



Charles River[®] IMS

概要

CharlesRiver
A State Street Company

チャールズリバー 投資管理システム



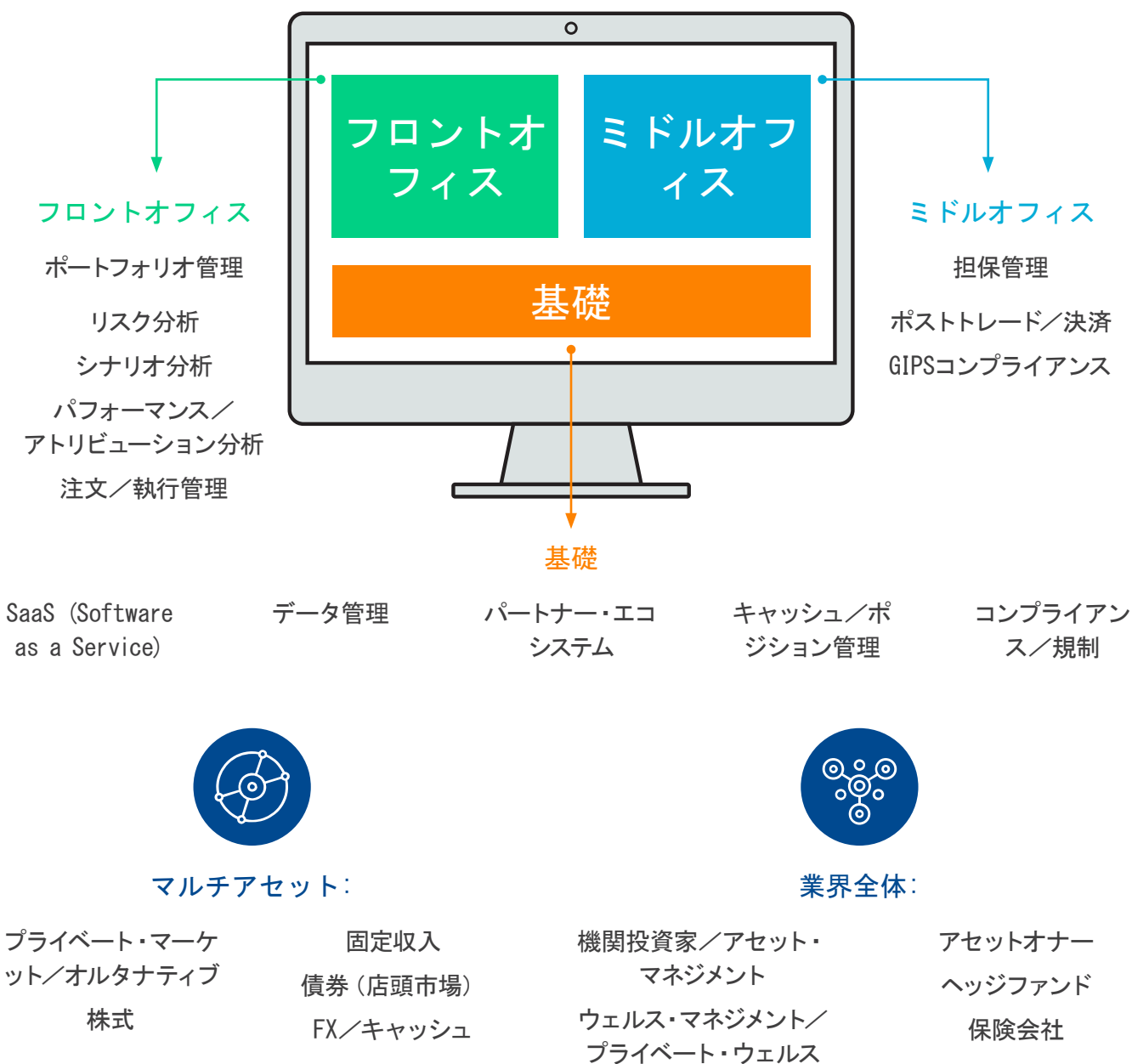
チャールズリバー投資管理システム (Charles River IMS) は、最先端クラウドベースのテクノロジーを駆使して投資運用モデルの効率向上と一元管理を可能にする機関投資家向けエンタープライズ・プラットフォームです。運用のコストとリスクの削減、タイムリーな投資決定のサポート、市場での執行時間短縮を実現します。

世界中の機関投資家に信頼されているCharles River IMSは、すべての資産クラスにおいてそれぞれの運用ライフサイクルを通し、ポートフォリオ管理及びリスク管理、トレーディング、ポストトレード決済に至るまでを一元的コンプライアンス及び管理データのもとにサポートします。

チャールズリバーはお客様独自の投資戦略をサポートするために、お客様仕様の外部のデータ、分析、運用アプリ、流動性の高い市場への接続サービスにシームレスなアクセスを可能するサードパーティー・エコシステムの強化を進めています。

単一デスクトップで全運用プロセスを管理

チャールズリバーのクラウドベース・プラットフォームは、ステート・ストリートの中ドル・バックオフィス向けサービスと一体化して、業界初のフロント・ミドル・バックオフィス資産管理ソリューションであるステート・ストリートAlphaSMの基盤を形成しています。Alphaデータ・プラットフォーム及びAlphaデータ・サービスは、ステート・ストリートAlphaSM全体で統合データ管理とデリバリーを提供します。



チャールズリバー・フロントオフィス・サービス



ポートフォリオ管理



リスク分析



シナリオ分析



パフォーマンス／アトリビューション分析



注文／執行管理



すべてのポートフォリオと商品を単一プラットフォームで管理

ポートフォリオ構築から分析・最適化に至る全プロセスに一元的に対応する機能を備えた Charles River IMSは、すべての投資ファンドと投資マンデートを単一プラットフォームでサポートします。例えば、資産配分やリスク削減策の影響の把握、ポートフォリオ構築決定におけるコンプライアンス規制との整合性のチェックが速やかに可能になります。

お客様仕様リスク分析を強化

チャールズリバーは、ポートフォリオ、市場、セクター別リスクに関する一貫性に優れたデータをタイムリーにお届けします。お客様サイドでは、単一デスクトップ上でそのデータを自社仕様または外部から導入した因子モデルに取り入れることで、運用ライフサイクルを通したリスクの計算、管理、モニターからリスク予測までが可能になります。

自社ポートフォリオの厳格なストレステストが可能

金利や為替の変動、クレジット・スプレッドの変化、物価上昇ショック、株式市場の動きなどお客様の複数のポートフォリオへの様々なストレス要因のインパクトを把握するうえで不可欠です。規制基準に沿ったシナリオをモデル・ポートフォリオの結果と比較することで、最悪のシナリオにおける資産総額の減少を推計することができます。

ポートフォリオ・パフォーマンスの属性分析

多通貨のパフォーマンスの属性結果に関する計算、分析、レポート機能を備えています。すべてのポートフォリオについて、お客様が指定する資産クラスに関する最新リターン、それへの寄与、属性のデータを全時間枠で見ることができます。

世界中の流動性の高い市場を対象とする自動トレード

チャールズリバーのマルチ資産注文・執行管理システムは、世界中の流動性の高い市場に接続し、ロータッチ・トレードを自動化するとともに、ポートフォリオ・トレードをサポートします。最良の注文執行サービスと注文執行の質の可視化を必要とされる場合は、お客様独自に取引コスト分析機能プロバイダーを選ぶことが可能です。

チャールズリバー・ミドルオフィス・サービス



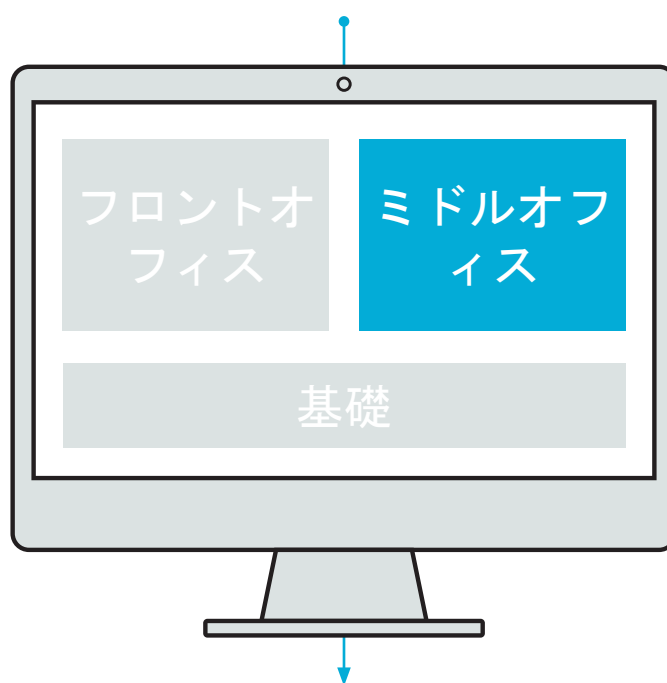
担保管理



ポストトレード／決済



GIPS コンプライアンス



マージン・コール管理と担保管理のリアルタイム可視化

フロントオフィスとミドルオフィスが取引前の投資決定サポートの段階からマージン・コール及び担保差し出しに至るまでの流れを同時に把握することを可能にします。イニシャル・マージン推計の可視化、さらに適格担保の確認、それらの記録、照合、選択、関連データの追跡といった一連の流れを一元化することによって、オペレーションの簡素化も可能です。

ポストトレード処理及び決済の一元化

チャールズリバーは、約定確認、取引照合、決済指図を一元化したサービスを提供しています。そのため、ディーラー、トレーダー、ポートフォリオ・マネージャー、コンプライアンス担当者、オペレーション担当者の全員がすべての取引のポストトレード処理と各取引に関するデータをリアルタイムで同時に閲覧できます。

GIPSコンプライアンスの維持と検証

オペレーション・チームは、チャールズリバーが提供するパフォーマンス・アトリビューション分析ツールである Performance Measurement & Attribution (PMA) によってグローバル投資パフォーマンス基準 (GIPS) に準拠しているかを確認することができます。PMAでは、個別ポートフォリオはもとより、複合 (コンポジット) ポートフォリオについても、パフォーマンス、属性、リスクの測定が可能です。

Charles River IMSの基盤

Charles River IMSの基盤は、運用サイクルを通して対応可能な統合データ・プラットフォーム、データ・サービス、クラウドベース展開能力、投資ライフサイクルを網羅したコンプライアンス機能から成っています。



クラウド展開

堅牢で、拡張性が高く、優れた運用能力を備えたプラットフォーム

マイクロソフト®社のAzure上で運用されるCharles River IMSは、よりタイムリーな投資決定を可能し、規制上の要件を満たし、既存の経営資源を活用する成長戦略をサポートするために不可欠であるシームレスな拡張性を提供します。



データ・プラットフォーム

自社及び外部データの収集、調整、活用

チャールズリバーのクラウドベースのデータウェアハウスを使うことで、自社の投資プロセスや外部から得られる多種多様なデータを収集・整理統合（キュレーション）して、自社の資産配分、投資、リスク軽減に関する決定に必要なより良い情報を提供するとともに、規制上の要件を満たすことができます。



データ・サービス

一貫性があり、正確なデータ

世界中の市況データ、参照データ、ベンチマークデータ、ESGデータ、インデックスデータに、チャールズリバー独自のマルチアセット銘柄マスターデータ及びエンタープライズデータ管理機能を組み合わせることで、お客様の投資プロセスを確実に正確かつ完全なデータでサポートします。



パートナー・エコシステム

お客様が信頼を寄せるサードパーティー・プロバイダー

チャールズリバーが推進するサードパーティー・プロバイダー・エコシステムは、お客様が独自に望まれる商品及び資産クラス・ミックスをサポートするために、外部プロバイダーが提供するデータ、分析、運用アプリ、流動性の高い市場への接続サービスへのシームレスなアクセスを可能にします。



キャッシュ/ポジション管理

ポジション/投資可能資金の可視化

チャールズリバーの投資売買記録情報（IBOR）は、資産クラス全体のキャッシュ、ポジション、エクスポージャーに関する一貫性があり、かつ正確なデータをリアルタイムでお届けします。IBORはポートフォリオ・マネジャーやトレーダーにポートフォリオに関する客観的かつ運用重視の情報を提供します。



コンプライアンス

コンプライアンス・法令順守

チャールズリバーは、世界全体の規制要件とマニデート*をカバーする規則総覧を常に更新・モニターするコンプライアンス・サービスによって補完された一元的で拡張性が高いコンプライアンスのモニタリング及び管理サービスを通して、お客様の規制要件順守をサポートします*。

チャールズリバーについて

チャールズリバーはステート・ストリートのグループ会社です。チャールズリバーが開発した投資管理プラットフォームであるCharles River IMSは、世界の30カ国の機関投資家、ウェルス・マネジメント機関、オルタナティブ・運用会社、アセット・オーナー、保険会社で使われています。ステート・ストリートのミドル・バックオフィス向けサービスとともに、チャールズリバーのクラウドベースのフロント（及びミドル）オフィス向けテクノロジーは、ステート・ストリートAlpha SMの基盤を構成しています。Charles River IMSは、様々なアセット・クラスにおけるポートフォリオ管理及びリスク管理からトレーディング、ポスト・トレード決済に至るまで、一貫して一元的コンプライアンス及びデータ管理を可能にすることで、投資プロセスの自動化・効率化を実現します。チャールズリバーのパートナー・エコシステムは、お客様が独自の商品や資産クラス・ミックスを実現するために必要なデータ、分析、運用アプリ、流動性へのアクセスを提供します。チャールズリバーは、世界11 地域のオフィスで働く 1200名以上の従業員がお客様をサポートいたします。

(2021年第4四半期現在)

crd.com/CRIMS

Charles River Development – State Street Companyは、State Street Corporation (マサチューセッツ州法人) の100%子会社です。

本文書及び本文書中の情報（以下、総称して「本コンテンツ」といいます。）は、市場その他の状況に基づき通知なしに変更されることがあり、State Street Corporation並びにその子会社及び関連会社（以下、「State Street」といいます。）の見解を反映していないことがあります。本コンテンツは、一般的な情報、説明及び若しくはマーケティングの目的のため、又は予備協議に関連してのみ提供されるものです。本コンテンツは、顧客若しくは潜在顧客の特定の投資その他の財務目的若しくは財務戦略、又は顧客の法律上、規制上、税務上若しくは会計上の地位を考慮したのではなく、また包括的なものでもなく、顧客若しくは潜在顧客の対応する投資その他の財務上の決定に関する慎重な独立した検討に代替するものでもありません。本コンテンツは、投資調査又は法律上、規制上、投資上、税務上若しくは会計上の助言を構成するものでもなく、有価証券その他の商品の売買の申込み又は勧誘でもなく、またState Streetによるいかなる拘束力のある契約上の合意又は義務を構成することを目的とするものでもありません。本コンテンツは、作成時に信頼できるとされた情報源から作成され、かつ取得されたものですが、「現状有姿」で提供されるものであり、State Streetは、その正確性、適切性、適時性、商品性、特定目的への適合性、第三者の権利の非侵害その他を含みますがこれらに限定されない、いかなる種類の約束、表明又は保証も行いません。State Streetは、本コンテンツに起因または関連する請求、損失、責任、損害（直接、間接、特別若しくは結果として生じるものを含みます。）、経費又は費用について、契約、不法行為その他のいづれに基づいて生じるかを問わず、全ての責任を否認します。本コンテンツは、小売顧客を対象とするものではなく、又は配布若しくは使用が適用法令に反する法域若しくは国の個人若しくは事業体に配布するものではなく、当該個人若しくは事業体によって依頼されるものでもありません。本コンテンツには将来の見直しに関する記述が含まれる場合がありますが、当該記述又は予測情報は、将来の業績に関する保証又は信頼性のある指標ではなく、実際の業績又は成長が、示された又は予測された業績又は成長と大きく異なる可能性があります。過去の業績は将来の業績を保証するものではありません。State Streetの事前の書面による同意なく、いかなる形式又は方法であっても、本コンテンツの再版、販売、複製、配布、又は変更は許可されていません。

貴殿の法域におけるこれらの商品及びサービスの提供又は販売は、State Streetが、単独の裁量で必要とみなす内部承認及び外部承認を受領することを条件とします。詳しい情報については、貴殿の営業担当者にお問い合わせください。ステート・ストリート社は自家運用、或いは外部委託にて、本書サンプル画面にて現れる金融資産や、同資産を裏付けとする商品への売買や投資を行っている場合があります。また、本書サンプル画面にて現れる発行体への出資や資本提携を行っている場合があります。

©2022 STATE STREET CORPORATION