
業務システム SWIFT活用事例

2009年10月30日

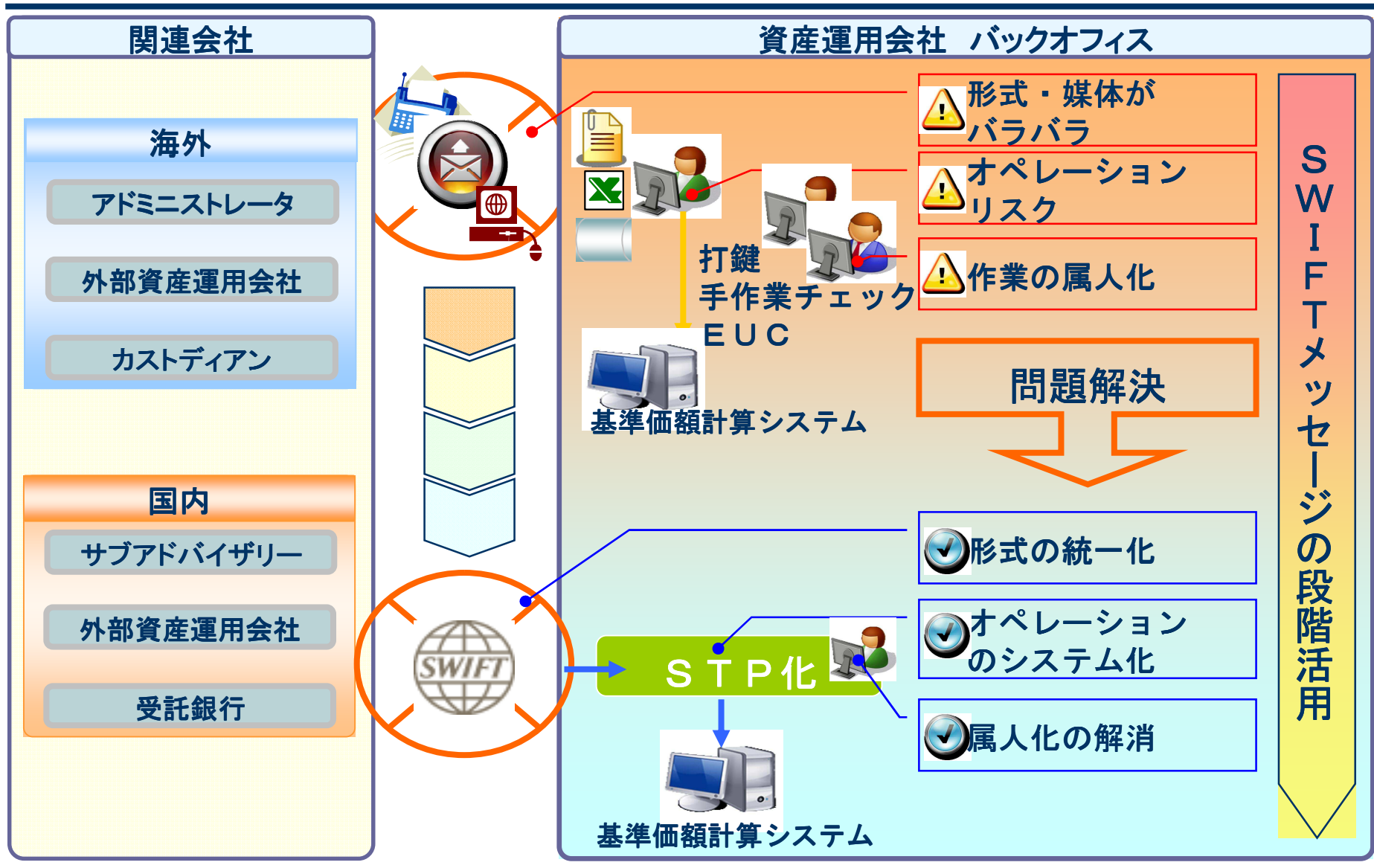


株式会社 パワーソリューションズ

目次

1. 資産運用会社を取り巻く環境(関係会社/各種データ受領)
 - 1.1 全体像
2. 資産運用会社向けSWIFTメッセージの活用
 - 2.1 約定関連メッセージ
 - パターン① 外部委託先からの受信
 - パターン② 外部委託元への送信
 - パターン③ 販売会社からの受信
 - 2.2 決済指図
 - パターン④ 受託銀行への送信
 - 2.3 NAV・残高情報
 - パターン⑤ 外部ファンド運用会社からの受信 1
 - パターン⑥ 外部ファンド運用会社からの受信 2
 - パターン⑦ 地方銀行への送信

1. 資産運用会社を取り巻く環境(関係会社／各種データ受領)



2. 資産運用会社向けSWIFTメッセージの活用

【約定関連メッセージ】

- ① 外部委託先からの受信
【約定管理機能】 【属性管理機能】
【基準価額計算システム連携ファイル作成機能】
- ② 外部委託元への送信
【基準価額計算システムシステムからの情報取得】
【属性管理機能】
- ③ ブローカーからの受信
【照合機能】

【決済指図】

- ④ 受託銀行への送信
【指図書作成機能】

【NAV・残高情報】

- ⑤ 外部ファンド運用会社からの受信 1
【NAVの取得機能】
- ⑥ 外部ファンド運用会社からの受信 2
【ルックスルー銘柄情報の取得】
BASEL II 対応 Funds対応 ディスクロ対応
- ⑦ 地方銀行への送信
【基準価額管理システムからの情報取得】 BASEL II 対応



2. 資産運用会社向けSWIFTメッセージの活用

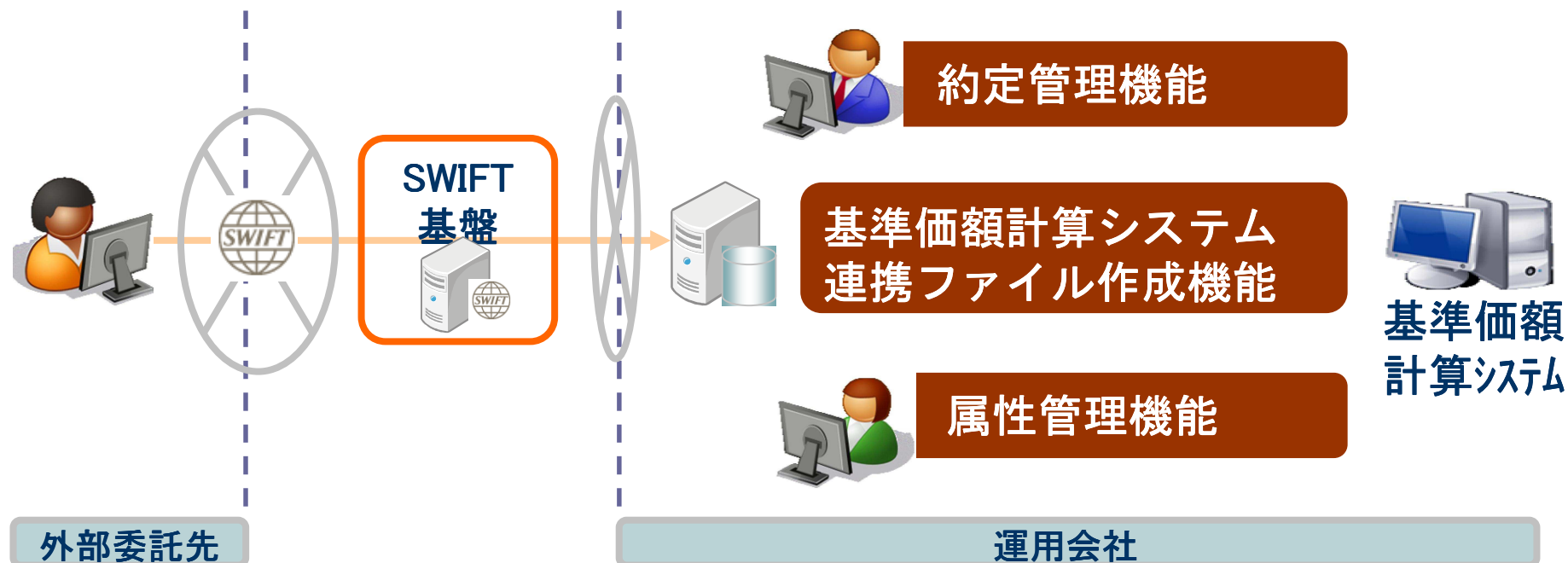
【約定関連メッセージ】

①外部委託先からの受信

【約定管理機能】：約定登録/修正 その他情報の取込む。

【属性管理機能】：銘柄属性情報の登録/修正する。

【基準価額計算システム連携ファイル作成機能】



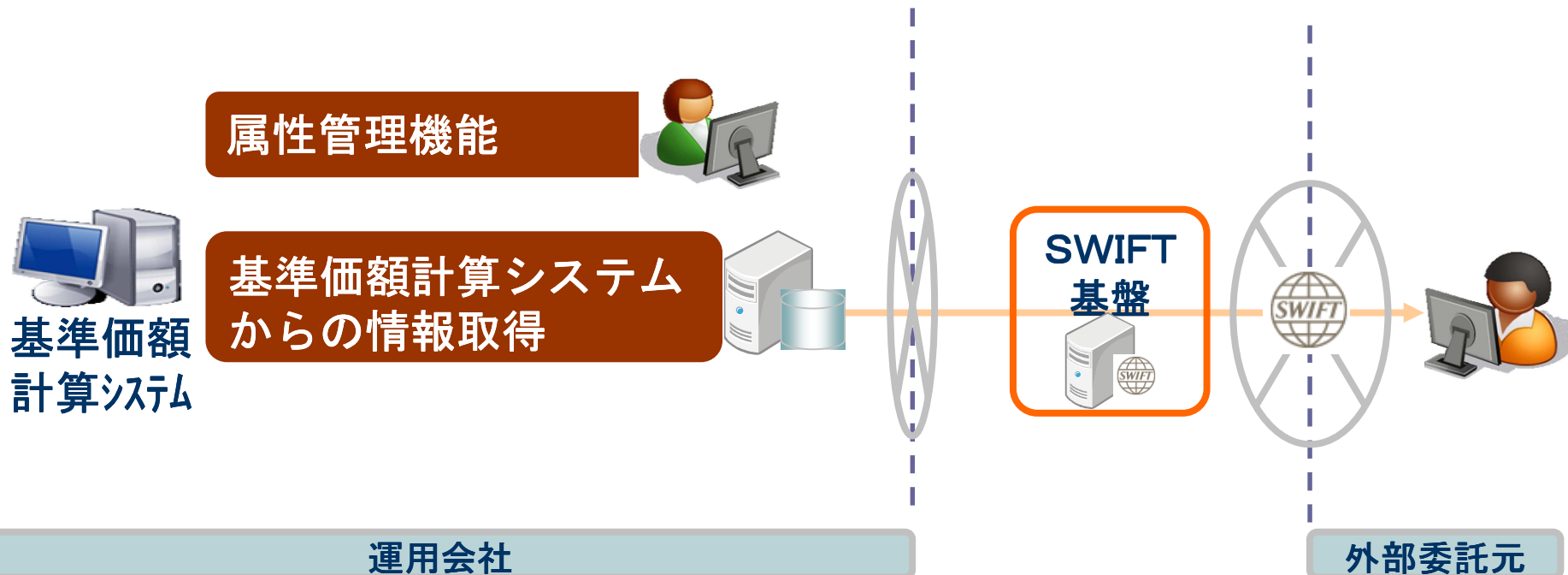
2. 資産運用会社向けSWIFTメッセージの活用

【約定関連メッセージ】

②外部委託元への送信

【基準価額計算システムからの情報取得】

【属性管理機能】：銘柄属性情報の登録/修正する。



2. 資産運用会社向けSWIFTメッセージの活用

【約定関連メッセージ】

③ ブローカーからの売買報告受信

【照合機能】

: ブローカーから受信した売買報告(コンファメーション)と①で受信した約定情報を照合する。



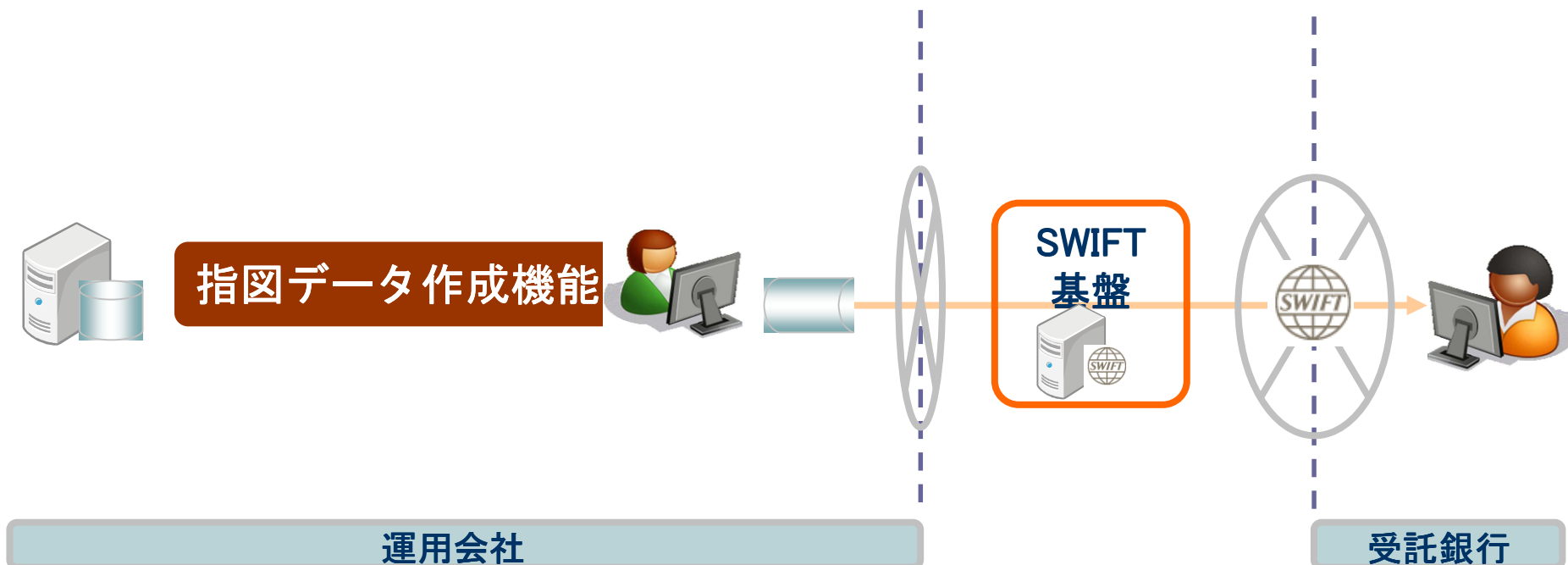
2. 資産運用会社向けSWIFTメッセージの活用

【決済指図】

④受託銀行への送信

【指図データ作成機能】

: 約定情報から指図データを作成する。



2. 資産運用会社向けSWIFTメッセージの活用

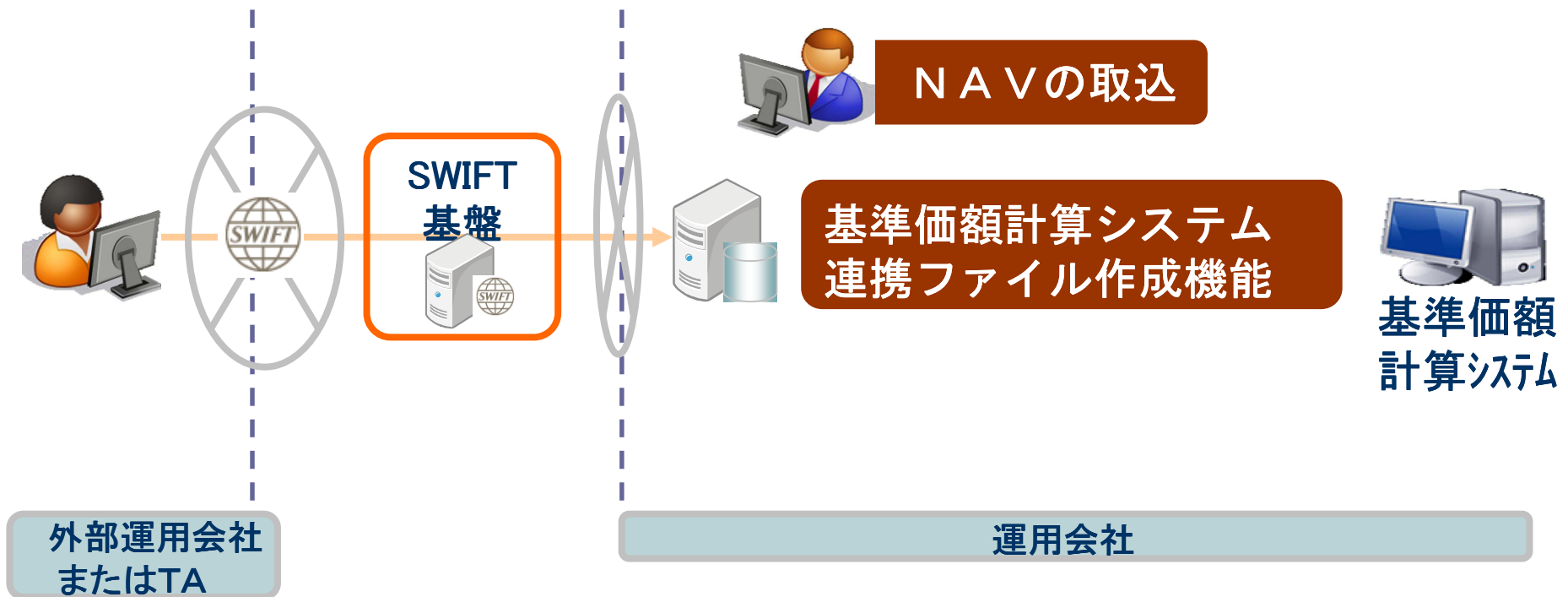
【NAV・残高情報】

⑤外部ファンド運用会社からの受信 1

【NAVの取込機能】

：外部運用会社よりNAVを受信する。

受信したNAVを基準価額計算システムへ連携する。



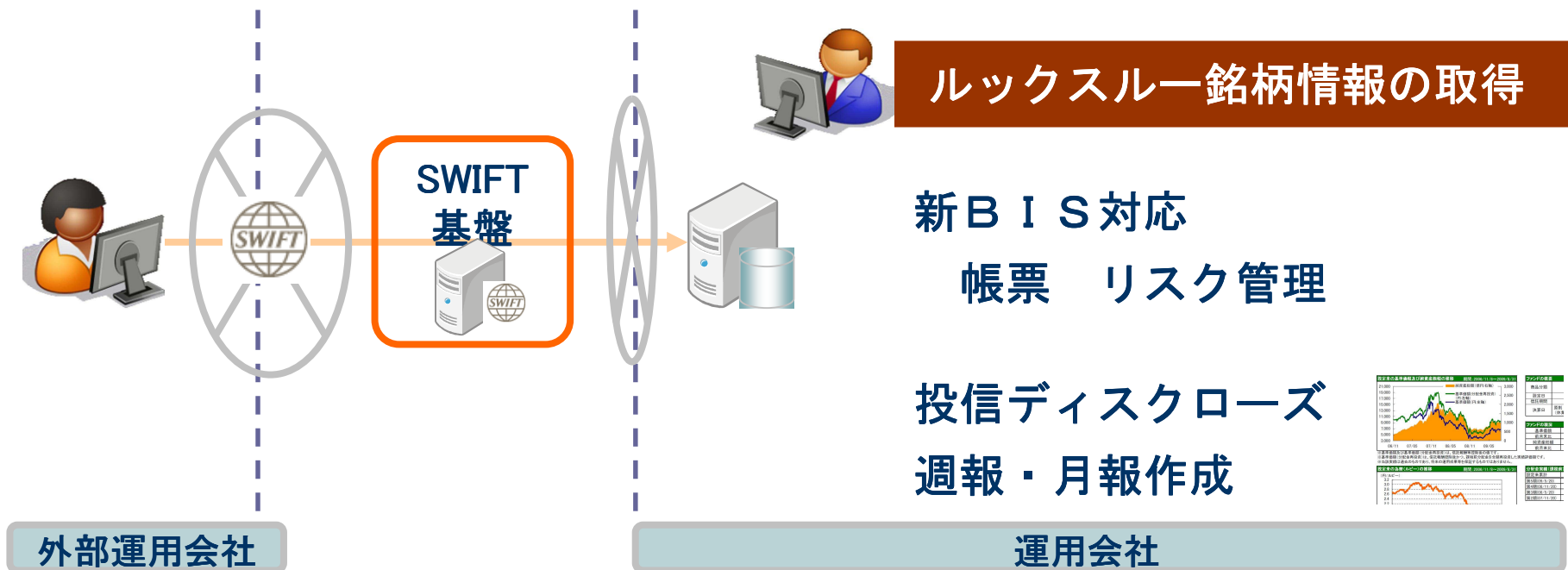
2. 資産運用会社向けSWIFTメッセージの活用

【NAV・残高情報】

⑥外部ファンド運用会社からの受信 2

【ルックスルー銘柄情報の取得】

：外部運用会社より対象となるファンドの銘柄情報を取得する。
(ホールディングスデータの受信)



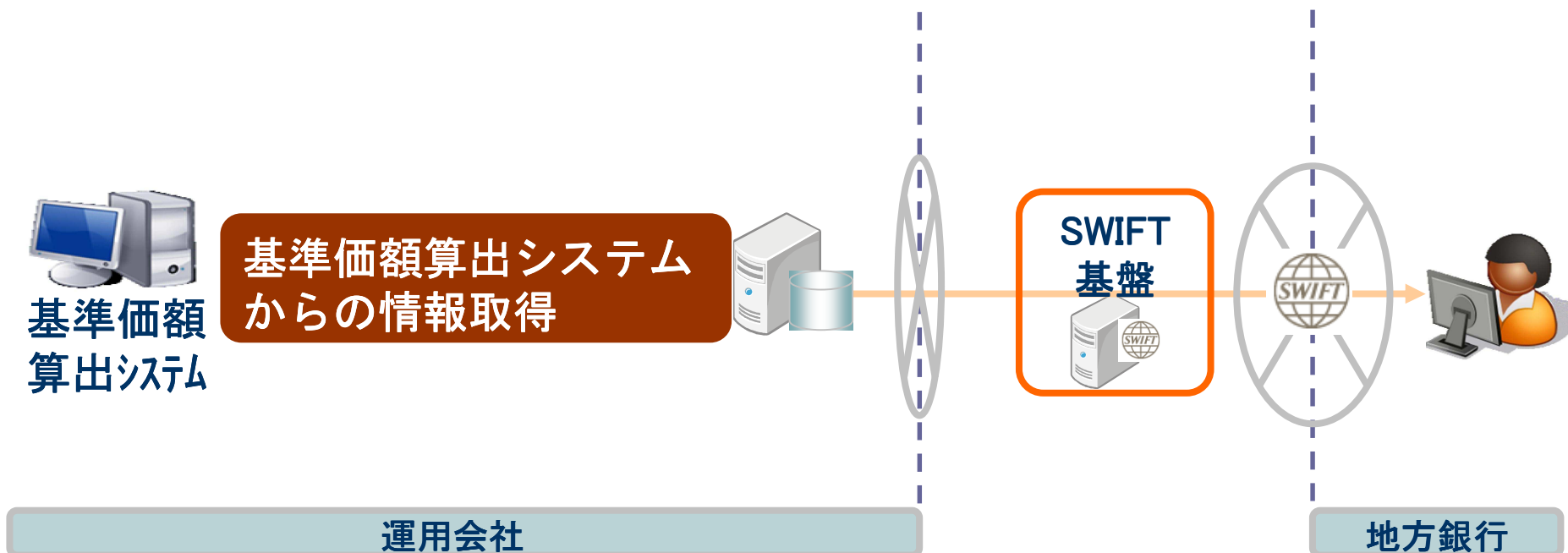
2. 資産運用会社向けSWIFTメッセージの活用

【NAV・残高】

⑦地方銀行への送信

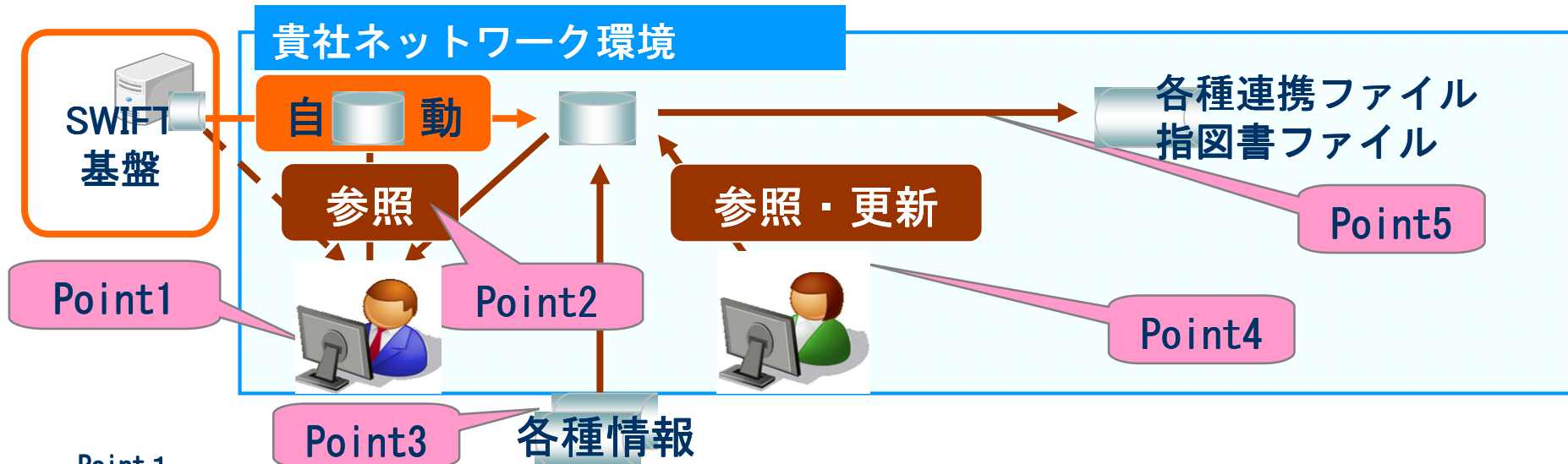
【基準価額算出システムからの情報取得】

基準価額算出システムから残高情報を作成する。



2. 資産運用会社向けSWIFTメッセージの活用

システム化のポイント



Point 1

当日の取込状況、進捗を画面管理が可能。 ⇒取込エラーや保留、アップロード状況など件数で表示。

Point 2

受信メッセージ、中間テーブル(SRDB)、変換後DBが参照できる為、柔軟性の高いシステム構築が可能。
個社別に必要な機能のみを適用することが出来ます。

Point 3

SWIFT以外の情報を取込むことが可能。機能ごとや資産ごとに当システムへの適用が可能。
取引情報だけではなく、コンファーム情報を取り込みマッチングする機能も実現可能。

Point 4

受信したメッセージを一覧画面で修正・確認・保留して、画面上で検索・編集が可能。
⇒情報操作が容易に行える。属人化の対策。

Point 5

各システムへの連携ファイルを作成する。

ご清聴ありがとうございました



株式会社パワーソリューションズ

代表取締役社長 佐藤 成信

お問合せ

SWIFTサービスビューロ、業務系システムソリューションサービスについて、ご質問等ありましたら担当窓口までご連絡下さい。

顧客担当窓口

金融ITコンサルティング本部 新井 謙吉

03-5288-1009

k-arai@powersolutions.co.jp



株式会社パワーソリューションズ

〒100-0004

東京都千代田区大手町1-5-1 大手町ファーストスクエア ウエストタワー2F

Tel :03-5288-1009 Fax :03-5288-1118