



資産運用業務の収益力強化・効率化として Bloomberg のバイサイド向けソリューションであるオーダーマネジメントシステム AIM と PORT エンタープライズを導入～年間 10,000 時間分の業務効率化および年間 1 トンのペーパーレス化を実現～

2022年2月21日

MS & ADインシュアランス グループのあいおいニッセイ同和損害保険株式会社（代表取締役社長：金杉 恭三）は、ブルームバーグ・エル・ピー（在日代表：ノーマン・トゥエイボーム、以下 ブルームバーグ社）と協業し、資産運用業務の大幅な業務改善と新しい働き方の実現に向けた新システムを2022年4月より導入します。

1. 背景

当社は、約 2.6 兆円の有価証券を保有し、2020 年度には約 4,000 億円の有価証券の売買を行うなど、資産運用業務は事業における重要な位置づけとなっています。しかし、長期化する超低金利環境の中で資産運用収益を向上させる観点から、海外企業の社債や伝統的資産とは異なるリスク特性を持つファンドなどへの投資を強化してきた結果、投資対象資産の多様化・複雑化が進み、ポートフォリオ管理業務の高度化が課題となっていました。また、取引サイクル全体において、エクセルによる手作業の発生や、フロントとバックオフィスの連携に紙帳票を使用しなければならないなど、業務効率化も課題となっていました。

当社は、中期経営計画「AD Vision 2021」に掲げた、デジタル技術によるプロセス・サービス等の効率化・利便性向上とビジネス全体の変革に取り組んでおり、今般、資産運用業務においてこれらの課題を解決するため、ブルームバーグ社が提供するオーダーマネジメントシステムであるアセット&インベストメントマネジャー（以下 AIM）および、ポートフォリオ&リスク分析プラットフォームであるポートエンタープライズ（以下 PORT エンタープライズ）を 2022 年 4 月より導入することとしました。

2. 概要

(1) AIM および PORT エンタープライズについて

AIM は、ポートフォリオとリスクの管理、売買計画の作成および確認、注文執行自動化、約定後自動照合、コンプライアンス強化、後続システムとの自動連携などの機能をもった、あらゆる資産クラスに対応するグローバルな証券取引プラットフォームです。

PORT エンタープライズは、投資のプロフェッショナル向けのマルチアセット対応型の強力なポートフォリオ&リスク分析ツールです。ポートフォリオアップロード、レポート作成まで一貫した自動化によるワークフローを会社全体において可能にします。またブルームバーグの豊富なデータと頑健なポートフォリオモデルによる分析機能により、日中モニター、特性、要因分析、トラッキングエラー、シミュレーション、最適化、トランザクション分析、簿価分析など、様々なポートフォリオ分析結果をブルームバーグ端末またはレポートにて迅速に取得することが可能です。



(2) 当社資産運用業務で期待する効果

①資産運用収益力の強化

PORT エンタープライズを利用することで、様々な資産で構成されるポートフォリオの過去のパフォーマンスの分析、ストラクチャーの把握、リスクの測定、投資アイデアのシミュレーション等が可能になります。複雑化する金融市場の分析力を拡充し、アセットアロケーション機能やデリバティブを活用したヘッジ取引の強化に取り組むことで、資産運用収益力の一層の強化を実現します。

②作業時間 10,000 時間／年の削減

AIM や PORT エンタープライズを利用した業務変革、業務基盤の強化により、証券取引業務にかかる作業時間を年間 10,000 時間削減するとともに、リモート勤務や在宅勤務等の勤務形態によらない安定的な資産運用が可能となります。

③紙使用量 1 t／年の削減

AIM を利用することで、証券取引業務における自動化、効率化、高度化およびペーパーレス化が実現します。また、AIM とあわせてクラウド上の工程管理システムを用いて、社内稟議から注文執行、約定照合、資金決済といった資産運用業務の全体の業務の流れについて、電子ワークフロー化することで、処理状態の見える化、処理の迅速化、データの一元化、業務精度の向上を実現します。

3. 今後の展開

AIM および PORT エンタープライズの利用推進により、ポートフォリオやリスク面における各種の分析、レポートを拡充し、一層の資産運用収益力の強化を図るとともに業務変革、業務の効率化をさらに進めていきます。

以上

当社は、社会との共通価値を創造し、目指す社会像である「レジリエントで持続可能な社会」を実現するため、SDGs（持続可能な開発目標）を道しるべとし、地域の皆さまに貢献する活動を行ってまいります。

SUSTAINABLE
DEVELOPMENT
GOALS

