Trans soft

有価証券 リスクアセット 算出支援システム

Securities
Risk Asset
Support system

信用金庫及び信用組合（共同組織金融機関）に特化したシステムであり、融資統合システムなど共同系のシステムでは求められない有価証券等のリスクアセット算出を支援します。

導入効果

1 クイックスタート

パソコン１台で導入できるコンパクトなシステムです。システム導入後すぐに利用できます。

2 リスクアセット算出作業時間の大幅短縮

専門的な業務知識が少ない職員でも手順書通り作業を進めることが可能であり、検証／確認作業が容易に行えます。

3 報告資料の作成を効率化

自己資本比率の報告資料を当局所定の様式で効率的に作成することができます。

4 ディスクロージャー誌の作成を効率化

ディスクロージャー誌へ掲載する「自己資本の充実の状況等」の各種資料を効率的に作成することができます。

活用イメージ

リスクアセット入力
- 投資信託
- 投資事業組合
- 有価証券等
- 貸出金等

CSVデータ取込
- 投資信託
- 外国債
- 公社債／社債

Securities
Risk Asset
Support system

投信銘柄別リスト
（オン・バランス/オフ・バランス）
投資事業組合リスト（オン・バランス）
有価証券等項目別リスト
（バーゼルⅡ/バーゼルⅢ）
貸出金等（バーゼルⅡ/バーゼルⅢ）

リスク・アセット（オン・バランス）
リスク・アセット（オフ・バランス）

ディスクロージャー誌への展開
①業種別集計関連　②リスクウェイト関連
③自己資本関連、各種リスク関連
④金融派生商品関連

Trans soft

特徴

❶ 信用金庫 及び 信用組合向けに 機能を最適化し安価でご提供

個別信用金庫様が作成したExcelをもとにシステム対応を施したため、信用金庫及び信用組合の運用にマッチした仕様になっています。

❷ 投資信託 及び 投資事業組合に対応

資産構成が複雑なため算出が難しい「投資信託」「投資事業組合」のリスクアセット算出に対応しています。

❸ バーゼルⅢ対応

貸出金等、有価証券等のリスクアセットをバーゼルⅢ基準で求めることができます。

❹ 制度変更への迅速な対応

システム導入後にリスクウェイト値の変更やエクスポージャーの細分化等の制度変更が発生した場合には、保守サービスで対応します。

RSA
Securities
Risk Asset
Support system

機　能	機 能 概 要
投資信託入力	投資信託銘柄ごとにオンバランス（付表1a）とオフバランス（付表2、付表3、付表4、付表6）のリスクアセットを入力します。
投資事業組合入力	資産構成明細により資産総額の配分比率を調整入力し、親銘柄と子銘柄別にリスクアセットを入力します。
有価証券等入力	バーゼルⅡ基準で有価証券のリスクアセットを入力します。バーゼルⅢ調整入力を行うことにより、バーゼルⅢ基準のリスクアセットを自動生成します。
貸出金等入力	融資統合システムで出力した帳票から貸出金のリスクアセットとオフバランス分（債務保証など）を転記入力します。
データ取込	NOMURA i-Port等 証券会社のシステムから投資信託銘柄、外国債、公社債・社債の銘柄をCSVデータで取得します。CSVデータをシステムへ取り込みすることで取り扱い銘柄のマスタを生成します。
リスクアセット表	オンバランス分とオフバランス分を分けてExcelに出力します。 出力したExcelは再利用が可能です。
ディスクロージャー誌変換作業	リスクアセット集計結果に対して業種設定入力等を行うことで、ディスクロージャー誌掲載用「自己資本の充実の状況等」に必要な各種資料を作成します。