

2016年10月14日

各位

株式会社電通国際情報サービス

ISiD、金融機関の非清算店頭デリバティブ取引における 証拠金管理ソリューション「iCollex」の提供開始

～2016年9月施行の新規制に対応する国内初のパッケージソリューション～

株式会社電通国際情報サービス(本社:東京都港区、代表取締役社長:釜井 節生、以下 ISiD)はこのほど、金融機関の非清算店頭デリバティブ(金融派生商品)取引に係る証拠金規制^{*}に対応するソリューション「iCollex(アイコレックス)」の提供を開始しました。iCollex は、当該規制への対応に特化した国内初のパッケージソリューションで、すでに先行ユーザー1社が採用し、本格運用を開始しています。

■背景■

近年、世界の金融市場におけるデリバティブ取引は、様々なリスクヘッジや収益獲得の手段として、取引規模が年々拡大しています。なかでも取引所を介さない店頭取引は、期間や価格等を自由に設定できる利便性から、現在ではデリバティブ取引の大部分を占める取引形態となっています。

一方で、店頭デリバティブ取引は当事者間取引であるため中央当局による監視が難しく、リーマンショック時には金融システム不安を世界に伝播させる原因にもなったことから、世界的に規制が強化されています。日本においても金融庁が「金融商品取引業等に関する内閣府令」をはじめとする既存の法令を改正し、証拠金の授受を義務付ける新規制を、2016年9月から取引規模に応じて段階的に適用開始しています。

当該規制の対象となる金融機関では、膨大な非清算店頭デリバティブ取引ごとの日次での証拠金算出・決済や、計算した証拠金額に双方で乖離がある場合の交渉等、管理業務負荷が大幅に増加することが見込まれており、システム化へのニーズが高まっています。すでに適用が開始された大手金融機関等ではシステム対応を完了しているものの、まもなく適用対象となる信託銀行や地方銀行等においては、既存システムの改修に多大なコストと期間がかかることが課題となり、対応が進んでいないのが現状です。

■「iCollex」の概要■

「iCollex」は、非清算店頭デリバティブ取引に係る証拠金規制の対応に特化した国内初のパッケージソリューションです。ISiD が手がけてきた国内大手金融機関のデリバティブ取引業務や担保管理業務におけるシステム構築のノウハウをベースに規制対応に必要な機能を網羅的に実装しており、規制対応の確実な遂行と大幅な効率化を実現します。オンプレミス型システム構築とクラウドによる SaaS 提供両方が対応可能なパッケージソリューションのため、各金融機関のニーズに合わせた導入が可能で、既存のシステムに大きな変更を加えることなく、短時間で安価に導入することができます。

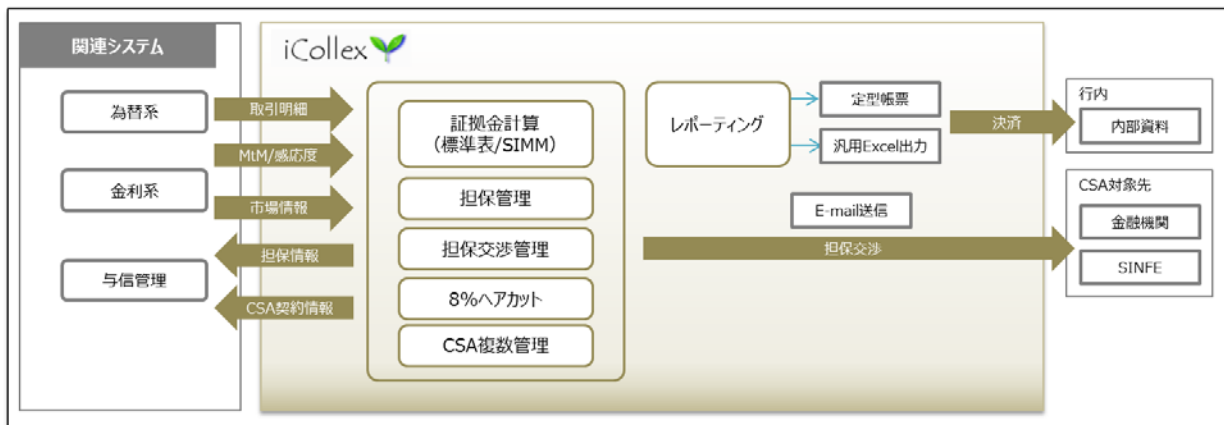
<主な機能>

- ・ 変動証拠金計算
 - … 時価変動相当額を算出。
- ・ 当初証拠金計算
 - … 取引相手方が将来破綻した際に取引を再構築するまでに生じる時価変動の推計額を算出。
標準表、SIMM(国際スワップデリバティブ協会が推奨する標準的手法)の双方に対応した計算。



- ・ 8%ヘアカット対応
 - ・・・契約毎、受け払い毎のヘアカット率を定義。
- ・ CSA 契約の複数管理
 - ・・・既存の契約に加えて規制要件に対応した新たな契約の追加管理。
- ・ 証拠金の日次評価
- ・ 担保交渉管理
- ・ T+1 決済(取引後 24 時間以内での決済)の対応

<iCollex 機能概要図>



<提供価格(税別)>

- ・ オンプレミス型
 - ライセンス価格 : 1,000 万円～ 月額保守料 : 20 万円～
- ・ SaaS 型
 - 月額利用料 : 35 万円～

また、規制対応に関するコンサルティングサービスも提供しております。

* 導入支援費用は別途見積りとなります。

iSiD は今後も、iCollex をはじめとする市場系ソリューションの強化を図り、金融機関の市場系業務の高度化を支援してまいります。

※ 2011 年 11 月の G20 カンヌ・サミットにおいて非清算店頭デリバティブにおける証拠金の授受の義務付けが国際的に合意され、その後 BCBS (バーゼル銀行監督委員会)及び IOSCO(証券監督者国際機構)から 2013 年 9 月に具体的な規制要件が示された。それを受けて、日本では金融庁が 2016 年 3 月に「金融商品取引業等に関する内閣府令、告示、および監督指針」を公表し、同 9 月より金融商品取引業者を対象に段階的に規制が適用されている。具体的な規制要件として①時価変動相当額を変動証拠金として受領する義務、②取引相手方が将来破綻した際に取引を再構築するまでに生じる時価変動の推計額を当初証拠金として受領する義務が課される。

【製品に関するお問い合わせ先】

株式会社電通国際情報サービス 金融ソリューション事業部 金融事業開発部
TEL:03-6713-7007 E-Mail:g-finmarketing@group.isid.co.jp

【本リリースに関するお問い合わせ先】

株式会社電通国際情報サービス コーポレートコミュニケーション室 野瀬、李 TEL:03-6713-6100 E-Mail:g-pr@isid.co.jp

<電通国際情報サービス(ISID) 会社概要>

社名 : 株式会社電通国際情報サービス(略称:ISID)
代表者 : 代表取締役社長 釜井 節生
本社 : 東京都港区港南 2-17-1
U R L : <http://www.isid.co.jp>
設立 : 1975 年
資本金 : 81 億 8,050 万円
連結従業員 : 2,559 名(2015 年 12 月末現在)
連結売上高 : 56,771 百万円(2015 年 12 月期)※9 カ月決算
事業内容 : 1975 年の設立当初から顧客企業のビジネスパートナーとして、コンサルティングからシステムの企画・設計・開発・運用・メンテナンスまで一貫したトータルソリューションを提供してきました。IT Solution Innovator をビジョンとし、金融機関向けソリューション、製品開発ソリューションをはじめ、グループ経営・連結会計、HCM(人事・給与・就業)、ERP、マーケティング、クラウドサービスなど、幅広い分野で積極的な事業展開を図っております。

* 本リリースに記載された会社名・商品名は、それぞれ各社の商標または登録商標です。