

*本プレスリリースはBloomberg L.P.が2024年10月15日に国外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英語が優先となります。英文オリジナルにつきましては以下のサイトをご参照ください。
<https://www.bloomberg.com/company/press/bloomberg-accelerates-its-presence-in-loans-market-with-launch-of-a-new-leveraged-loan-index-based-on-new-syndicated-loans-data-and-pricing-solution/>

プレスリリース

ブルームバーグ、新たなシンジケートローンのデータとプライシング・ソリューションを活用したレバレッジドローン・インデックスを発表ーローン市場でのプレゼンス高める

相互接続したデータソリューションに基づくレバレッジドローン・インデックスを発表ー従来不透明だった資産クラスに関する待ち望まれた洞察を投資家に提供

【2024年10月15日】ブルームバーグは本日、世界の複雑なシンジケートローン市場の投資機会を評価し捉えるのに役立つサービスの開始を発表しました。このサービスには、全世界で7万4000本のアクティブなシンジケートローン・トランシェをカバーする「シンジケートローン・データ・ソリューション」、新たに発表された最新情報をリアルタイムで取得する「新規発行」データフィード、ブルームバーグの価格評価サービス「BVAL」による高度なプライシングが含まれます。また、信頼性の高いベンチマークを求めらるお客さまのニーズに応えるため、合計時価総額1兆3000億ドルに上る1300本のレバレッジドローンをカバーする「米国レバレッジドローン・インデックス」の算出を開始しました。

ブルームバーグのインデックスをベンチマークに

[ブルームバーグ米国レバレッジドローン・インデックス](#)は、ブルームバーグの債券インデックス・シリーズに加わった最新のインデックスで、50年以上にわたり業界をリードしてきた[ブルームバーグ債券インデックス](#)と同等の高い客観性、代表性、透明性を誇ります。米国レバレッジドローン投資家の皆様は、同インデックスを信頼性の高いポートフォリオベンチマーク、そして市場の参考情報として、またインデックス連動商品の参照インデックスとしても、ご利用いただけます。

ブルームバーグ・インデックス・サービスズ・リミテッドの債券インデックスプロダクト部門を統括するニック・ジェンドロンは、次のように述べています。「より透明性の高い形でレバレッジドローン市場にアクセスする手段には、かねてより非常に強い需要がありました。ブルームバーグの新しいレバレッジドローン・インデックスと、その基礎となるデータソリューションにより、私たちはこの市場の投資家の皆様に革新的で、新しい選択肢を提供し、投資家の皆様が抱えるギャップに対応します。今回の発表は、ブルームバーグ債券インデックス・シリーズを拡充し、お客さまに高い価値を提供するという私たちのコミットメントにおいて大きな節目となります。」

ブルームバーグ米国レバレッジドローン・インデックスは、合計時価総額1兆3000億ドルに上る1300本のローンで構成され、過去データは2019年1月まで遡って算出しています。

主な特長は以下の通りです。

- 受賞歴のあるブルームバーグの価格評価サービス、[BVAL](#)による独自のプライシングに基づき、ローンのパフォーマンスに関する正確でタイムリーな洞察を提供します。
- すべてのブルームバーグ債券インデックスと同様に、月末のリバランス時に更新されるリターンユニバースと、毎日更新と公表が行われる予想ユニバースの情報を入手可能なため、次回のリバランス時に予想されるインデックスの構成を把握できます。
- ブルームバーグの他の代表的なインデックスと組み合わせて、コンポジット・インデックスを作成できます(ハイイールド+ローン・インデックスなど)。
- 金融商品グローバル識別子(FIGI)とブルームバーグのID BBをローン識別子として使用することで、ブルームバーグのローン参照データとの相互運用性を高め、取引ワークフローの合理化を実現しています。
- 透明性の高いルールベースの算出法を採用することで、指数の構築とリバランスのプロセスを明確にしています。
- MEMB <GO>では同インデックスを構成するローン銘柄情報が日次ベースで更新されたり、PORT <GO>ではポートフォリオ分析に活用できたりなど、ブルームバーグ端末とシームレスに連携します。

ブルームバーグの相互接続データで、ローンのシンジケーションなどの発表を素早く把握

新たなレバレッジドローン・インデックスの基盤となるのは、ブルームバーグのシンジケートローン・データソリューションです。同ソリューションでは、15年前までさかのぼった世界のシンジケートローン市場を網羅しています。データベースは200カ国以上、85通貨の7万4000本に上るアクティブなローンで構成され、BVALがさまざまなスナップショットで毎日、ローンのプライシングを行っています。データは、取引ワークフローにおける適切な価格と流動性の発見、証券マスターと価格データ管理による業務プロセスの強化、規制順守の支援に利用できます。また弊社は、新たに発行されたローンの設定と自動認識のために、リアルタイムの「新規発行」情報フィードを提供しています。これは、市場でのレバレッジドローンの発行とその取引情報の推移をモニターするものです。

ブルームバーグのシンジケートローン・データは、市場取引時間中はB-PIPEを通じて、取引時間終了後はブルームバーグ端末を通じてデスクトップ上、もしくはデータライセンスで全社的にご利用いただけます。管理アクセスの場合はDL+を通じてご利用になれます。ブルームバーグ ターミナルをご利用のお客さまは、[{LOAN Index <GO>}](#)でレバレッジドローン・インデックス(ティッカー: LOAN)にアクセスし、[{PREL <GO>}](#)で新規発行ローンをモニターできます。この新たなインデックスに関するファクトシート、算出方法、リサーチは、[ブルームバーグ債券インデックスの発表資料ページ](#)でご覧いただけます。

ブルームバーグ・インデックス・サービス・リミテッドについて

ブルームバーグのインデックスチームは、代表的な債券インデックスやブルームバーグ商品指数、ブルームバーグ株価指数など、資産クラスを問わず、業界をリードするインデックスを開発してきた実績を誇ります。より革新的なアプローチで、市場参加者の進化する投資ニーズを満たす戦略的ベンチマークを提供しています。ブルームバーグの各種ソリューションとシームレスに統合され

Bloomberg

ているブルームバーグのインデックスは、包括的で幅広い信頼できるデータと確かなテクノロジーを活用して算出されています。計算、分析、ワークフロー自動化などにご利用いただけるほか、ブルームバーグの高い情報配信の基盤によりお客さまの金融商品の認知度の向上をご支援します。

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・金融情報のリーディング・カンパニーとして、市場に透明性、効率性、公平性をもたらす、信頼性の高いデータ、ニュース、インサイトを提供しています。当社は、お客さまがより多くの情報に基づいた意思決定を行い、より良いコラボレーションを促進することを可能にする、信頼性の高いテクノロジー・ソリューションを通じて、世界の金融エコシステムにおいて影響力のあるコミュニティーをつなぐ支援をしています。詳細については、[こちら](#)をご覧ください。また、[デモをリクエスト](#)してください。