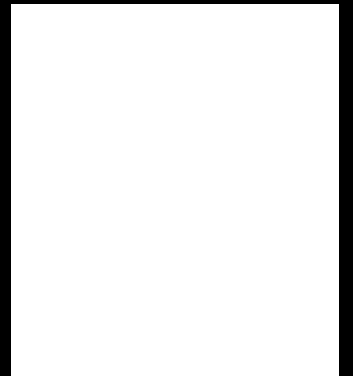
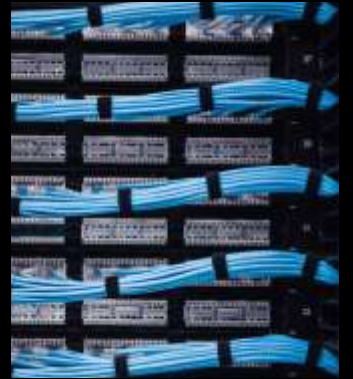


IRIS Interoperability Demo



インターシステムズジャパン株式会社

2021年6月22日

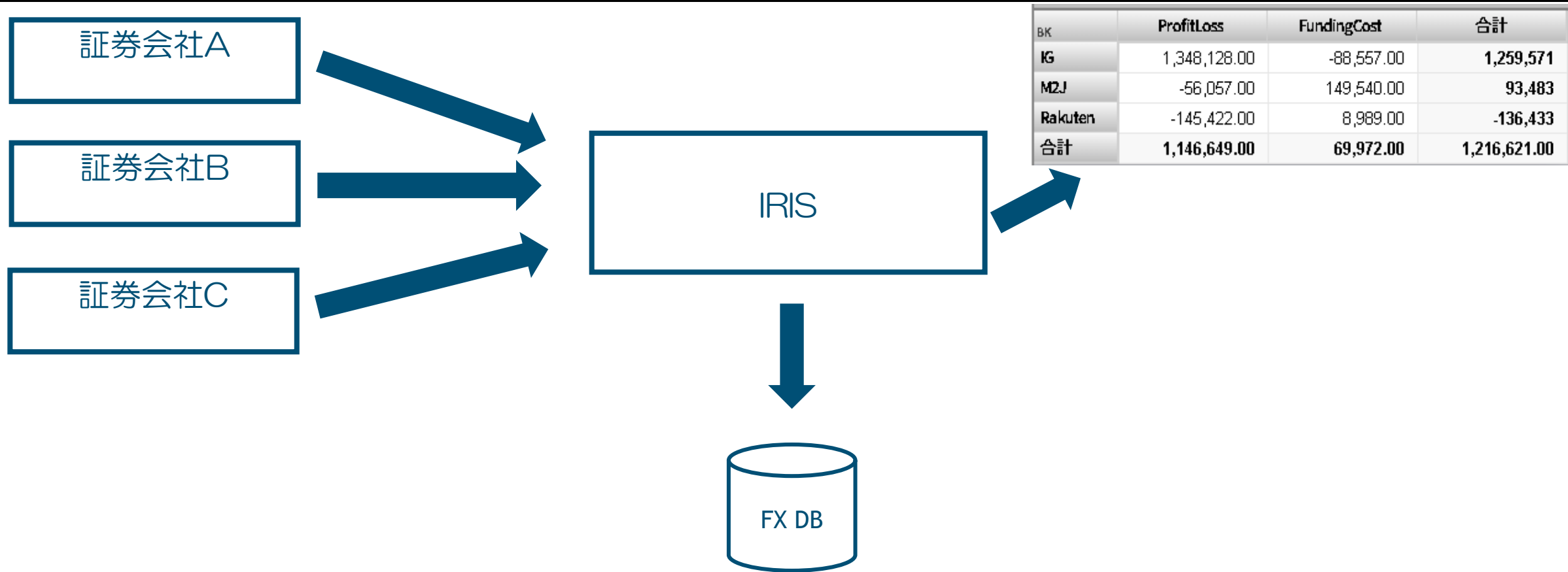


FX約定情報およびスワップによる収益管理

複数の証券会社で運用しているFX取引の収益情報を可視化するシステム

- 証券会社毎に約定データ形式が異なる
- 共通のレコードに集約
- 集約したレコードからキューブを生成し、通貨ペア、証券会社単位等の収益を可視化する

IRIS FXデータ収集構成図



各証券会社別の約定情報形式（A社）

1784	ユーロ/ドル	決済	買	5,000	1.08906	19.7	108.02	2,127	2019/9/30 21:34	2019/9/30 21:34	Market Speed FX
1783	ユーロ/ドル	決済	買	5,000	1.08906	29.7	108.02	3,208	2019/9/30 21:34	2019/9/30 21:34	Market Speed FX
1778	豪ドル/スイス	決済	買	5,000	0.67106	4.7	108.469	509	2019/9/27 8:08	2019/9/27 8:08	Market Speed FX
1777	ユーロ/ドル	決済	買	5,000	1.09191	20.45	107.814	2,204	2019/9/27 8:08	2019/9/27 8:08	Market Speed FX
1776	ユーロ/円	決済	買	5,000	117.727	1,365	1	1,365	2019/9/27 8:07	2019/9/27 8:07	Market Speed FX
1771	豪ドル/ドル	決済	買	5,000	0.67545	12.75	107.726	1,373	2019/9/26 8:09	2019/9/26 8:09	Market Speed FX
1770	ユーロ/ドル	決済	買	5,000	1.09498	25.1	107.727	2,703	2019/9/26 8:08	2019/9/26 8:08	Market Speed FX
1768	ユーロ/ドル	決済	買	5,000	1.09871	18.95	107.428	2,035	2019/9/23 23:11	2019/9/23 23:11	Market Speed FX
1762	ユーロ/ドル	決済	買	5,000	1.09876	29.5	106.32	3,136	2019/8/31 1:26	2019/8/31 1:26	Market Speed FX
1761	ユーロ/ドル	決済	買	5,000	1.09876	41.2	106.32	4,380	2019/8/31 1:26	2019/8/31 1:26	Market Speed FX
1760	ユーロ/ドル	決済	買	5,000	1.09876	56.2	106.32	5,975	2019/8/31 1:26	2019/8/31 1:26	Market Speed FX
1759	ユーロ/ドル	決済	買	5,000	1.09876	56.2	106.32	5,975	2019/8/31 1:26	2019/8/31 1:26	Market Speed FX
1758	豪ドル/ドル	決済	買	5,000	0.67303	9.85	106.321	1,047	2019/8/31 1:26	2019/8/31 1:26	Market Speed FX
1757	ユーロ/円	決済	買	5,000	116.826	3,080	1	3,080	2019/8/31 1:26	2019/8/31 1:26	Market Speed FX
1756	ユーロ/円	決済	買	5,000	116.831	3,845	1	3,845	2019/8/31 1:26	2019/8/31 1:26	Market Speed FX
1755	ユーロ/円	決済	買	5,000	116.83	4,850	1	4,850	2019/8/31 1:26	2019/8/31 1:26	Market Speed FX
1744	豪ドル/円	決済	買	10,000	71.117	7,730	1	7,730	2019/8/24 1:05	2019/8/24 1:05	Market Speed FX
1743	豪ドル/円	決済	買	5,000	71.117	1,915	1	1,915	2019/8/24 1:05	2019/8/24 1:05	Market Speed FX
1742	ユーロ/円	決済	買	5,000	117.401	2,995	1	2,995	2019/8/24 1:05	2019/8/24 1:05	Market Speed FX
1741	ドル/円	決済	買	5,000	105.41	3,950	1	3,950	2019/8/24 1:04	2019/8/24 1:04	Market Speed FX
1740	ドル/円	決済	買	5,000	105.41	4,950	1	4,950	2019/8/24 1:04	2019/8/24 1:04	Market Speed FX
1739	ドル/円	決済	買	5,000	105.41	5,950	1	5,950	2019/8/24 1:04	2019/8/24 1:04	Market Speed FX
1738	ドル/円	決済	買	5,000	105.41	950	1	950	2019/8/24 1:04	2019/8/24 1:04	Market Speed FX
1734	債券/円	決済	買	5,000	128.529	2,140	1	2,140	2019/8/20 21:50	2019/8/20 21:50	Market Speed FX

各証券会社別の約定情報形式（B社）

5L59Q9A9	02-01-2019 06:10:49	5LUKEEAP	20-11-2018 08:48:43	EUR/USD -	BUY	1	1.144	1.14901	USD	5,455	-4745	0	0	0	0 -	0	710
8TAXHWA6	02-01-2019 20:03:20	8R76TAAG	02-01-2019 17:46:11	USD/JPY -	SELL	1	109.402	109.096	JPY	3,060	0	0	0	0	0 -	0	3,060
8SXWTKA6	02-01-2019 21:33:14	8R85F5AY	02-01-2019 16:19:15	AUD/JPY -	SELL	1	76.602	76.301	JPY	3,010	0	0	0	0	0 -	0	3,010
8SHR32A6	02-01-2019 21:33:20	8R82VMAU	02-01-2019 15:06:21	GBP/JPY -	SELL	1	138.004	137.482	JPY	5,220	0	0	0	0	0 -	0	5,220
7BGKHQA5	02-01-2019 22:47:22	7AWYHGAS	12-12-2018 08:23:44	GBP/USD -	SELL	1	1.25322	1.246	USD	7,658	1404	0	0	0	0 -	0	9,062
8WTGE9AW	03-01-2019 15:34:11	8R8QTWAV	02-01-2019 14:25:17	EUR/USD -	BUY	1	1.13715	1.13969	USD	2,727	-315	0	0	0	0 -	0	2,412
8XA7BHA6	03-01-2019 18:19:45	8WVNBZAZ	03-01-2019 16:48:48	AUD/JPY -	SELL	1	76.001	75.497	JPY	5,040	0	0	0	0	0 -	0	5,040
8XACU4A6	03-01-2019 20:07:24	8WS9X7AG	03-01-2019 16:48:31	USD/JPY -	SELL	1	108.201	107.599	JPY	6,020	0	0	0	0	0 -	0	6,020
8W9AMCA6	03-01-2019 20:07:53	8WT8TFAY	03-01-2019 16:44:08	USD/JPY -	SELL	1	108.005	107.501	JPY	5,040	0	0	0	0	0 -	0	5,040
9C3Y63AP	09-01-2019 14:21:47	88E5XGAZ	08-01-2019 13:50:53	EUR/USD -	BUY	1	1.143	1.14692	USD	4,247	-110	0	0	0	0 -	0	4,137
9C34DUA8	09-01-2019 14:22:01	8472NXAZ	08-01-2019 07:17:21	USD/JPY -	SELL	1	109	108.656	JPY	3,440	-93	0	0	0	0 -	0	3,347
8Z9XKWA6	10-01-2019 06:49:56	8WTZTWA9	04-01-2019 14:23:06	USD/JPY -	SELL	1	108.5	107.797	JPY	7,030	-629	0	0	0	0 -	0	6,401
9K726NAJ	11-01-2019 15:19:15	9BJHLLAR	09-01-2019 15:16:34	GBP/USD -	SELL	1	1.28	1.27925	USD	811	243	0	0	0	0 -	0	1,054
9QTFCA7	15-01-2019 09:12:44	9QTCVVA9	15-01-2019 05:22:01	EUR/JPY -	SELL	1	124.805	124.302	JPY	5,030	0	0	0	0	0 -	0	5,030
9QVRRGA7	15-01-2019 10:46:12	9QTCXDA9	15-01-2019 05:56:46	GBP/JPY -	SELL	1	140.402	139.4	JPY	10,020	0	0	0	0	0 -	0	10,020
9QTE5CA7	15-01-2019 16:03:32	9QSKYLAV	15-01-2019 05:17:04	GBP/USD -	SELL	1	1.29002	1.27998	USD	10,865	0	0	0	0	0 -	0	10,865
86AYAPA6	15-01-2019 19:39:44	8WUL5BAL	07-01-2019 13:23:22	EUR/JPY -	SELL	1	124.001	123.401	JPY	6,000	-34	0	0	0	0 -	0	5,966
94FNMFAT	18-01-2019 16:48:36	9T2EPLAV	17-01-2019 17:17:28	GBP/USD -	SELL	1	1.29503	1.29001	USD	5,494	0	0	0	0	0 -	0	5,494
94FE99AZ	18-01-2019 16:48:52	9T3DXFAP	17-01-2019 19:41:33	AUD/JPY -	SELL	1	78.804	78.757	JPY	470	0	0	0	0	0 -	0	470
97SVXDBB	22-01-2019 04:53:46	9QR7B5AU	15-01-2019 08:05:38	AUD/JPY -	SELL	1	78.501	78.126	JPY	3,750	-451	0	0	0	0 -	0	3,299
4KDYNDA6	25-01-2019 16:08:43	4KEQKBAT	07-11-2018 01:03:34	GBP/USD -	BUY	1	1.31259	1.3176	USD	5,477	-6337	0	0	0	0 -	0	-860

各証券会社別の約定情報形式（c社）

1.4E+09	2019/10/1 23:58	決済	1401434665	GBP/JPY		1	131.86	20	1	300	-99	0	201
1.4E+09	2019/10/1 23:39	決済	1401706687	USD/JPY		1	107.82	20	1	100	-7	0	93
1.4E+09	2019/10/1 23:13	決済	1401709718	USD/JPY		1	107.93	20	1	90	-7	0	83
1.4E+09	2019/10/1 23:04	決済	1401713371	USD/JPY		1	108.02	20	1	100	-7	0	93
1.4E+09	2019/10/1 23:00	決済	1401717539	USD/JPY		1	108.12	20	1	100	0	0	100
1.4E+09	2019/10/1 23:00	決済	1401454171	GBP/JPY		1	132.16	20	1	300	-94	0	206
1.4E+09	2019/10/1 23:00	決済	1401721445	USD/JPY		1	108.22	20	1	100	0	0	100
1.4E+09	2019/10/1 23:00	決済	1401728425	USD/JPY		1	108.33	20	1	90	0	0	90
1.4E+09	2019/10/1 22:23	決済	1401690106	GBP/JPY		1	132.46	20	1	290	-16	0	274
1.4E+09	2019/10/1 21:05	決済	1401719452	GBP/JPY		1	132.77	20	1	290	0	0	290
1.4E+09	2019/10/1 19:22	決済	1401723172	USD/JPY		1	108.32	20	1	100	0	0	100
1.4E+09	2019/10/1 17:01	決済	1401721812	USD/JPY		1	108.32	20	1	100	0	0	100
1.4E+09	2019/10/1 2:58	決済	1401711763	GBP/JPY		1	132.77	20	1	290	0	0	290
1.4E+09	2019/9/30 21:40	決済	1401547615	USD/JPY	10		107.98	0	1	400	875	0	1275
1.4E+09	2019/9/30 19:59	決済	1401706738	GBP/JPY		1	132.76	20	1	300	0	0	300
1.4E+09	2019/9/30 14:08	決済	1401699533	USD/JPY		1	107.82	20	1	100	-22	0	78
1.4E+09	2019/9/28 3:59	決済	1401696835	USD/JPY		1	107.82	20	1	100	0	0	100

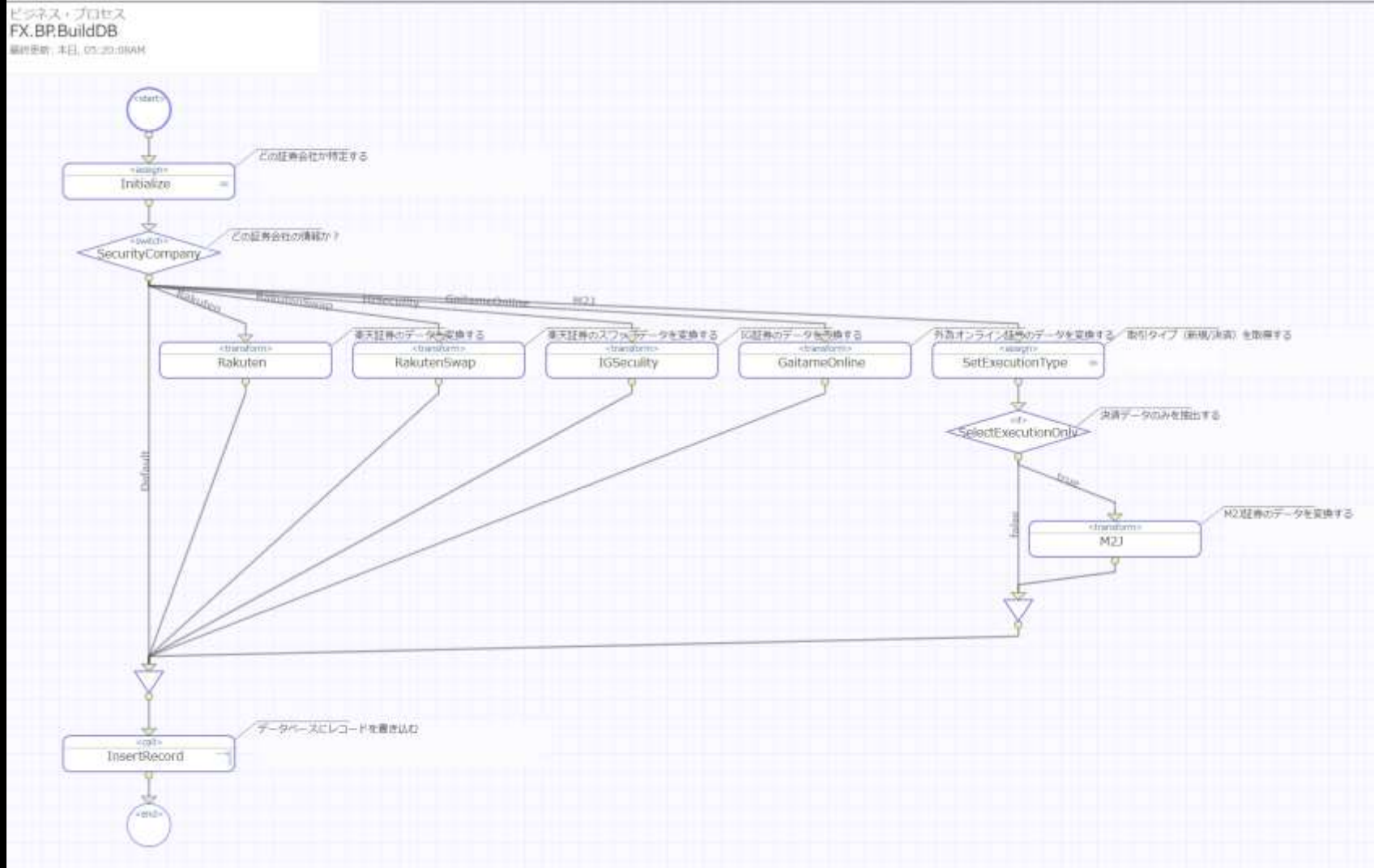
各証券会社別の約定情報形式（D社）

USD/JPY	買	新規	1000	107.7	107.7	107.7		2019/10/1 20:19	2019/10/2 0:34	1.19E+14
USD/JPY	買	新規	1000	107.8	107.8	107.8		2019/10/1 23:00	2019/10/2 0:16	1.19E+14
EUR/USD	売	新規	1000	1.092	1.092	1.092		2019/9/30 21:13	2019/10/2 0:05	1.19E+14
USD/JPY	買	新規	1000	107.9	107.9	107.9		2019/10/1 20:19	2019/10/1 23:37	1.19E+14
USD/JPY	売	決済	1000	108.1	108.068	108.068	273	2019/10/1 16:28	2019/10/1 23:00	1.19E+14
USD/JPY	売	決済	1000	108.2	108.2	108.2	306	2019/10/1 17:38	2019/10/1 20:19	1.19E+14
USD/JPY	売	決済	1000	108.2	108.2	108.2	505	2019/10/1 12:01	2019/10/1 20:19	1.19E+14
EUR/JPY	売	新規	1000	118.1	118.1	118.1		2019/9/30 21:14	2019/10/1 18:16	1.19E+14
EUR/JPY	買	決済	1000	117.6	117.6	117.6	500	2019/9/26 19:43	2019/9/30 21:14	1.19E+14
EUR/USD	買	決済	1000	1.09	1.09	1.09	307	2019/9/2 22:10	2019/9/30 21:13	1.19E+14
EUR/USD	売	新規	1000	1.09	1.09	1.09		2019/9/2 22:10	2019/9/30 21:13	1.19E+14
EUR/USD	買	決済	1000	1.092	1.092	1.092	218	2019/9/27 4:33	2019/9/30 20:12	1.19E+14
EUR/JPY	買	決済	1000	117.84	117.84	117.84	500	2019/9/25 9:53	2019/9/30 20:11	1.19E+14
USD/JPY	売	決済	1000	107.8	107.8	107.8	304	2019/9/27 19:12	2019/9/28 0:38	1.19E+14
USD/JPY	売	決済	1000	107.9	107.894	107.894	298	2019/9/27 19:41	2019/9/28 0:37	1.19E+14
EUR/JPY	売	新規	1000	118.34	118.34	118.34		2019/9/25 9:53	2019/9/27 23:55	1.19E+14
EUR/USD	売	新規	1000	1.094	1.094	1.094		2019/9/27 4:33	2019/9/27 21:41	1.19E+14
EUR/JPY	売	新規	1000	118.1	118.1	118.1		2019/9/26 19:43	2019/9/27 19:42	1.19E+14
USD/JPY	買	決済	1000	107.7	107.664	107.664	266	2019/9/27 4:35	2019/9/27 0:00	1.19E+14

各証券会社別の約定情報形式（B社スワップ）

2019/10/1	スワップ	円	37	2019/9/28 6:00	約定No.1782	: ユーロ/ドル	売 [約定レート]1.09500 [建玉数量]5,000
2019/10/1	スワップ	円	37	2019/9/28 6:00	約定No.1781	: ユーロ/ドル	売 [約定レート]1.09300 [建玉数量]5,000
2019/10/1	スワップ	円	-18	2019/9/28 6:00	約定No.1780	: ドル/円	売 [約定レート]108.000 [建玉数量]2,000
2019/10/1	スワップ	円	1	2019/9/28 6:00	約定No.1779	: ユーロ/円	売 [約定レート]117.700 [建玉数量]5,000
2019/10/1	スワップ	円	-28	2019/9/28 6:00	約定No.1774	: 豪ドル/スイス	売 [約定レート]0.67000 [建玉数量]5,000
2019/10/1	スワップ	円	1	2019/9/28 6:00	約定No.1765	: ユーロ/円	売 [約定レート]116.500 [建玉数量]5,000
2019/10/1	スワップ	円	21	2019/9/28 6:00	約定No.1764	: ポンド/ドル	売 [約定レート]1.20977 [建玉数量]5,000
2019/10/1	スワップ	円	1	2019/9/28 6:00	約定No.1763	: ユーロ/円	売 [約定レート]116.345 [建玉数量]5,000
2019/10/1	スワップ	円	-43	2019/9/28 6:00	約定No.1754	: ドル/円	売 [約定レート]106.000 [建玉数量]5,000
2019/10/1	スワップ	円	-14	2019/9/28 6:00	約定No.1753	: 豪ドル/円	売 [約定レート]71.500 [建玉数量]5,000
2019/10/1	スワップ	円	-43	2019/9/28 6:00	約定No.1751	: ドル/円	売 [約定レート]105.800 [建玉数量]5,000
2019/10/1	スワップ	円	-43	2019/9/28 6:00	約定No.1749	: ドル/円	売 [約定レート]105.600 [建玉数量]5,000
2019/10/1	スワップ	円	-14	2019/9/28 6:00	約定No.1748	: 豪ドル/円	売 [約定レート]71.200 [建玉数量]5,000
2019/10/1	スワップ	円	-14	2019/9/28 6:00	約定No.1747	: 豪ドル/円	売 [約定レート]71.041 [建玉数量]5,000
2019/10/1	スワップ	円	-43	2019/9/28 6:00	約定No.1745	: ドル/円	売 [約定レート]105.404 [建玉数量]5,000
2019/10/1	スワップ	円	-21	2019/9/28 6:00	約定No.1730	: ポンド/円	売 [約定レート]128.000 [建玉数量]5,000

ビジネスプロセス



DTLエディター（データ変換）

Interoperability > データ変換ビルダ - (FX.Transformation.IGSecurity)

新規 開く 保存 名前をつけて保存 コンパイル 100% -アクションを適用-

ソース: FX.IGSecurity.Record ターゲット: FX.Response.DBLoadMessage

source target

source fields: %Source, ClosingRef, ClosedDateTime, OpeningRef, OpenDateTime, Market, Period, Direction, Size, Opening, Closing, TradeCurrency, ProfitLoss, Funding, Borrowing, Dividends, LRPrem, Others, CommCurrency, Comm, Total

target fields: Broker, OpenDate, CloseDate, CurrencyPair, BuySell, TransactionUnit, OpenPrice, ClosePrice, ProfitLoss, FundingCost

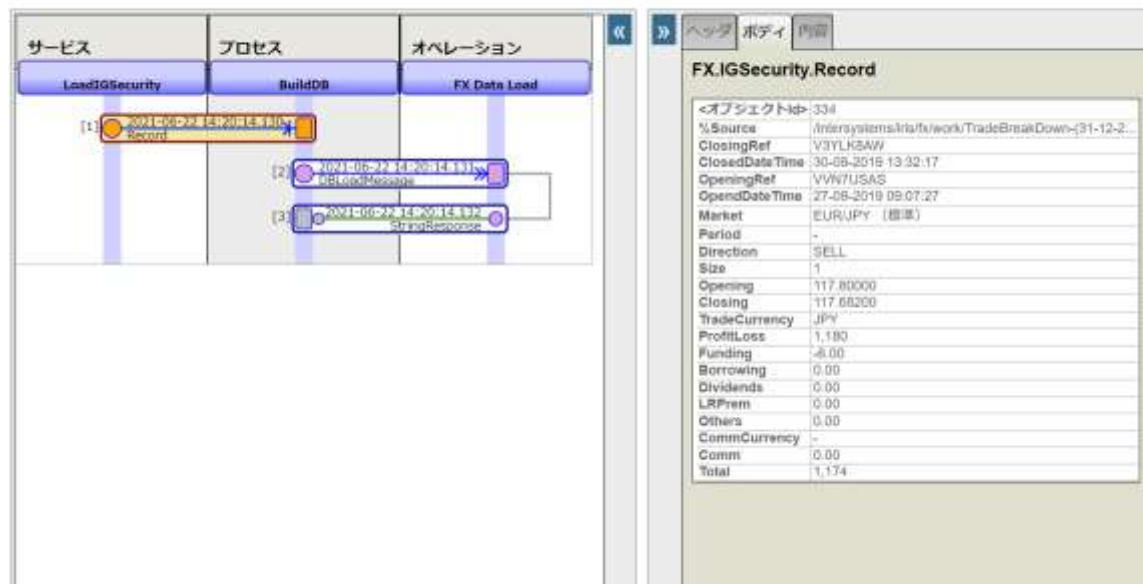
Actions:

#	アクション	条件	プロパティ	値	キー / 変換
1	set		target.BuySell	.Lookup("BuySell", source.Direction)	-
2	set		target.TransactionUnit	source.Size*10000	-
3	set		target.ProfitLoss	#class(FX.Utility.TextHandling).RemoveComma(source.ProfitLoss)	-
4	set		target.OpenPrice	source.Opening	-
5	set		target.ClosePrice	source.Closing	-
6	set		target.FundingCost	source.Funding	-
7	set		target.OpenDate	.ConvertDateTime(source.OpenDateTime, "%d-%m-%Y %T", "%Y%m%d")	-
8	set		target.CloseDate	.ConvertDateTime(source.ClosedDateTime, "%d-%m-%Y %T", "%Y%m%d")	-
9	set		target.CurrencyPair	.Piece(source.Market, ", 1)	-
10	set		target.Broker	"IGSecurity"	-

データ変換前後

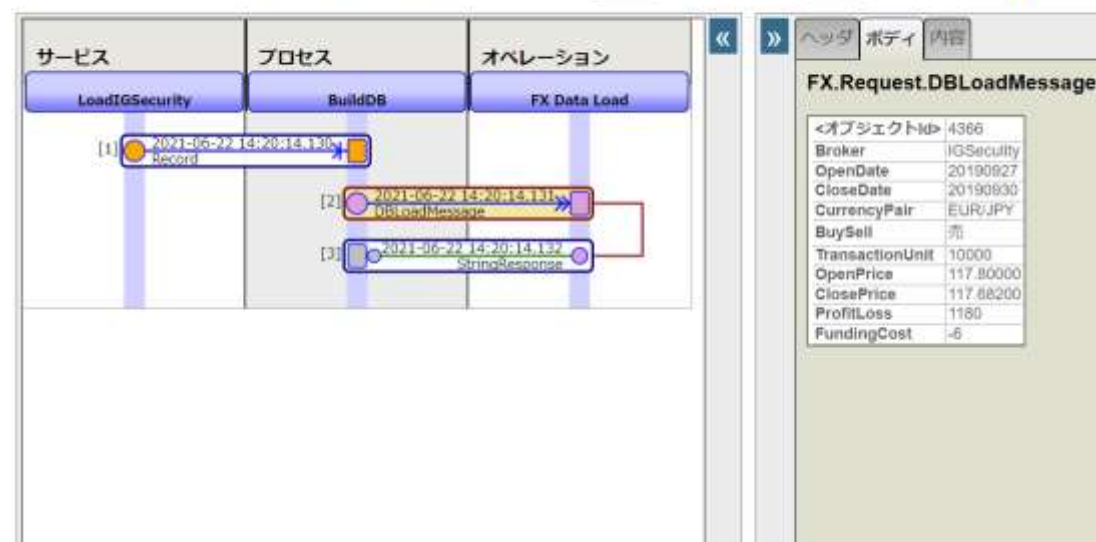
ビジュアル・トレース

セッションID: 4527 印刷バージョン アイテムに移動 1-3 アイテム/ページ 40 イベントを表示 内部アイテムを表示 フィルタを



ビジュアル・トレース

セッションID: 4527 印刷バージョン アイテムに移動 1-3 アイテム/ページ 40 イベントを表示 内部ア

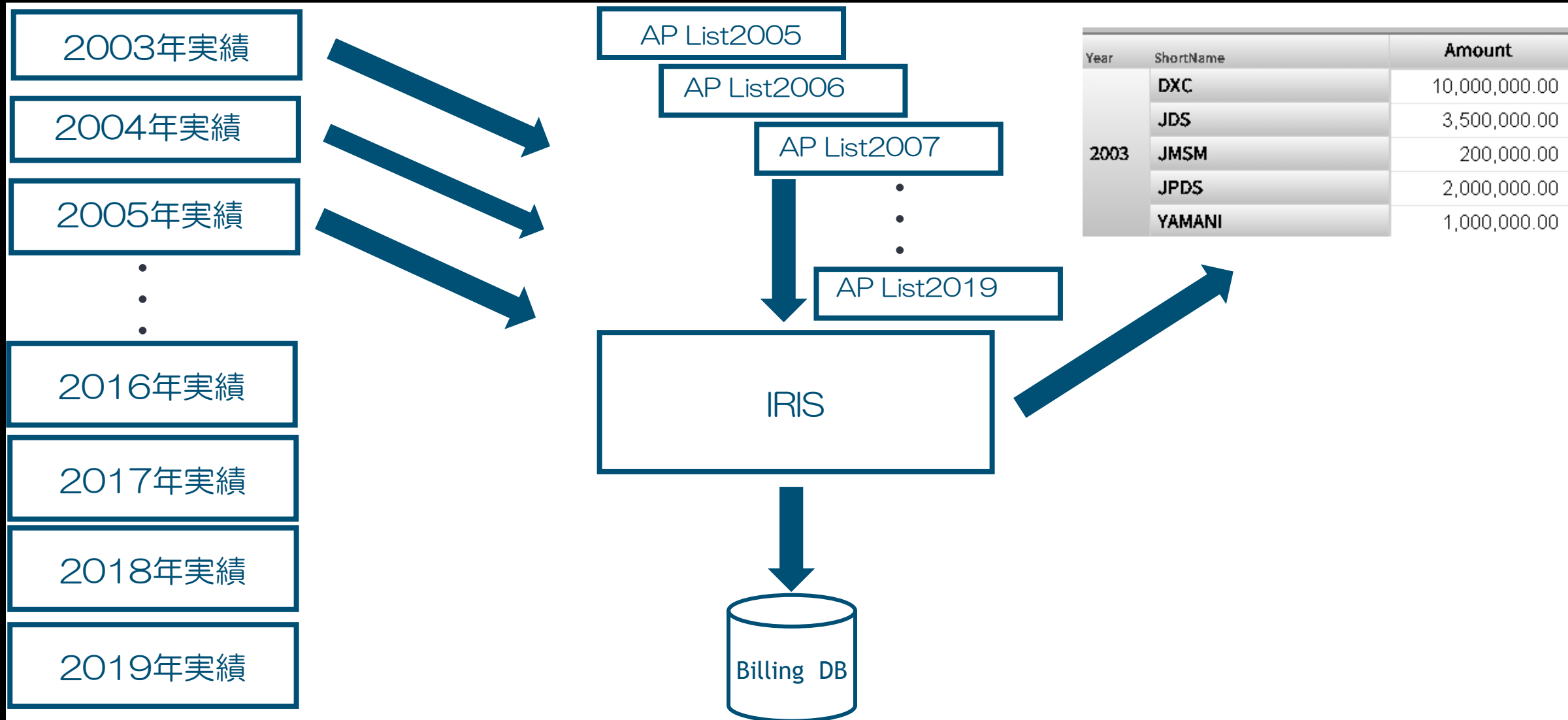


ISJ Billing 情報分析

インターシステムズジャパンの売り上げ情報を可視化するシステム

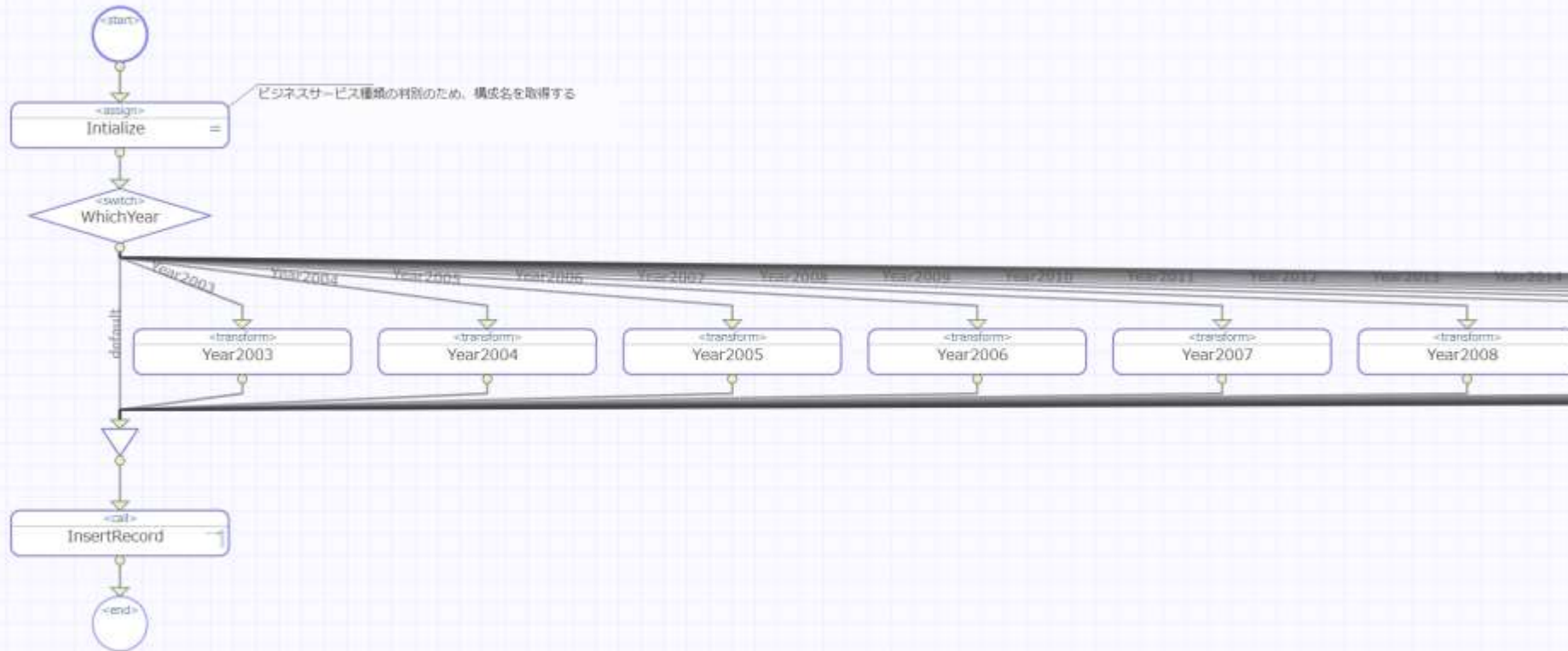
- 毎年レポート形式が異なる
- 営業担当のデータが入っていないケースがある
- 合併、買収などで顧客名が変わるが、同一エンティティとして管理したい
- 集約したレコードからキューブを生成し、顧客別、年別、担当営業別等の収益を可視化する

IRIS ISJ Billing データ収集構成図

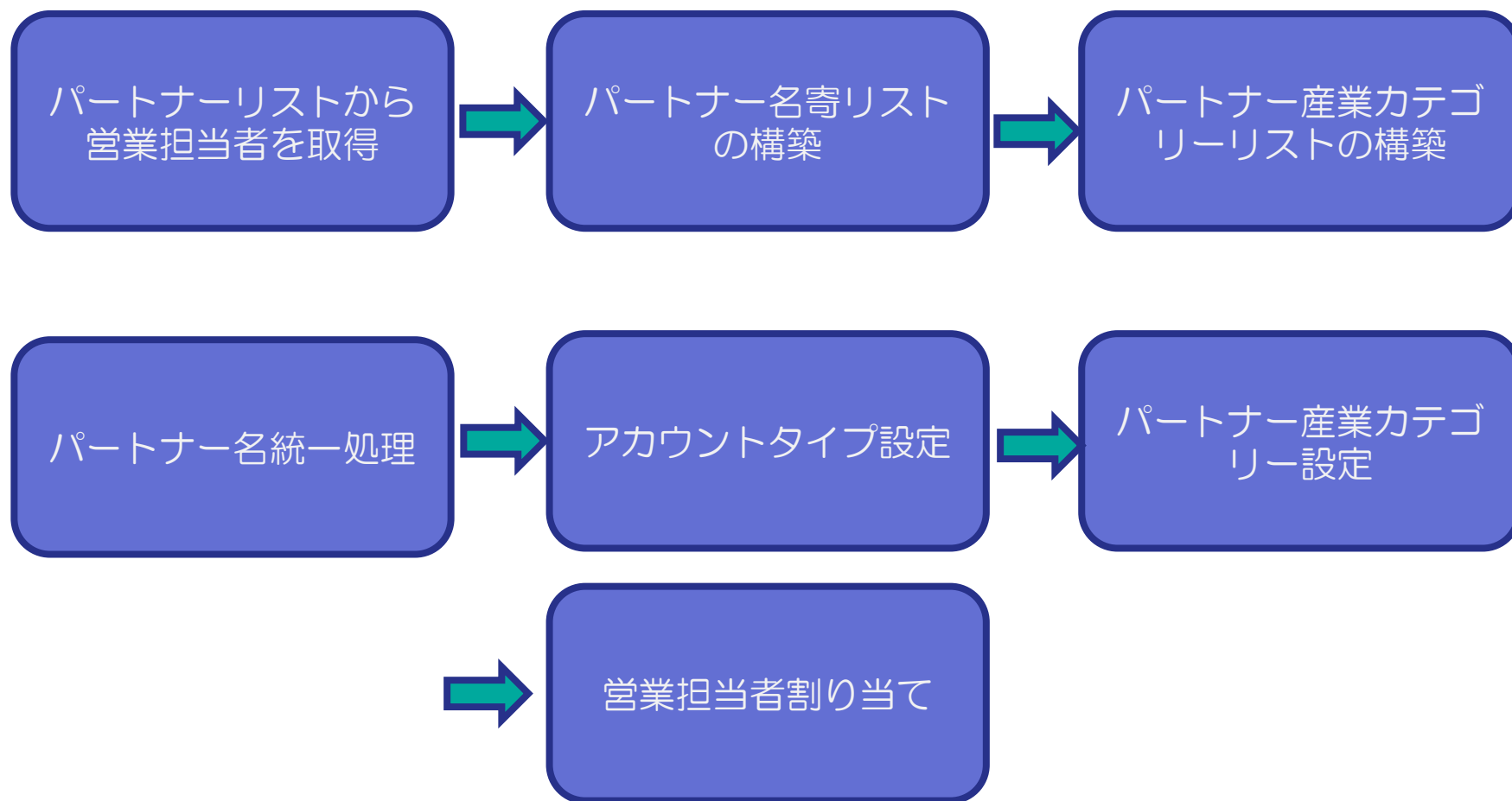


ビジネスプロセス（データロード）

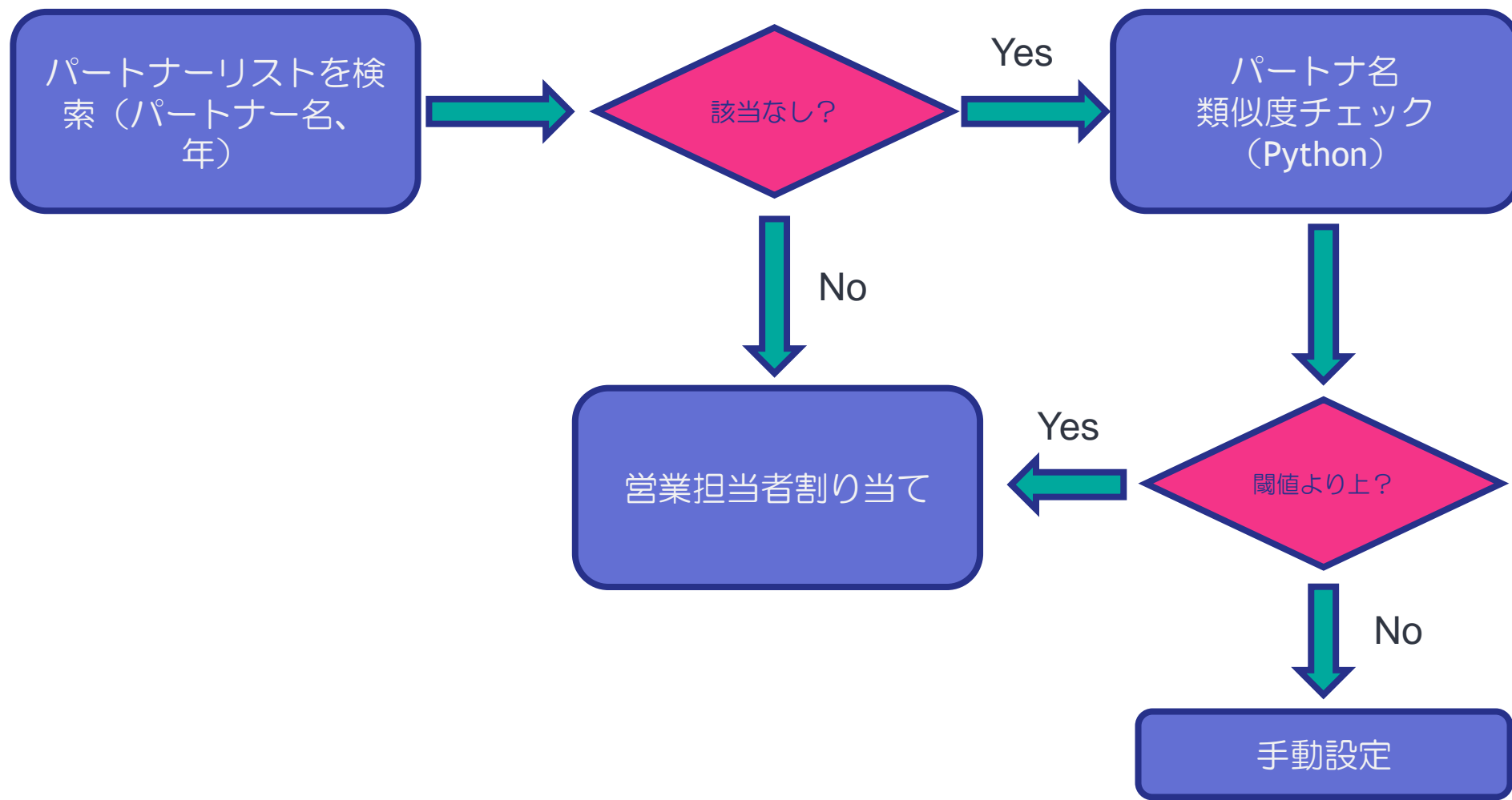
ビジネス・プロセス
ISJ.BP.CollectBilling
最終更新: 本日, 05:38:14AM



データクレンジング処理



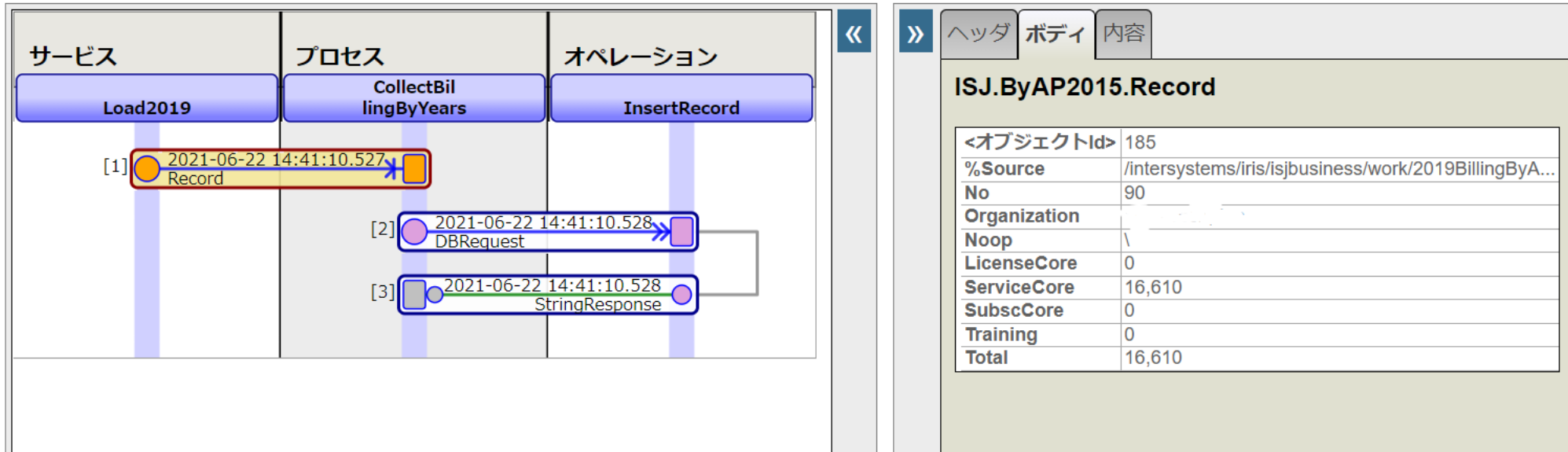
データクレンジング処理（営業担当割り当て）



ビジュアルトレース

ビジュアル・トレース

セッションID: 4643 国 凡例 印刷バージョン アイテムに移動 1 - 3 ▼ アイテム/ページ 40 ▼ イベントを表示 ☒ 内部アイテムを表示 ☐ フィルタを



ビジュアルトレース

ビジュアル・トレース

セッションID: 4643 国 凡例 印刷バージョン アイテムに移動 1-3 アイテム/ページ 40 イベントを表示 ☒ 内部アイテムを表示

