

# JASDEC-Link , Promoting Efficiency to Omgeo Clients

2009年9月10日

Omgeo Client Forum Japan

証券保管振替機構 ポストレードサービス部

塚原 昌章

# AGENDA

- ◆ 決済照合システムについて
- ◆ JASDEC-Linkの目的
- ◆ JASDEC-Linkの概要
- ◆ 今後の対応

# 決済照合システムについて



## ➤ 清算・DVP決済のための事前照合機能の提供

- ✓ 機構における一般振替、一般債、短期社債のDVP決済
- ✓ JGBCC(日本国債清算機関)における清算業務

## ➤ STP(Straight Through Processing)の推進

- ✓ CSDとしてこのプロセスに対して、どんな範囲をどのような方法でコミットしていくべきか？

# 決済照合システムについて

➤国内機関投資家取引、非居住者取引に対するセントラル・マッチング・サービスを提供

(Pre-Settlement Matching System)

✓約定照合、決済照合(国内取引)

✓決済照合(非居住者取引)

✓JGBを含めたすべてのアセット・クラスをカバー

➤業態別参加率(約定件数ベース)

✓国内取引

投資顧問会社、投資信託委託会社: 約60%

証券会社、信託銀行: ほぼ 100%

✓非居住者取引

証券会社、カストディ業務を行なう銀行: ほぼ100%

# 決済照合システムについて

## 運用会社に対するプロモーションを実施

### ▶ 運用会社に対する利用料金の引き下げ

✓ 月額10万円のキャップ制

✓ 件数の少ない利用者向け特別料率の導入 \*

\*運用会社だけではなくすべての利用会社に適用される料率で、  
2006.1.から実施

### ▶ 国内ETCサービスベンダーとの接続



### ▶ 次のステップは何？

### ▶ 運用会社の効率性の向上に向けてJASDECに何が出来るか？

# JASDEC-Linkの目的

➤ Allocationを含めたSTP環境を提供する

✓ 運用会社向けのGlobalなSingle Platform

✓ 運用会社、信託銀行双方における投信基準価額計算の精度の向上

✓ 信託財産運用指図書をペーパーレス化

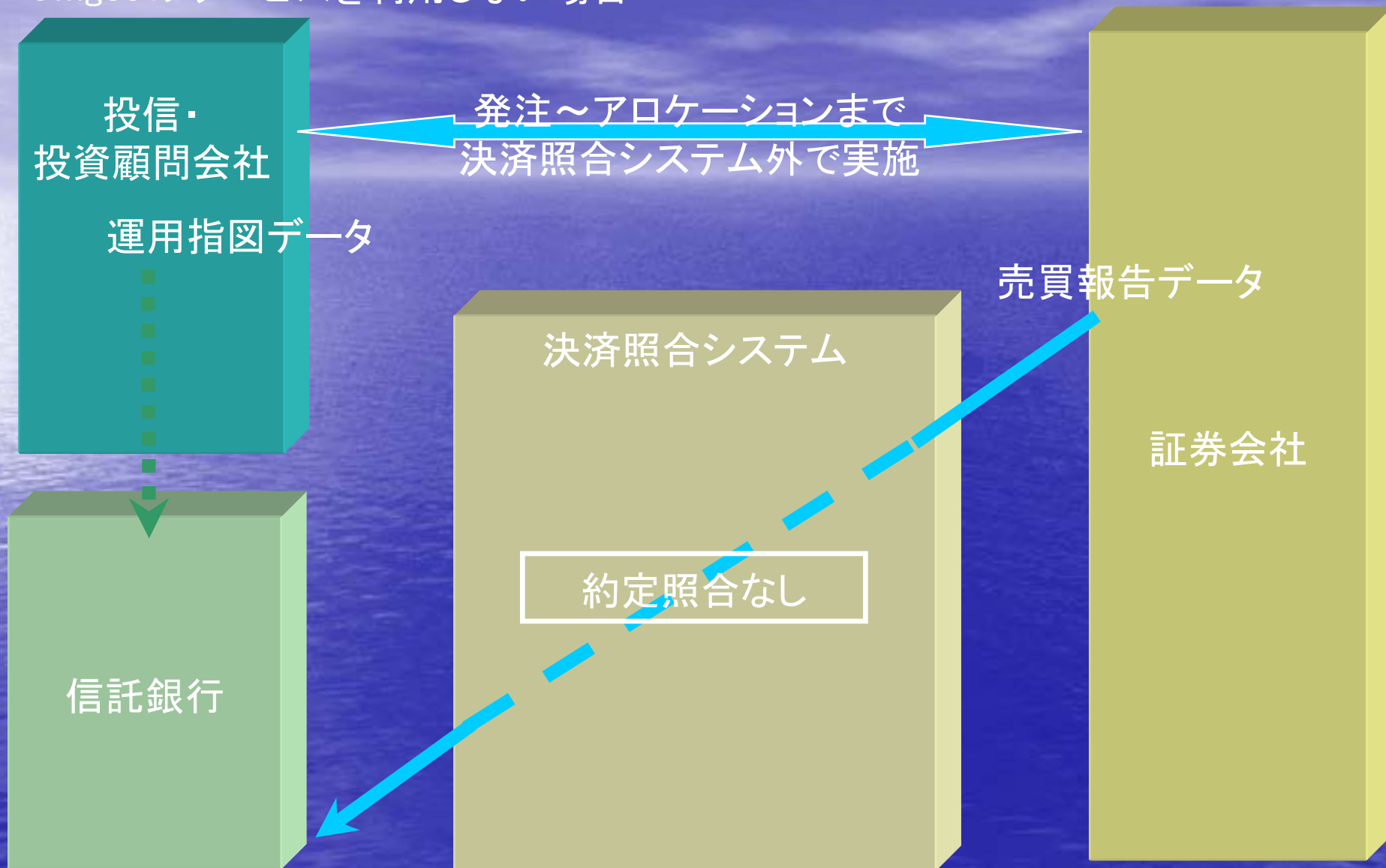
✓ 信託銀行へのアクセスの一本化



Allocationに強みを持つOmgeoとのアライアンス

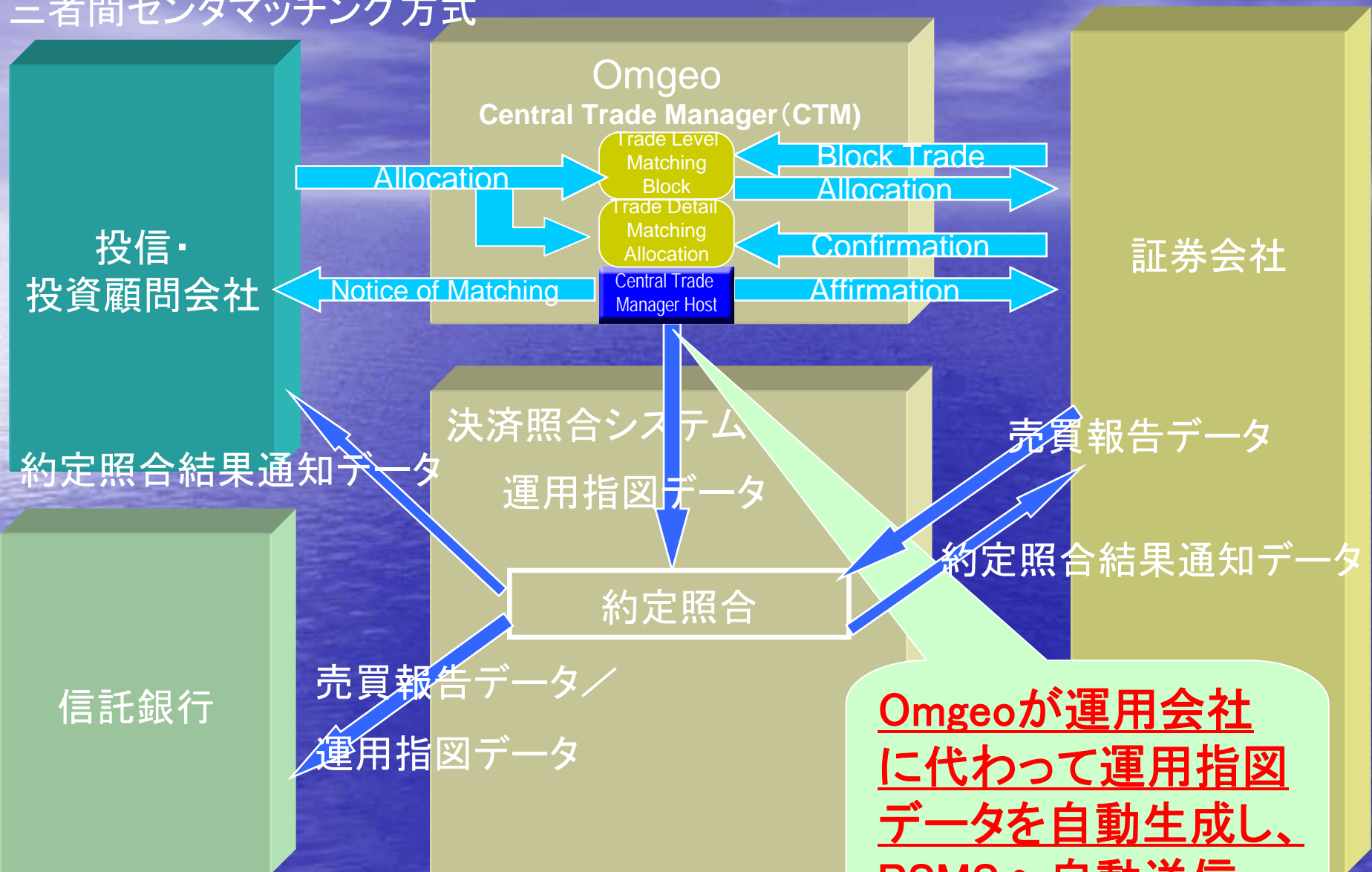
# JASDEC-Linkの概要

Omgeoのサービスを利用しない場合

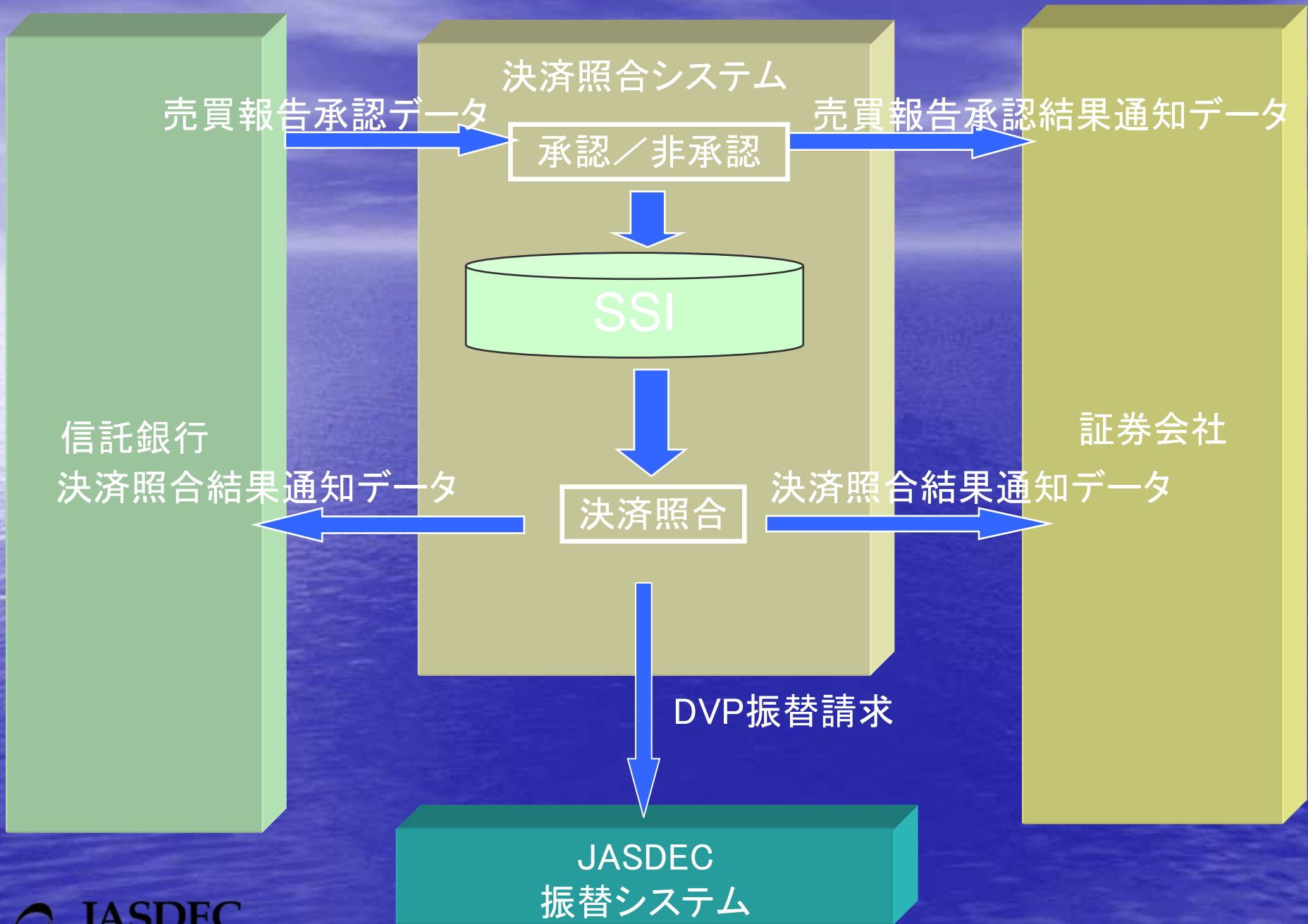


# JASDEC-Linkの概要

三者間センタマッチング方式



次頁に続く



# JASDEC-Linkの概要

## ▶ 取扱い対象商品・サービス

✓ 株式(通常売買、募集、売出)

✓ CB(通常売買、募集)

✓ 国債(通常売買、募集)

✓ 一般債(通常売買、募集)

✓ 短期社債(通常売買、募集)

## ▶ 統合web端末による補完機能

✓ 約定照合ステータス(PSMS)

✓ 約定確定報告データ/送信完了報告データ

## ▶ 取扱い対象外商品・サービス

✓ 先物・オプション

✓ 投信基準価額

# JASDEC-Linkの概要

## ▶プレスリリース

✓オムジオ社証券取引処理システムと証券保管振替機構の〈決済照合システム〉のアライアンスによりインターフェース完成

(<http://www.jasdec.com/news/20061031.html>)

✓証券保管振替機構〈決済照合システム PSMS〉とオムジオ〈約定確認システム Omgeo CTM/OASYS Global〉の直接接続をPCAアセット・マネージメントが採用

(<http://www.jasdec.com/news/20090701.html>)

# 今後の対応

- ▶ 新しいメッセージ標準の開発  
～ ISO20022 Post Trade PJ 共同開発
  
- ▶ 利用者の拡大  
～ 外資系運用会社から国内系運用会社まで
  
- ▶ 対象商品の拡大  
～ 外国有価証券(海外直接投資)の追加

ありがとうございました

<http://www.jasdec.com/>