

【NRI からのお知らせ】

2018 年 12 月 13 日
株式会社野村総合研究所

野村総合研究所、資産運用業務向けの新データ様式 「SYNTAX2020」を策定

株式会社野村総合研究所（以下「NRI」）は、資産運用業務向けデータ様式（フォーマット）「SYNTAX」の最新様式「SYNTAX2020」を策定し、2019 年 3 月に第 1 版として正式に公開します。

「SYNTAX」は、NRI が策定・公開する、資産運用に関する取引データや残高データのデータ様式です。主にポートフォリオの運用成果を示すデータ様式として、2018 年 12 月時点で約 50 社の資産運用事業者（アセットオーナーや資産運用会社、信託銀行等）に利用されています。

昨今、投資対象商品の複雑化やファンドの階層化に伴い、契約ごとの取引条件や、投資対象ファンドが保有する詳細な投資先の状況など、新たな情報の開示が求められるケースが増えてきています。このような環境変化を踏まえ、NRI は資産運用業務の様々な局面において利用できる新しいデータ様式として、「SYNTAX2020」を策定しました。

「SYNTAX2020」の特長は以下の通りです。

- **スワップ取引をはじめとする店頭デリバティブの取引条件を詳細に把握する情報項目を追加**
リスク管理用の項目を強化しました。（スワップの参照金利、スプレッド、元本交換有無、利払回数、デリバティブの原商品や対象指数など）
- **ファンド間の階層構造表現を追加**
ファンド型商品のルックスルー^{*1}ニーズに対応しています。（投資信託受益証券の銘柄コードと、投資信託ファンドのポートフォリオコードを紐付ける情報項目など）
- **細かく分かれていた「取引コード」の分類を 2 つに再編成**
キャッシュフローと投資対象数量の増減に重点を置いた大分類「取引種類」と、取引個別の理由を表す小分類「取引事由」の 2 つです。
- **IBOR^{*2} 情報を明確化**
過去の運用結果を会計的な視点だけではなく、現在の運用状況を運用者の視点から速やかに捉えることが可能です。

■ データ種類を定義して追加（表 1 No.3～5）

一部のユーザで、利用されていたデータ種類を正式に定義して採用しました。

■ データ種類の拡充（表 1 No.6～12）

資産運用事業者間のデータ交換だけでなく、データウェアハウス（DWH）^{※3}への格納や外部システムへの接続など、幅広い利用が可能になります。

表 1 SYNTAX2020 で定義するデータ種類

No.	データ種類	No.	データ種類
1	取引データ（ファンド取引含む）	7	銘柄リファレンス（紐付け）データ
2	残高データ（ファンド残高含む）	8	銘柄分類データ
3	勘定残高データ	9	相対取引条件情報データ
4	運用状況集約データ	10	ベンチマーク・インデックスデータ
5	銘柄基本情報データ	11	時価単価データ
6	ファンド基本情報データ	12	為替レートデータ

さらに「SYNTAX2020」の活用を促進するため、第1版の公開以降、以下の対応を行う予定です。

- 「SYNTAX」と「SYNTAX2020」の互換性を保証
（マッピング表の提示、相互データ変換機能の開発）
- 多品種少量運用に対応するため、入出力インターフェースにXMLを採用
- 生命保険会社、損害保険会社や、系統金融機関の資産運用での利用を想定した、「SYNTAX2020」の各項目へのデータ格納方法に関する説明を追加
- エンドユーザコンピューティング等で、「SYNTAX2020」のデータを活用しやすくするための解説書を提供

NRIは、今後も資産運用業界の動向を注視し、同業界の発展に寄与していきます。

※1 ルックスルー：投資対象にファンド型商品を組み入れた場合に、そのファンドが投資する先の銘柄情報などを詳細に把握すること。

※2 IBOR：Investment Book Of Recordの略で、資産運用のフロント・ミドル業務において、迅速な投資判断のために形成される、投資判断用ポートフォリオ情報。

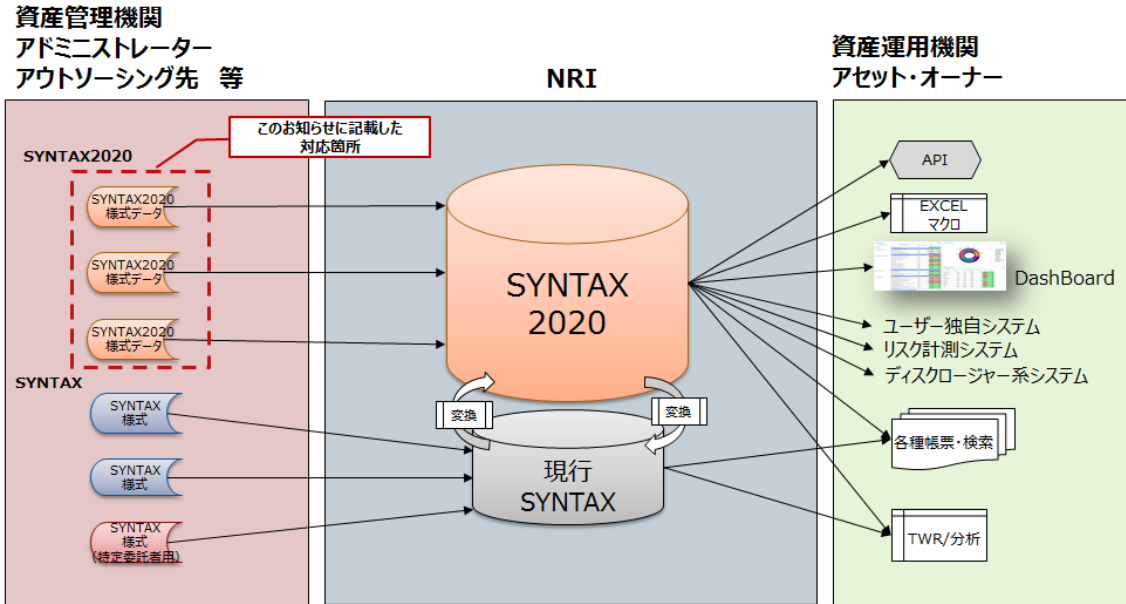
※3 データウェアハウス（DWH）：資産運用の実績データやマーケットデータなどを格納し、分析、帳票作成、エンドユーザコンピューティングなどに利用するためのデータベース。

【ソリューションに関するお問い合わせ】

株式会社野村総合研究所 資産運用サービス事業推進部 兼松、内山

TEL：03-5877-7410 E-mail：syntax2020@nri.co.jp

【ご参考】「SYNTAX2020」と「SYNTAX」の概略



※上記はイメージです。データや機能の配置は実際とは異なります。