

2021年2月26日
ブルームバーグ・エル・ピー

**レオス・キャピタルワークスが流動性規制改正の対応として
ブルームバーグの流動性リスク分析ソリューションを採用**
ひふみ投信で名を馳せる資産運用会社が改正後の円滑な運用に向けて対応



【東京－2021年2月26日】ブルームバーグは、レオス・キャピタルワークスが、2022年1月より適用される[流動性規制改正](#)にいち早く対応することを目的とし、ブルームバーグの[受賞歴のある](#)流動性リスク分析(LQA)ソリューションを採用、実装されたことを発表しました。

レオス・キャピタルワークスは「資本市場を通じて社会に貢献します」という経営理念のもと、2003年に創立された資産運用会社です。成長企業の目利き力や柔軟な運用スタイル、そして運用者の顔が見えることなどが支持され、2020年12月末時点では8,783億円の資金をお預かりし、運用しています。旗艦ファンドである「ひふみ投信」は株式会社格付投資情報センター(R&I)が選定する「R&Iファンド対象 2020」投資信託10年／国内株式部門にて最

優秀ファンド賞を受賞しています。また、自社サイト、セミナー、YouTube や SNS などを通じて、投資そのものの魅力や楽しさを伝え、安心して資産形成に取り組めるようにコンテンツ配信にも取り組んでいます。

レオス・キャピタルワークスの代表取締役会長兼社長・最高投資責任者である藤野英人氏は次のように述べています。「レオス・キャピタルワークスの投資哲学の中心にあるのは、国内外の高成長企業で、キャピタルリターンを長期にわたって生み出し続けることです。そのためには、変化するマーケットに対応して銘柄の入替をスムーズに行う必要がありますが、ファンドサイズが大きくなるに従い、流動性をより考慮した運用が求められます。そこで、レオス・キャピタルワークスではブルームバーグの流動性評価(LQA)ソリューションを使って、ポートフォリオの流動性リスク水準を確認し、適正水準を維持する体制を取ることで、資産運用会社としての責任の遂行と運用の最良執行を目指しています。」

レオス・キャピタルワークスは、データ取得、分析、モニタリング、ストレステスト、結果取得までの全過程を一気通貫できるエンタープライズ型の流動性規制対応ソリューションである、LQA を採用し、ブルームバーグの API を介してご活用いただいています。当該 API は、ブルームバーグが提供する流動性データへの直接アクセスすることを可能にします。お客様の社内システムやエクセルを使いデータにアクセス出来るため、ダッシュボードを最適化しやすく、また利便性が高く、日本政府規定から求められている各公募投信における流動性分類、閾値設定およびモニタリングも円滑に行えます。また、データ取得および分析対象は個別銘柄、ファンド、複数ファンドを網羅し、ストレス環境下でも分析結果を取得可能とします。そして、ETF へも、単体またはルックスルーでの対応をしています。

ブルームバーグの在日代表であるノーマン・トウエイボームは次のように述べています。「IOSCO の提言を踏まえ公表された流動性規制は、投資信託運用者に大きな影響を与えるもので、日本でも最適かつ包括的なフレームワークが求められていました。このような環境下で、レオス・キャピタルワークスは迅速かつ積極的に対応策の策定に取り組まれ、弊社サービスを採用くださいました。常に先手先手を打つ姿勢を持つレオス・キャピタルワークスのビジネスパートナーであることを非常に嬉しく思います」

LQA の詳細は、[こちら](#)からご覧いただけます。

ブルームバーグについて

ブルームバーグは、世界のビジネス・金融情報およびグローバルニュースを提供する情報サービス企業です。情報・人・アイデアをダイナミックなネットワークでつなぎ、有力な意思決定権者にビジネスの勝敗を左右する強力な情報ツールを提供します。ブルームバーグの最大

の強みは、迅速かつ正確なデータ、ニュース、分析機能を革新的な技術を用いて提供していることで、これがブルームバーグ ターミナル・サービスの中核を成しています。ブルームバーグのエンタープライズ・ソリューションは、この中核となる情報・技術の上に構築されており、組織全体におけるデータや情報へのアクセスから統合、配信、管理まで、より効率的かつ効果的な業務遂行を支援します。詳細については、www.bloomberg.com をご覧いただくか、[デモをリクエスト](#)してください。

レオス・キャピタルワークスについて

レオス・キャピタルワークスは「資本市場を通じて社会に貢献します」という経営理念のもとに2003年に創業した資産運用会社です。ひふみ投信を始めとして運用・販売する投資信託「ひふみ」シリーズは、守りながらふやす運用でお客様の長期にわたる資産運用を応援します。また投資顧問業においては、国内外の企業年金基金、機関投資家のお客様の資産を受託、運用しております。 <https://www.rheos.jp/>