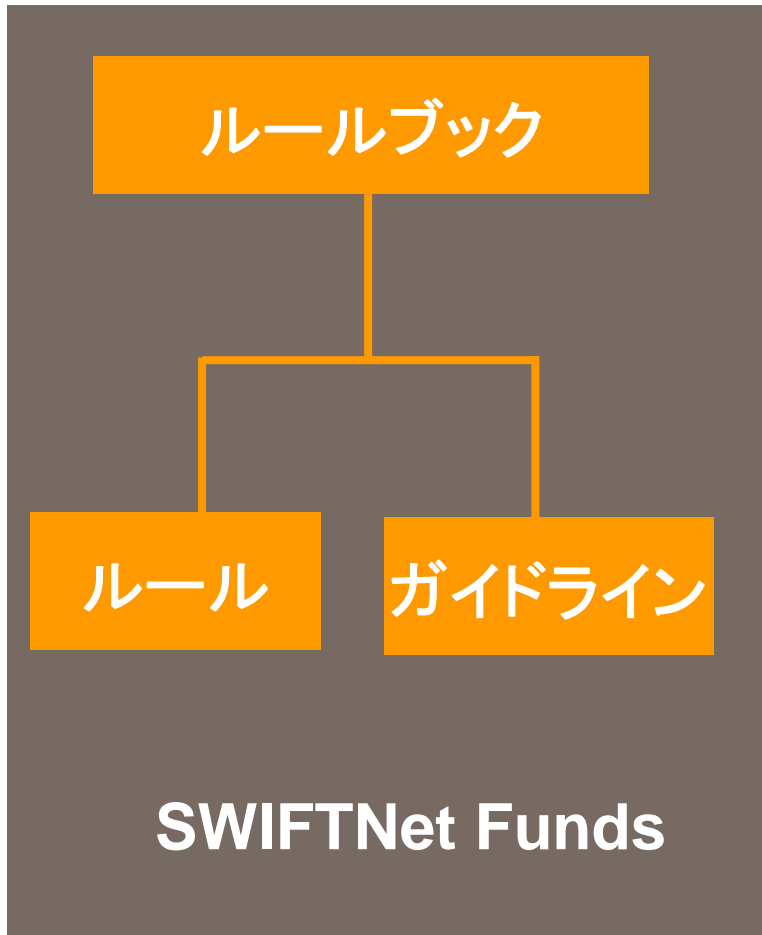
Unit

Rounding

Close Message Print Details... Save as Template... Validate Route Dispose to ⌵

SWIFTNet ファンドのルールブック

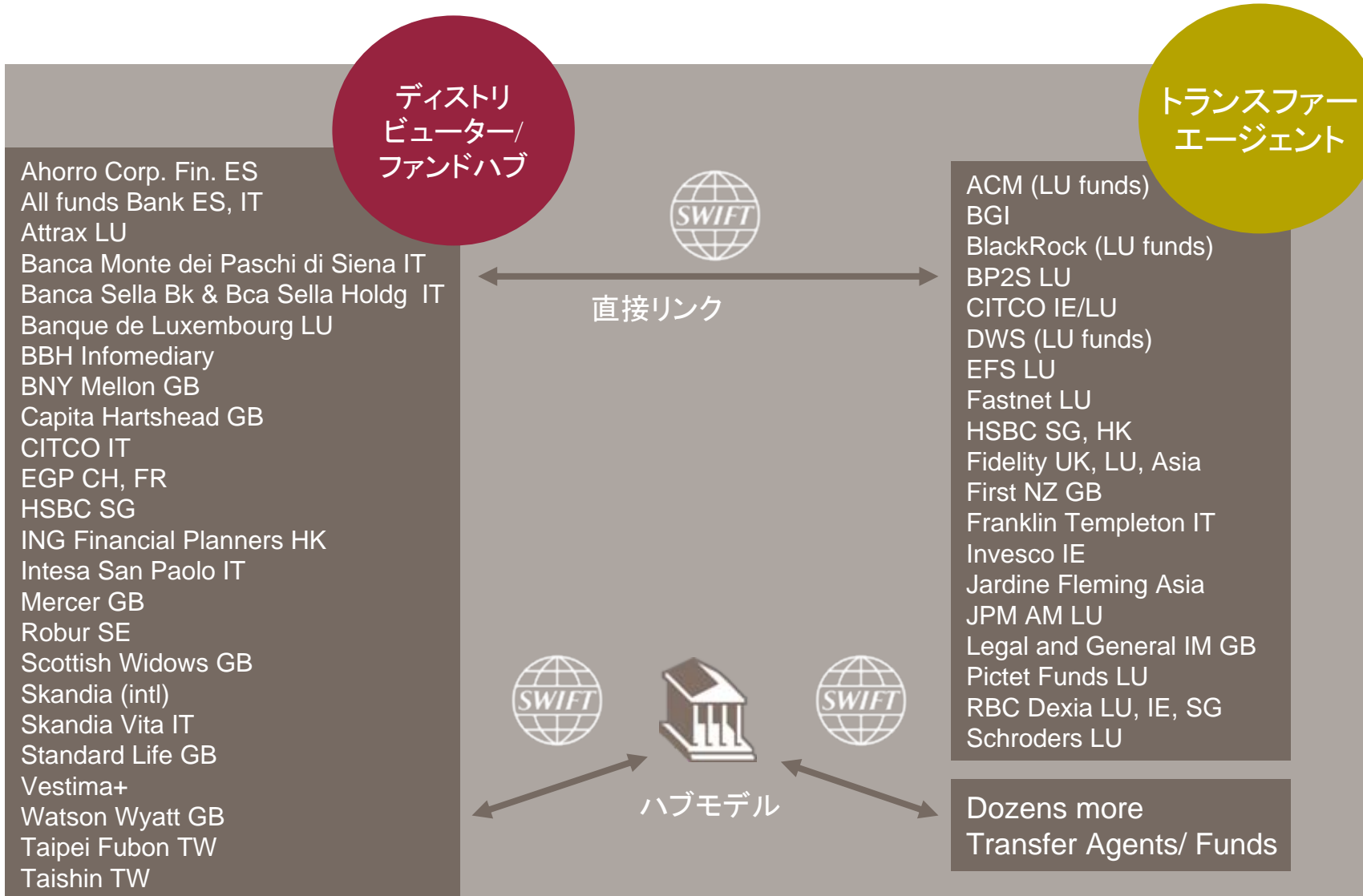
ルールブックによる市場慣行推進



ルールブック

- 標準化を補完する機能
- ベストプラクティスの推奨:
業務工程の統合調和
- SWIFTNet上でのFunds ユーザー
のメッセージ・データ利用の運用方法を
明示
- 将来的な市場慣行はルールブック上
に明記する

ファンドソリューション – 51ライブユーザー



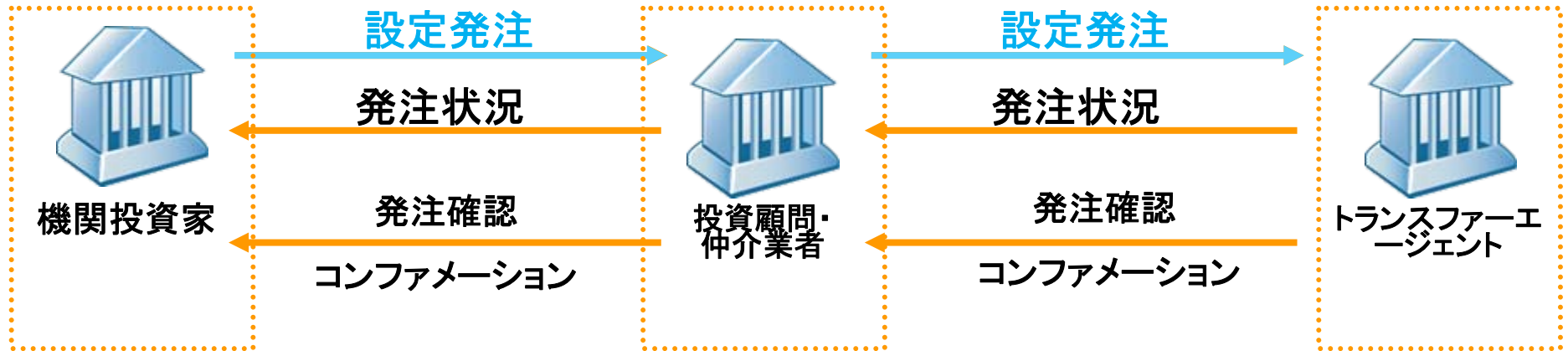
ファンドメッセージ仕様



発注及び関連メッセージ



ファンド
経理会社



発注関連メッセージ



投資顧問

設定発注: 主要項目

- 1対他の発注を1メッセージで対応
- 金融商品の特定、口座情報
- 受益者(投資家)明細
- 金融商品の数量の表示: ユニット、金額、資産内割合(%)等
- 資金決済明細: 決済日、金額、支払い方法
- 受け渡し手段明細、決済明細、保管カストディ明細
- 税金、手数料、チャージ明細

発注メッセージ

設定発注

Subscription Order

バルク設定発注

Subscription BulkOrder

トランスファーエージェント宛ての
ファンド設定発注指示メッセージ

解約指示

Redemption Order

バルク解約指示

Redemption Bulk Order

トランスファーエージェント宛ての
ファンド解約指示メッセージ

スイッチ指示

Switch Order

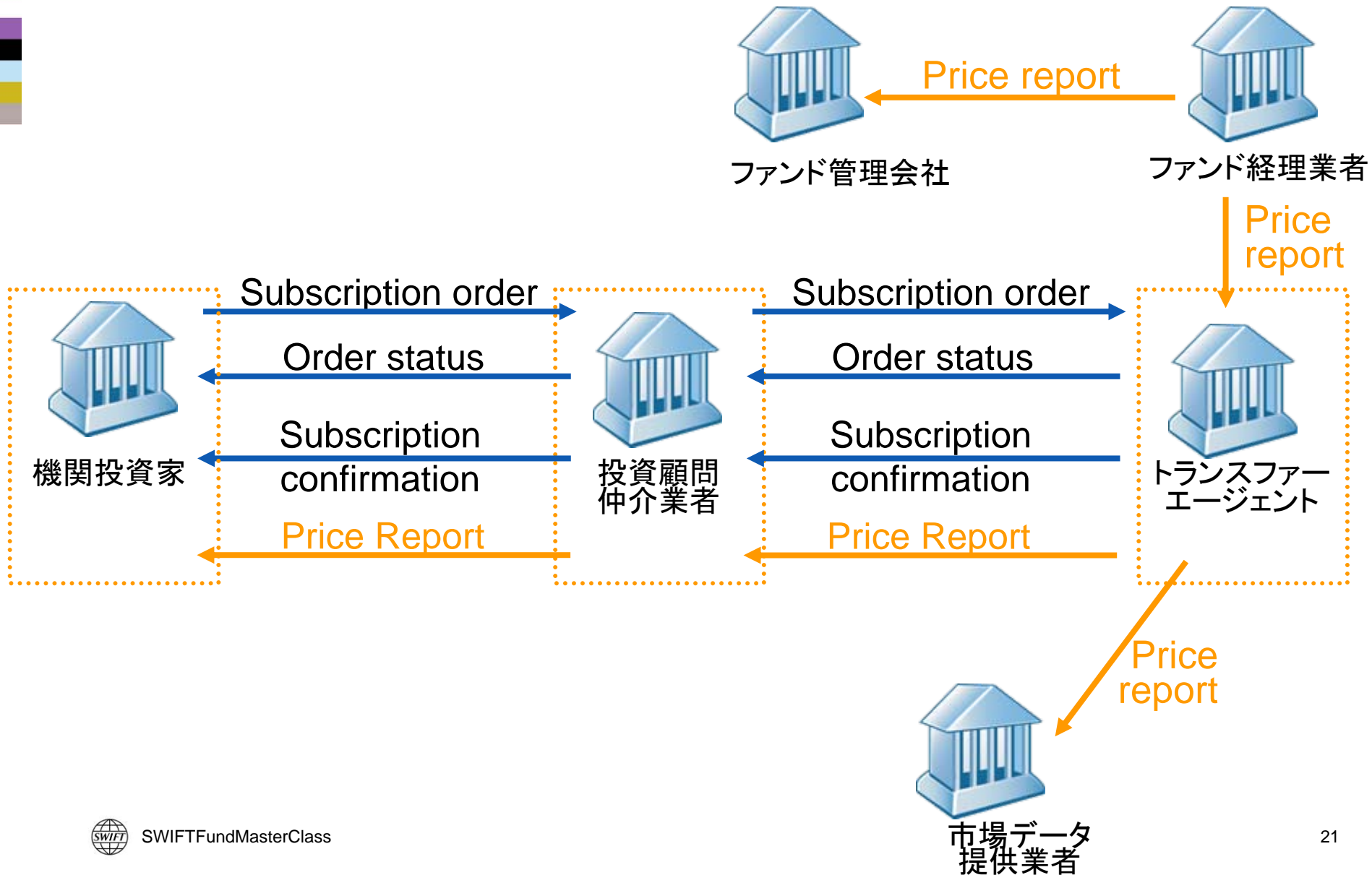
トランスファーエージェント宛ての
ファンド切り替え(スイッチ)指示
メッセージ



設定発注コンファメーション (Subscription Order Confirmation): 主要項目

- 関連レファレンス Related Reference (オプション)
- デールレファレンス Deal Reference (必須)
- ユニット数 Units Number (必須) / ネット金額 Net Amount (オプション)
- トレード日 Trade Date (必須)
- 価格明細 Price Details (必須)
- 分割実行表示 Partially Ececuted Indicator
- リファンド・設定利息 Refund and Subscription Interest

価格レポート: メッセージフロー



価格レポート (Price Report): 主要項目

- 基準価格、売・買い価格 NAV, Bid/Offer, 等 (価格基準につき 10 のオプション)
- 時系列および先物価格 Historic & Forward pricing
- 税金、手数料明細 Tax & charge details
- 評価統計 Valuation Statistics

- 価格レポートキャンセル Price Report Cancellation
- 価格レポート訂正 Price Report Correction

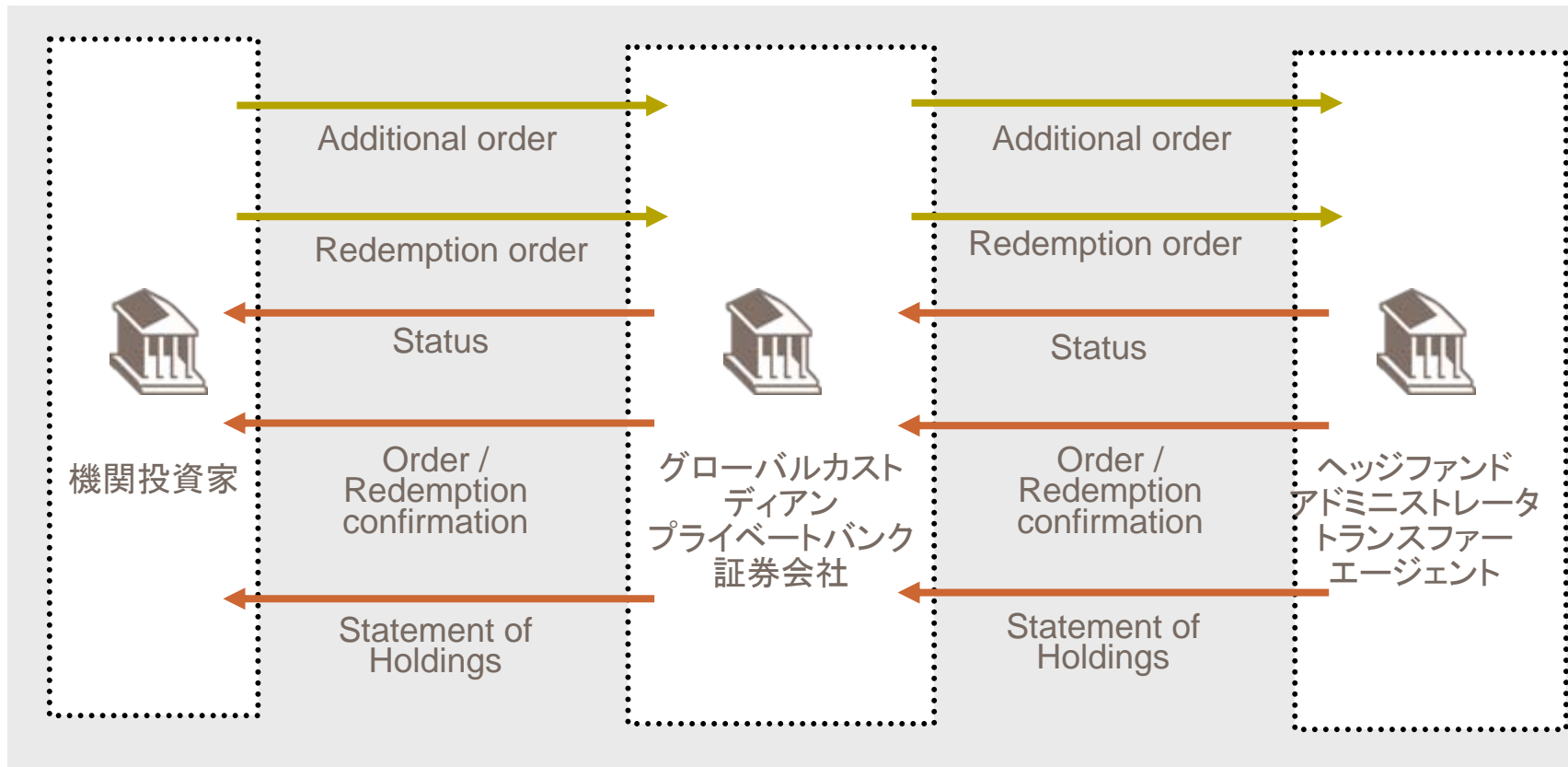
ヘッジファンド業務への対応



ヘッジファンド業務の自動化・ソリューションの拡大 Hedge Fund Groupによる検討活動

- 主要ヘッジファンドアドミニストレーターのグループ (SHARP Group) 各社によるヘッジファンド業務への標準化メッセージの検討、
- ISO20022Fundメッセージ仕様をベースとしたヘッジファンド向けのメッセージ仕様、主要データ項目の検討。メッセージ仕様の再利用または、新規メッセージ仕様、データ項目の策定。
- ヘッジファンド業務の市場慣行の検証、書面化。

メッセージフロー



Phase 2: 初回設定申込, トランスファー, スイッチ, コーポレートアクション

業界ベースの活動



ISO 20022を中心としたスタンダード・市場慣行 業務慣行の統合

- EFAMA, SMPG
- SWIFT Standards Working Group
- 欧州 - National Working Groups: UK, Luxembourg (ALFI, TA Forum), France, Germany, Switzerland, Italy
- 米州: USA (DTCC, ICI), Canada (FundServ)
- アジア - Industry Groups: Australia, Singapore (FA-UPC), Hong Kong, 日本, Taiwan



日本・アジアにおける業界との協働

Singapore: Investment Management Association of Singapore

SWIFT signs Fund Industry MoU promoting automation in Singapore

Adoption of ISO 20022 standards viewed as key to Singapore's competitive positioning

Published on 12 February 2007



From left to the right, Andrew Kwek, Chairman, e-Finance Services Technical Committee, IDA ; V. Giri Mudeliar, Executive Director, Investment Management Association of Singapore and Eric Chua, Head of SWIFTNet Funds, Asia

In support of Invest Singapore's 2010 vision to create a first class operational environment, SWIFT signed a Memorandum of Understanding (MoU) on Monday 30 January with the Investment Management Association of Singapore (IMAS) and the Singapore government's e-Finance Services Technical Committee, Infocomm Development Authority of Singapore (IDA).

The purpose of the MoU is to promote the local fund industry's adoption of ISO 20022 XML based standards for automated processing.

"Singapore's vision is to be known as the Asian hub for the fund industry, just like Dublin and Luxembourg are in Europe," commented V. Giri Mudeliar, Executive Director, Investment Management Association of Singapore. "In order to achieve that status, we must as an industry strive for the risk reduction and cost-savings benefits derived from fund automation."

The MoU was signed at SWIFT's third annual Fund Processing Automation Conference attended by over 180 representatives from banks, fund managers, transfer agents and

custodians.



Hong Kong:ファンド業界活動

The Asia Fund Automation Consortium (AFAC)

Memorandum of Understanding

Between

**Fidelity Investments Management (Hong Kong) Limited, JF Asset Management Limited,
INVESCO Hong Kong Limited, BlackRock (Hong Kong) Limited,
AllianceBernstein Investments, Franklin Templeton Investments (Asia) Limited, and
Schroder Investment Management (Hong Kong) Limited**

In order to promote the Straight Through Processing (STP) initiative within the Asia Pacific fund management industry, Fidelity Investments Management (Hong Kong) Limited, JF Asset Management Limited, INVESCO Hong Kong Limited, BlackRock (Hong Kong) Limited, AllianceBernstein Investments, Franklin Templeton Investments (Asia) Limited and Schroder Investment Management (Hong Kong) Limited have mutually agreed as follows:

In the spirit of good-will and cooperation, to work towards the following general objectives:

- Participation in the Asia Fund Automation Consortium (AFAC)
- Participation in regular working group meetings
- Driving the STP initiatives within the Asia Pacific fund management industry by defining a common STP strategy for each country
- Working alongside distributors to achieve automation
- Recommending to distributors throughout Asia Pacific automation solutions with a consistent approach that can be anticipated to be re-used across the majority of fund providers
- Agreeing on common formats, standards and routes for automation of funds messaging to simplify implementation
- Recommending a standard format to be used for each market within Asia Pacific


ALLIANCEBERNSTEIN



BLACKROCK
MERRILL LYNCH
INVESTMENT MANAGERS



滙豐投資管理
HSBC Investments



 Investec
Asset Management
天達資產管理



 Schroders
寶源投資管理(香港)有限公司



SWIFT FundMasterClass

ファンド講習会



ファンド講習 (Investment Funds) - ISO 20022 メッセージ

2009年5月開催予定

投資信託取引のSWIFTソリューションの概略、取引フローにおけるISO20022のメッセージ使い方、ケーススタディを交えてISO20022メッセージ作成、解釈方法の解説

<コース内容>

- SWIFTソリューションの投資信託取引メッセージ送受信フロー
プレイヤーなどの概略
- SWIFT standards 概念: variants, version, naming, FINメッセージとの共存
- SWIFT standards Message Reference Guide の使用方法
- メッセージ使用方法、機能、主に以下の例をケーススタディ
 - 投資信託注文、状況
 - 基準価格報告書
 - キャッシュフォーキャスト
 - ステートメント
 - 口座管理
 - 投資信託と資金決済の一連の取引
- Funds導入プランニング



日本におけるSWIFT講習

基礎編

Basics Your Passport to SWIFT

SWIFT Community, SWIFTが提供しているサービス、セキュリティ
Message Standards (FIN, XML ユーザーハンドブックの見方), カスタマーサービス

顧客送金、資金決済

Payments using FIN messages

顧客 シリアル送金、カバー送金、金融機関資金決済、自行口座資金管理

証券決済照合

Securities Settlement and Reconciliation using ISO 15022 messages

証券決済指図、コンファメーション、決済状況の通知、証券口座ステートメント

コーポレートアクション

Corporate Actions using ISO 15022 messages

コーポレートアクション通知、指示、コンファメーション、状況と処理内容の通知





ご清聴ありがとうございました

お問い合わせ
スイフトジャパン

藤村 和久
03-5223-7401
kazuhisa.fujimura@swift.com

