

日興アセットマネジメントがリスク管理と業務戦略の強化に ブルームバーグの技術を採用

大手資産運用会社による導入で最先端のポートフォリオ・リスク管理プラットフォームが業界の新基準に

【東京ー2018年5月25日】ブルームバーグは本日、アジア太平洋地域の資産運用会社最大手のひとつである日興アセットマネジメント(以下「日興 AM」)が、マルチアセット運用戦略のサポートツールとして、ブルームバーグのポートフォリオ&リスク分析プラットフォーム(PORT)を採用したことを発表しました。

東京を本拠としてグローバルに展開する日興 AM の運用資産総額は 2,115 億ドルを上回ります。同社は企業、年金基金、信託銀行、地方銀行、政府系機関の皆様に対し、投資顧問や資産運用サービスを提供しています。

日興 AM はポートフォリオの構造の把握、ポジション分析、顧客の皆様への主要データの開示にブルームバーグの PORT を活用しています。これにより、取引時間中のパフォーマンスのモニタリングに加え、総リスク・エクスポージャーやバリュー・アット・リスク (VaR) などの主要指標の計測、ポートフォリオの基本的な特性や日次ベースのシナリオ分析といった同社の業務フローにおいて効率化を進めました。また、PORT の自動レポート機能により、日興 AM のお客様である機関投資家の皆様はレポート作成時の手入力業務が軽減され、大幅な時間の節約と生産性の向上につながっています。

日興 AM の柴田拓美代表取締役社長兼 CEO 次のように述べています。「機関投資家のリスク管理能力強化のために協力することは、資産運用会社にとって重要な責務です。投資信託への投資を開始してまもない機関投資家にとっては、リスク管理能力の強化は喫緊の課題です。私募投資信託に対する金融機関からの需要の全国的な高まりを受け、日興アセットマネジメントは、ブルームバーグ社の協力を得て、リスク・マネジメント・システムを構築し、銀行および機関投資家が保有私募投信についてモニター、分析、要因分析およびリスク管理が出来る機能の提供を開始しました。資産運用各社によるこのシステムへの参加は自由であり、それぞれ顧客の用に供することができます。運用会社の手間はファンドのデータをシステムにアップロードするだけであり、それだけで顧客と一対一かつ安全なデータのやり取りが可能になります。顧客にとっては通常のターミナル使用料以外の追加費用は生じません。日興アセットマネジメントは、運用他社のデータへアクセスすることはなく、運用他社へ費用の徴求をすることもありません。運用他社と協力しつつ、投資信託商品の透明性を高める機会を持つことは、幸いです。」

日興 AM の三品雅人機関投資家事業本部副本部長は次のように述べています。「この厳しい環境下、お客様の追加負担なしに、リスク管理の高度化のお手伝いできるのは、意義深いものと考えております。この流れが業界全体に広がることを期待しております。」

ブルームバーグの在日代表である石橋邦裕は次のように述べています。「日興 AM がブルームバーグを長期的なテクノロジーパートナーとして選んでいただき、当社の多くのソリューションを採用していただいたことを非常に嬉しく思います。PORT は広範囲のポートフォリオ管理、業務フロー効率化を達成するにおいて要となるツールです。日興 AM は本サービスを採用したことにより、ポートフォリオおよびリスク管理における業界の新たな基準を設定されました。」

日興 AM は注文管理業務を支援するブルームバーグのアセット&インベストメント・マネジャー (AIM)、株式取引執行管理システム (EMSX)、債券取引執行管理機能 (TSOX)、および取引コスト分析機能 (BTCA)、ポートフォリオ&リスク分析 (PORT) を活用しています。

ブルームバーグについて

グローバルビジネス、金融情報、ニュースにおけるリーダーであるブルームバーグは、情報、人、アイデアのダイナミックなネットワークを通じて、影響力のある意思決定者の皆様に決定的な優位性を提供します。ブルームバーグの根幹ビジネスである**ブルームバーグターミナル**は、革新的テクノロジーを基盤に、データ、ニュース、分析機能を迅速かつ正確に配信します。ブルームバーグのエンタープライズソリューションズは、テクノロジーを活用し、お客さまが効率的、効果的に、データ、情報にアクセスし取り入れ、配信、管理するというブルームバーグの強みに基づいています。詳細に関しては次のリンク先 <http://about.bloomberg.co.jp/> をご覧いただくか [こちらよりデモをご要望ください](#)。

PORT について

PORT はブルームバーグが誇るポートフォリオ&リスク分析の旗艦アプリケーションであり、顧客の皆様はこのツールを通じて、株式や債券、またはマルチアセットクラスで構成されるポートフォリオの過去のパフォーマンスの分析、ストラクチャーの把握、リスクの測定、投資アイデアのシミュレーションが可能になります。PORT Plus ではポートフォリオ&リスク分析への拡張アクセスといった追加サービスを提供し、分析計算で使用する価格の設定、追加のポートフォリオベンチマークを自動アップロードするスケジュールの設定、PORT レポートの配信など、管理者が集中管理するために使用するツールです。PORT は、資産運用会社、ミューチュアルファンド、ヘッジファンド、年金基金にとって不可欠なツールです。

日興アセットマネジメントについて

日興アセットマネジメントは、日本そしてアジアを代表する資産運用会社です。株式、債券、オルタナティブ、マルチアセットなど多様な資産クラスを対象とするアクティブ運用や ETF(上場投資信託)を含むパッシブ運用など、革新的な投資ソリューションを提供しています。

55 年を超える実績を誇り、30 以上の国・地域から集まる人材を世界 9 カ国・地域に擁して、約 200 名の運用プロフェッショナルが約 23.8 兆円の資産を運用しています。グローバルな視点を活かし、お客様のニーズにお応えする様々な商品の開発を推進するとともに、優れた運用パフォーマンスの実現を常に追求しています。銀行などの金融機関、証券会社、生命保険・損害保険、ファイナンシャルアドバイザーなど、国内外の計 300 社超の販売ネットワークを通じ、個人投資家の皆様や年金基金や金融機関など世界中の機関投資家のお客様に対して幅広いサービスを提供しています。

詳しくは、日興アセットマネジメントの [HP](#) をご覧ください。

* 日興アセットマネジメント株式会社および連結子会社の役社員を含む。

** 日興アセットマネジメント株式会社および海外子会社の連結運用資産残高(投資助言を含む)の 2017 年 12 月末現在のデータ。

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 03-5425-7220

ブルームバーグ広報: 03-3201-8900