

プライベート市場向けEDF-X

潜在的な信用悪化と投資機会を示す早期警戒指標

プライベートクレジット投資家は、透明性が限られ、財務データが乏しく、リスクが刻一刻と変化する環境で運用を行っています。EDF-Xは、信用悪化が、業績の悪化、格付アクション、またはコベナンツ違反として顕在化するかなり前の段階で、貸し手や資産運用会社にフォワードルッキングな視点を提供するように設計されています。

可視化された情報とその重要性

プライベート市場では、タイミングがすべてです。ポイント・イン・タイム指標のデフォルト確率(PD)やインプライド・レーティングは、足元の信用リスクを示します。一方、早期警戒シグナルは、潜在的なリスクの方向性を明らかにし、資産運用会社がより早期に介入して資本を保護し、他者が見逃した可能性のある投資機会を見つけるのに役立ちます。EDF-Xは、複雑なリスクシグナルを明確でフォワードルッキングな情報に変換し、クレジット・ポートフォリオ全体で迅速かつ確かなアクションを後押しするように設計されています。その結果、次のような価値を提供します。

- **リスクの上昇を早い段階で可視化し、エンゲージメントの強化、リストラクチャリング、リプライシング、またはエグジットなどの意思決定をサポートします。**
- **ポートフォリオ全体で優先順位をより明確化し、最も介入効果の大きい領域に時間と資金を集中できるようになります。**
- **ポートフォリオの方向性に対する透明性が向上し、信用リスクの足元の状況だけでなく、安定方向なのか、悪化方向なのか、潜在的なトレンドを示すシグナルを提供します。**

データに基づく早期リスク指標

EDF-Xは、ムーディーズが長年にわたり培ってきた信用リスクモデルを基盤とし、数十年分のデフォルト実績で実証済みのソリューションです。このフォワードルッキングなシグナルを利用することで、プライベートクレジット投資家は、損失が顕在化する前にエンゲージメントの強化、リストラクチャリング、リプライシング、エグジットなどの対応を取るためのリードタイムを確保できます。さらにEDF-Xは、投資およびリスク管理のワークフローに合わせて設計された実践的なインサイトを提供し、上場、非上場を問わず、あらゆるポートフォリオのモニタリングを1カ所で行えるようサポートします。

ポートフォリオ別のインサイト

- 最も重要な領域に注視するための、ポートフォリオ別のリスク分布
- 共通属性を用いてポートフォリオを無制限に細分化
- PDの推移を基に、ポートフォリオが改善傾向か悪化傾向かを分析するための明確な指標
- 直観的に解釈しやすくするため、リスクを格付相当の尺度で表現

世界各国の100種類以上の企業識別子を用いて、上場、非上場企業を問わず、簡単にポートフォリオを構築できます。

世界規模の早期警戒シグナル

EDF-Xは、財務リスクのインサイトを迅速に把握し、早期警戒シグナルを検知するためのムーディーズの旗艦ソリューションです。格付の有無や上場、非上場を問わず、世界中の企業をカバーしています。



財務情報が限られている場合でも、EDF-Xはオルタナティブデータ、高度な分析手法、洗練された機械学習技術を活用して、リスク指標を提供します。

業界最高水準のデータとリスクモデル

EDF-Xは、ムーディーズが保有する膨大な世界の企業データベースと受賞歴を誇る信用リスクモデルを組み合わせることで、スポンサー出資を受けたミドルマーケット企業から世界的な大企業に至るまで、プライベートクレジット全域にわたるインサイトを提供します。

- 100以上の識別子から選択して信用評価を取得
- 簡易グローバルテンプレートを使用して独自に入手・管理している財務情報をアップロード
- ウェブプラットフォームまたはAPIを介して情報にアクセスし、ポートフォリオのモニタリングとワークフローの自動化を支援

プライベート企業データにEDF-Xが選ばれる理由

企業のデフォルトリスクが高まり、経済の先行き不透明感が続く今日、プライベートクレジット投資家にとって早期警戒シグナルは「あると望ましい」ものではなく、「なくてはならない」ツールとなっています。EDF-Xは、事後対応型のリスク管理から先手を打つポートフォリオ運営へと転換を促し、より早い段階でのアクションや、より効果的な資本配分、防ぎ得る損失リスクの低減を自信をもって行えるようにします。

MOODY'S

お問い合わせ

詳細については、www.moody's.com/web/ja/jp.html#contact または、下記までお問い合わせください。

米国・カナダ・中南米

+1.212.553.1653
clientservices@moody's.com

欧州・中東・アフリカ

+44.20.7772.5454
clientservices.emea@moody's.com

アジア(除く日本)

+852.3551.3077
clientservices.asia@moody's.com

日本

+81.3.5408.4100
clientservices.japan@moody's.com

