

制裁対象証券 スクリーニング

制裁対象証券を特定しスクリーニングする効率的かつ
効果的なソリューション

制裁対象証券をモニタリングしスクリーニングできるリフィニティブの新しいソリューションは、制裁対象企業に関連する証券の特定、制裁関連リスクのスクリーニングといった、複雑なデータ上の課題を解決します。このソリューションを利用することで、銀行や金融機関は、制裁コンプライアンスを効果的に維持し、安心して取引を行うことができます。

制裁対象証券：データ上の課題

多くの銀行や金融機関にとって、制裁の遵守は依然として複雑な分野です。主要な制裁のみを把握し、対応するだけでは十分ではありません。金融機関は、制裁対象証券、つまり制裁対象企業に関連する証券も特定する必要があります。制裁対象証券には、制裁対象企業の子会社が発行した証券や、制裁対象の個人が最終受益者となっている証券が含まれます。

こうした証券の特定とリスクのスクリーニングを怠った場合、風評被害を招いたり、高額な罰金を科される可能性があります。制裁に関する証券を特定するプロセスは、しばしば非常に複雑なものになります。

制裁対象証券は、米財務省外国資産管理局 (OFAC)、欧州連合、国際連合、JMOKWなどの制裁当局が明示的に公表している場合もありますが、そうでない場合もあります。多くの場合、制裁対象企業と関連が疑われる証券とのつながりを明らかにすることは金融機関の責務となっています。

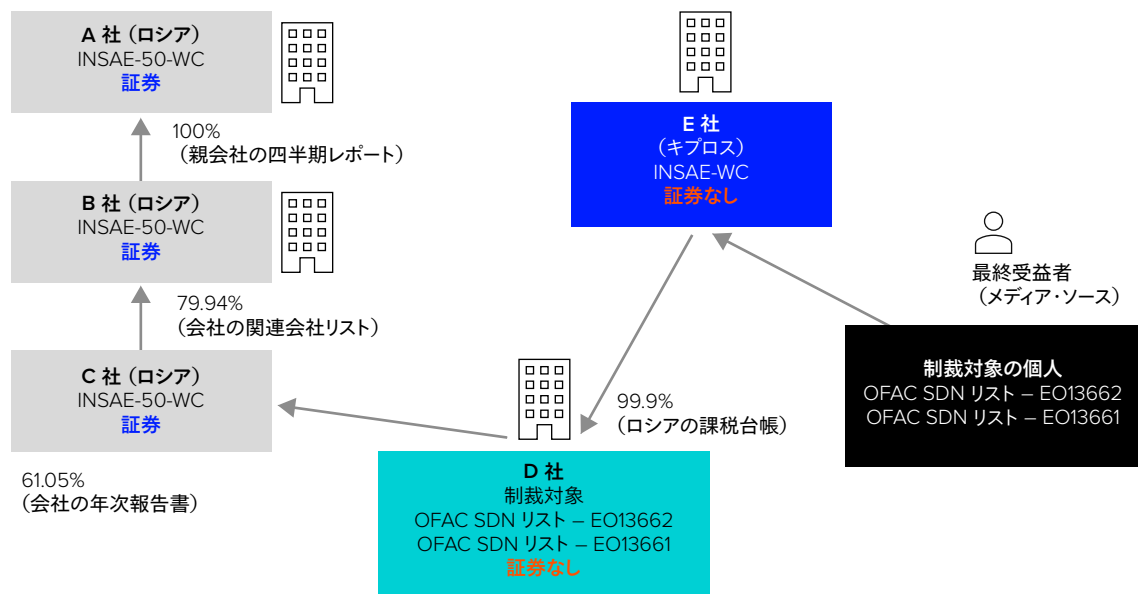
これは、データ上の重大な課題となる可能性があり、次のような作業が必要になります。

- 制裁対象企業とそれが発行した証券を特定すること
- すべての子会社 (制裁対象企業が過半数を保有する会社) を発見すること
- これらの子会社が発行した証券が制裁の影響を受けるかどうかを確認すること
- 最終受益者となっている制裁対象の個人がいるかどうかを確認すること
- 監視リストや「高リスク」リストに追加されている個人や企業の影響を受ける証券へのエクスポージャーを把握すること

上記の他に課題となるのは、関連企業に対する元の制裁が以下のような場合です。

- 包括的(対象分野が広範な)制裁または部門別制裁である場合。部門別制裁においては、米国人による特定の取引または米国内での特定の取引が禁止されています。
- 明示的制裁または黙示的制裁である場合。明示的制裁は、制裁対象の個人、組織や国の名前を明記したリストによって管理されます。一方、黙示的(ナラティブ)制裁の場合は、主要な制裁対象企業の名前が挙げられるだけであるものの、その範囲は制裁プログラムに関するナラティブ・ステートメントの対象となるすべての企業に及びます。また、たとえば14/30/90日といった特定の適用期間が設定される場合があります。
- さらに、その他いくつかの要因によって、制裁関連のコンプライアンスを維持する際の複雑さが増す場合があります。たとえば、規制当局はいつでも新しい制裁を課す可能性があり、現在制裁対象でない証券も増資、買収、IPOなどのコーポレート・アクションの過程で制裁対象となる場合があります。

制裁対象証券スクリーニング



リフィニティブの制裁対象証券ソリューション

リフィニティブが提供する総合的ソリューションでは、正確かつ包括的な制裁関連コンテンツを活用してリスクをスクリーニングすることにより、制裁対象証券に関するコンプライアンス確保に伴う複雑なデータ・ニーズに対応できます。

制裁対象の住所、企業、個人に関連する発行体や証券のリストが定期的に更新され、制裁対象の高リスク企業や個人に関連する証券に簡単にアクセス可能で、市場をリードする Refinitiv® World-Check® One のウォッチリスト機能を活用しています。つまり、ユーザーは単一のプラットフォーム上で制裁対象の証券を特定してリスクを把握することができます。

リフィニティブの効率化されたプロセスでは、ユーザーは制裁対象証券のファイルをアップロードし、制裁対象証券のウォッチリストを作成した上で、継続的なスクリーニング機能を有効化することができます。このスクリーニング機能は、一意の証券識別番号 (ISIN, CUSIP, SEDOL) を利用することで、結果の正確性を確保します。

特長は次のとおりです。

- World-Check One インターフェースまたはAPIを使って、自社またはサードパーティのリストをシームレスにアップロード
- 高度な自動化機能を広範に適用し、人為ミスのリスクを低減
- 既存レコードのコンテンツの維持と更新、新規レコードのウォッチリストへの追加が迅速かつ容易
- 自由入力のテキスト・フィールドを使って、レコードに関する個別の情報を記録

包括的なワークフロー機能とマッチング機能を備えた制裁対象証券ソリューション

各名称をロシア語、中国語、日本語を含む30以上の言語でアップロードおよびスクリーニングする機能も利用できます。

World-Checkの特長

World-Checkは、280以上の制裁リスト提供しており、業界トップクラスのカバレッジを誇っています。主要な制裁リストは、すべて常時モニタリングされカバーされます。

- 280以上の既知の制裁リストをすべてカバー
- すべての明示的制裁
- 黙示的(ナラティブ)制裁
- 制裁対象企業が発行した金融商品の制裁対象証券(ISIN/CUSIP/SEDOL)
- ISAE 3000に基づく年次監査による外部保証
- 主要な制裁リストは年中無休でモニタリングしカバー
- 専任チームがすべての制裁リストをカバー
- 専任チームによる品質管理
- レコードにはキーワードが付加され、柔軟なスクリーニングが可能
- レコードの重複は排除され、不要な情報を最大70%削減

主なメリット

- **広範なカバレッジと定期的な更新:** 包括的制裁、部門別制裁、明示的制裁、黙示的制裁をカバー
- **シンプル:** 簡単なナビゲーションとワンクリック操作が可能な使いやすい設計
- **高効率:** 二次的マッチング規則をリスト・レベルで適用することで、誤検出を抑制し効率をさらに向上。スクリーニングのマッチ率の一覧も表示
- **包括的アプローチ:** リスク調査の際、エンタープライズ・レベルの強力なケース管理機能が担当スタッフとチームをサポート。多言語機能で多国籍の企業とチームのニーズに対応
- **デューデリジェンスの証拠:** 監査に対応するため、スクリーニングプロセスの各ステップを追跡して保存。意思決定プロセスに関する詳細レポートや、是正プロセスの各段階に関与した個人に関する詳細レポートを作成

ウェブサイト refinitiv.com/ja |  @RefinitivJP  Refinitiv

Refinitiv(リフィニティブ)はロンドン証券取引所グループ(LSEG)のグループ企業として、金融市場のデータとインフラストラクチャを提供する世界有数のプロバイダーです。Refinitivの売上高は62.5億ドルに上り、190カ国で4万余りの企業・機関、40万を超える利用者を擁し、世界全体で金融にかかわる市場参加者を支えています。お客様が自信を持って重要な投資や取引、リスク判断を実行できるように、Refinitivは情報とインサイト、テクノロジーを提供しています。独自のオープン・プラットフォームとクラス最高のデータおよび専門知識を組み合わせることで、選択と機会に結び付け、お客様とパートナーの皆様のパフォーマンス、革新、成長を促進してまいります。詳しくはウェブサイトをご参照ください。<https://www.refinitiv.com/ja>