



# Omgeo CrossCheck<sup>®</sup>

デリバティブポートフォリオのリコンサイルにおいて  
マニュアル作業で発生するコストとリスクを軽減

ALERT  
Benchmarks  
Central Trade Manager  
Connect  
MarketMatch  
OASYS Global  
Transaction Report

## DTCC Trade Warehouse を含む取引当事者間のデリバティブポートフォリオ比較を自動化する、集中型ホスト、例外管理ソリューション

デリバティブポートフォリオのリコンサイルは業界全体にとって課題であり、機関投資家、証券会社、規制当局にとってコスト増加とリコンサイル不能なポジションの増加は大きな問題となっています。

これらのリスクとコストは、リコンサイルの自動化と取引当事者と、実績・安全性のあるオムジオコミュニティのメンバーである関係機関との協調によって削減することができます。

オムジオは、Global Electronic Market (GEM)社から、業界で実績のあるポートフォリオリコンサイルソリューションであるCrossCheckを取得しました。

CrossCheckは、FpML標準に準拠し、業界で実績のあるデリバティブ向け高性能モデルで、集中ホストサービスにより機関投資家、証券会社またその他の関連機関との間のデリバティブポートフォリオの比較を自動化します。また、取引日、ノーショナル、レート、支払い、カスタムで定義された照合ポリシーをベースにしたポジションとポートフォリオの価値といった詳細情報を比較します。

CrossCheckによってリスクを軽減し、支払い、担保請求、信用事由に先立って不一致ポートフォリオによって生じる影響を最小限におさえることが可能です。金融機関各社は、市場のストレスという点でのリスク管理を効果的に行いながら取引量を増加させ、ビジネスを拡大し、さらに透明性と効率性のレベルを高めることが可能です。

### オムジオの実績

株式、債券、デリバティブ、いずれのアセットクラスにおいても、取引のライフサイクルイベント全般でプロセスの高速化、高度な自動化、効果的なリスクマネージメント、生産性と処理能力の向上が求められています。

オムジオでは、株式、債券においてオムジオの専門知識を活かしてこれらの課題に取り組んできましたが、今後デリバティブにも対応してまいります。

オムジオは、世界 45 カ国、6000 社のオムジオコミュニティを確立し、クライアントとシームレスに連携しながら投資業界でのオペレーションを統一化し、取引相手とセキュアな環境でデータ通信を容易にする革新的なソリューションを提供してきた実績があります。

### DTCC Trade Information Warehouseとの3社間リコンサイル

クレジットデリバティブにおいて、オムジオは他に類をみない透明性と効率性をもたらしています。オムジオは、DTCC Trade Information Warehouseと提携し、DTCC Deriv/SERV社のクライアントでもあるオムジオのクライアントに対しWarehouseからCrossCheckへ、関係するクレジットデリバティブの取引データを自動的に送信します。

この自動送信により、クライアントは、Warehouseのポートフォリオレコードと比較することができ、Deriv/SERVを利用しているすべての取引相手のポジションの取引詳細の“ゴールデン・コピー”(法的に有効な記録)と一致しているかどうかを確認できます。CrossCheckは、多国間でのリコンサイルモデルをサポートする商用としては唯一のソリューションであり、お客様はTrade Information Warehouse、カストディアン、プライムブローカーなどサービスプロバイダといった取引相手と同時にリコンサイルが可能になります。

Warehouseデータへのアクセス、CrossCheckの自動化と組み合わせることによって実現する透明性により、すべての取引関係者はリスクの影響度をより正確に、効率的に把握することができます。



www.omgeo.com

## オムジオ照合システムにより処理能力が増大

照合プロセスがすべて自動化されると、ユーザは例外管理のみにフォーカスすることができるので、その結果オペレーションコストの削減と処理能力・生産性の増加につながります。

### 徹底したリスクマネージメント

リコンサイル不能なポートフォリオに起因するコストとオペレーションリスクを最小限にとどめるためCrossCheckを利用することにより、以下のような利点が挙げられます。

- **例外の積極的マネージメント**  
集中化されたエラー・例外管理トラッキングにより、取引当事者は問題が発生した後に反応するのではなく、特定のポジションの識別、割り当て、例外解決の積極的な追跡が可能になります。
- **データのコントロール**  
特定の取引当事者のデータとリスクの問題を特定するため、ポリシーのカスタマイズができる柔軟かつ高度な比較エンジンを提供します。
- **監査トライアル機能**  
グローバルで規制が強化される中、重大な不一致や監査が生じた際に、迅速かつ効果的に取引履歴を作成します。

### 自動化による効率性

既存のオペレーションスタッフで、すべてのポートフォリオのリコンサイル処理能力を正確に、かつ大幅に増加することが可能です。

- **ポジションデータ収集を自動化**  
CrossCheckは取引当事者からデータを収集し、多くの機関投資家が費やす手間のおよそ3分の1以上を削減します。
- **データ変換作業の手間を軽減**  
CrossCheckは、データ変換を規定しており、データの正確な変換設定を確実にするためのセントラルサービスへ各ユーザがアクセスします。
- **多角的な自動化コミュニケーション**  
取引双方から届いた取引詳細にリンクされた取引当事者の例外情報を送信し、非生産的なEmailでのコミュニケーションが不要になります。
- **直感的なユーザーインターフェイス**  
オペレーションチームとその他のユーザにとって操作しやすいシンプルなインターフェイスです。

### カスタマーサービス

Crosscheckによってクライアントとその他の当事者に、既存の不一致状況を把握しつつ取引相手の意図と一致した正確なりコンサイルポジションのレポートが可能になります。

- **ポートフォリオ全体をセントラルビューに**  
CDS、IRS、エクイティなど、異なるシステム間にまたがった情報を、全ポートフォリオをひとつのビューに集約し、解決までの時間と手間を削減します。
- **取引相手との透明性**  
積極的なりコンサイルによりお客様へ明確なポジションを提供します。
- **効果的な不和解決**  
内部リソースに負担をかけることなく、不和や不一致を解決するため、タイムリーに監査履歴へアクセスできます。

### 主な技術的機能

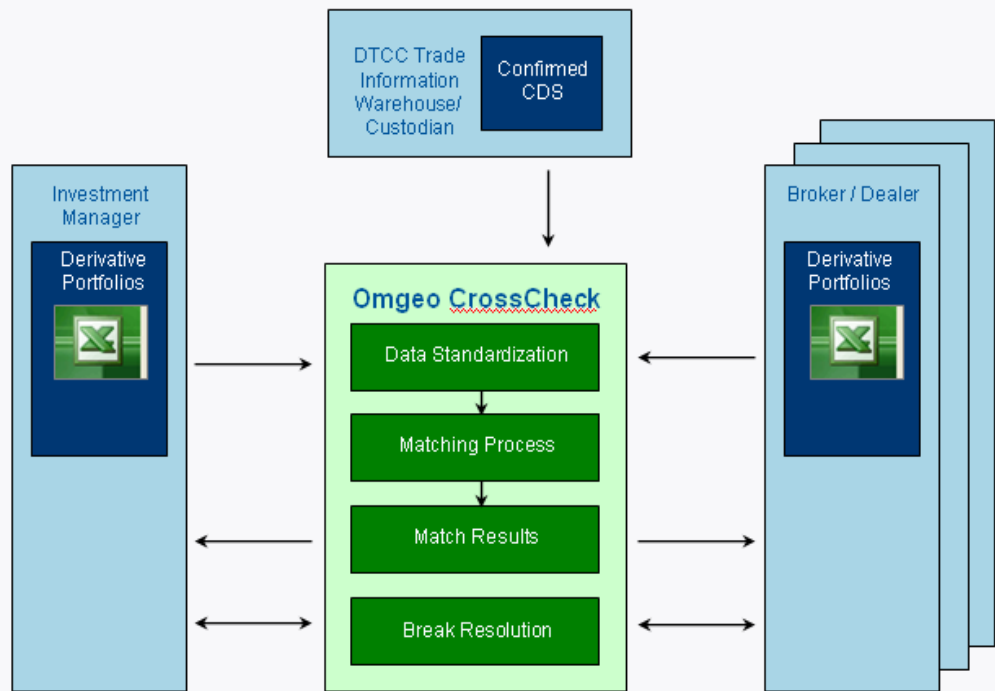
- **アドバンスデータマッチング機能**  
取引相手のポジションと一致させるためにポジションの複数レグをロールアップします。
- **データ送信方法の複数オプション**  
セキュアなファイル転送形式でデータを送信、もしくはインターフェイスを通じてファイルをインポートします。
- **結果を詳細ステータスへ分類**  
結果をMatched, Unmatched, Accepted, Alleged別に分類したクイックビューでみることができます。
- **お好みでユーザーインターフェイスをフィルター**  
結果は、ソース別(ブローカー、カストディアン、Trade Warehouse)、製品タイプ、通貨、取引相手、日付といった多数のクライテリアによってフィルタリングが可能です。

### 各種デリバティブ製品に対応

CDS・オプション、金利スワップとスワップション、金利キャップ・フロア、株式スワップ、オプション、債券スワップ、OTC債券オプション、インフレスワップ、CCYスワップ、FXスポット・フォワード、FXスワップ・オプション、エネルギー・スワップ・オプション、コモディティスワップ、エキゾティック・ハイブリッドなどの各種デリバティブ製品に対応しています。



[www.omgeo.com](http://www.omgeo.com)



扱いは方を楽にマスターできる直感的なウェブベースのインターフェイス

### Match Summary

Logged in as: Robert Jones

Navigation: << >> Positions MTMs Breaks Processing Reference Formats Policies Help

Summary Rollup Summary Net Positions All Positions My Positions Matched Partial Broken Unmatched Alleged Rolled

Up Accepted

Selection ... [hide]

Inputs

Base Source: ABC Inves...ement In Other Source: -(Any)- Counterparty: -(Any)-

Data Set: -(Any)- Branch: -(Any)- Fund: -(Any)-

As-Of: 2008-06-26

Product Characteristics

Product: -(Any)- Currency: -(Any)- Asset Class: -(Any)-

Underlying: -(Any)- Trade Date From: -(Any)- To Trade Date: -(Any)-

Other Filters

Show: Match Summary

Sorting/Grouping

Group By: Fund

Fund	Base Net	Match	Partial Match	Unmatched	Accepted	Alleged	Other Net	Action
ABCIM - Total Return Fund	65	36	29	0	0	2	67	▲
ABCIM - Police Fund of Philadelphia	22	12	8	0	2	3	25	▲
ABCIM - ACME Corporation Retirement Fund	20	14	6	0	0	0	20	▲
<b>Totals</b>	<b>107</b>	<b>62</b>	<b>43</b>	<b>0</b>	<b>2</b>	<b>5</b>	<b>112</b>	

Records 1 to 3

照合プロセスの自動化により、照合結果を把握し、不一致の解決にすぐ着手できます。

体系的な問題を見つけ出すためのグループデータと柔軟性かつ強力なセレクトションフィルタ

### オムジオについて

オムジオは、機関投資家と証券会社間で取引された約定確認を迅速かつ自動的にを行い、ポストレード業務に確実性をもたらしています。オムジオのコミュニティは世界45カ国、6,000社を超え、取引照合、取引割当の例外処理、約定確認、決済指図を効率的に管理しています。

オムジオは、ますます取引量が拡大し続ける時代の中で、複雑さが増す投資業界に対して業務の安定性と収益性にフォーカスしたソリューションを提供しています。クロスボーダー取引、あらゆる資産クラス、取引ライフサイクル全般をカバーし、オムジオは投資業界での業務効率におけるグローバルスタンダードの地位を確立しています。オムジオは、世界最大の証券保管・決済機構であるDTCC（米国証券振替機構）と、金融情報サービスプロバイダであるトムソンロイターの提携により、2001年に設立されました。

オムジオに関する詳細は、  
[www.omgeo.com/japan](http://www.omgeo.com/japan)

をご覧ください。

#### 【お問い合わせ】

##### オムジオ株式会社

〒100-0003 東京都千代田区一ツ橋 1-1-1 パレスサイドビル

Tel: +81. 3. 5218. 6621 Fax: +81. 3. 5218. 7775

一般のお問い合わせ [askomgeojapan@omgeo.com](mailto:askomgeojapan@omgeo.com)

クライアントヘルプデスク [japansupport@omgeo.com](mailto:japansupport@omgeo.com)



[www.omgeo.com](http://www.omgeo.com)

Copyright © 2010 Omgeo LLC. All rights reserved. All Omgeo service names appearing herein are either registered trademarks or service marks of Omgeo LLC in the United States and elsewhere. Several Omgeo services are regulated by the U.S. Securities and Exchange Commission. For more information, please visit [www.omgeo.com/regulation](http://www.omgeo.com/regulation).