

2021年8月4日
ブルームバーグ・エル・ピー

*本プレスリリースは Bloomberg が2021年7月27日に英語で発表を行ったプレスリリースを日本語に翻訳・再編集したものです。オリジナルのプレスリリースの正式言語は英語であり、この内容および解釈については下記の英語版が優先となります。英文オリジナルにつきましては[こちら](#)のサイトをご参照ください。

ブルームバーグ、市場データに基づき日次で算出する信用リスク指標を提供開始

ブルームバーグのプライシング・サービス「BVAL」のデータを活用した強力な早期警戒指標により、
利用者は積極的に信用リスクを軽減し、取引や投資の機会を見出すことが可能に

【ニューヨーク - 2021年7月27日】ブルームバーグは本日、市場データに基づき算出する信用力の指標「MIPD (Market-Implied Probability of Default)」を、同社のサービス「エンタープライズ・データ」および「ブルームバーグターミナル」の利用者に向けて、全世界で提供を開始したことを発表しました。MIPD を活用することで、信用力の指標を既存のワークフローに簡単に組み込むことができ、信用リスク管理をより包括的に行うことができます。

ブルームバーグのエンタープライズ・データ・コンテンツ部門のグローバルヘッドであるブラッド・フォスターは、次のように述べています。「市場参加者は一般的に、公式の格付け機関によるダウングレードやデフォルト(債務不履行)が発生する前段階において、クレジットイベントの可能性を認識しています。クレジット・デフォルト・スワップ(CDS)の価格は指標として機能しますが、取引される発行体の数が少なく、流動性が低下しているため、指標としての精度には限りがあります。MIPD は、BVAL(ブルームバーグ・バリュエーション)の豊富なデータセットに裏打ちされた市場センチメントを定量化することで、幅広い償還期限の発行体の信用力を早期に評価し、特定の発行体に関するニュースや市場全体の事象など、変化する市場環境に対応するための強力なツールとなります」

MIPD は、評価価格を算出して最高品質のプライシング・サービスを提供するブルームバーグの BVAL のデータを組み込んだ、迅速性や透明性の高い信用リスクの日次評価をお客様に提供し、債券市場のセンチメントの積極的な推定および市場や発行体の格付け状況の変化への迅速な対応を行います。このソリューションは、従来のクレジットアナリシスよりも早く、主要な格付けの引き下げやデフォルトといった信用力の低下に繋がる要因を予測し、お客様が自信を持ってリスクや投資に関する意思決定を行うことを可能にします。

MIPD は、エンタープライズ・データ・ソリューションのプレミアムサービスで、ブルームバーグ・データ・ライセンスをお持ちのお客様に加えて、ブルームバーグターミナルの新しい専用スクリーンでも、MIPD<GO>、W<GO>、Excel API からご利用いただけます。このソリューションには、36,000 以上の発行体および複数のセクターのインプライド・デフォルト確率が含まれており、1 年から 20 年までの期間構造をカバーしています。

ブルームバーグのエンタープライズ・データ事業では、プライシング、リファレンス、規制等の質の高いデータセット、リアルタイムのマーケット情報、イベントやニュースデータ、流動性分析に加え、データ管

Bloomberg

理や配信技術を提供しています。ブルームバーグの MIPD ソリューションの詳細については、[こちら](#)をご覧ください。

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端末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。詳細は、[こちら](#)にアクセスするか、デモを[リクエスト](#)してください。

報道関係者 お問い合わせ

ブルームバーグ広報代行: アシュトン・コンサルティング ac-bloomberg@ashton.jp