

トムソン・ロイターのファイナンシャル&リスク部門は Refinitiv (リフィニティブ) に生まれ変わりました。当社は将来に向けて大きな一歩を踏み出し、新しいブランドとして世界に羽ばたいていきます。

新ブランドへの移行は段階的なため、ドキュメント類や動画、およびデジタル・プラットフォームにおいてトムソン・ロイターの名称が残っている場合があります。

ブランド変更につきまして、ご理解のほど宜しくお願いします。



REFINITIVTM



Thomson Reuters MarketPsych Indices

ニュースやソーシャル・メディアをタイムリーに的確に分析

マーケットあるところに感情あり
感情あるところに感情周期あり
周期の見極めが収益の決め手に

Thomson Reuters MarketPsych Indices – 市場心理を読み解き、マーケットの行方を見極める

内在する市場心理を見極める

内在する市場心理は、はたして見極められるのか？

行動経済学の研究により、投資家の見方が市場に与える影響を予測できるようになっています。市場心理の状態をリアルタイムに見極められるとしたら、後からパターンを読むのではなく、実際にその場で現れるパターンをつかむことができるのです。Thomson Reuters MarketPsych Indices はニュースや他のメディアをリアルタイムに分析しています。ニュースを分析して内在する意味合いを抽出し、即座に価格方向性を拿捕することが可能になるでしょう。

Thomson Reuters MarketPsych Indices による市場心理スコアリング

アセットと市場心理のカバレッジ

- 12,000 社以上の企業
- 36 の商品とエネルギー項目
- 187 カ国
- 62 のソブリン市場
- 45 通貨
- 150 以上の仮想通貨

テキスト・カバレッジとアーカイブ

- 2,000 のニュース・ソース
- 800 のブログ、株式メッセージボード、ソーシャル・メディア・サイト
- 1998 年にアーカイブ開始（仮想通貨については 2009 年より）

不断の監視体制、明確なシグナル	情報が市場を動かす
<p>Thomson Reuters MarketPsych Indices は、ニュースとソーシャル・メディアをリアルタイムに分析します。幅広い膨大な量の専門ニュースとソーシャル・メディアからの記事を心理指数として定量化し、既知の情報に加え、内在する情報を見出すことで、一歩踏み込んだ鋭い投資判断支援をします。</p> <p>この指標は、リアルタイム・データ系列として配信されるため、定量的か定性的かを問わず、分析や意思決定のプロセスに簡単に取り込むことができます。</p> <p>提供されるのは、以下の 3 つのタイプの指標です。</p> <ul style="list-style-type: none"> • 不安、喜び、信頼などの感情指標 • 収益期待、金利予測、ロング/ショートなど、ファンダメンタルズの見方 • 訴訟や合併、中央銀行など市場を動かすテーマがどのくらい話題になっているかを示す口コミ指標 <p>こうした指標は、世界中の指数、企業、債券、国、商品、通貨、仮想通貨ごとに、1 分単位で更新されます。指標は、分析担当者やトレーダーが監視できるように、ダッシュボードや統計ツールに直接変換することも可能です。また、お客様のアルゴリズムに直接連動させ、投資や資産配分の迅速な判断に役立てることもできます。</p>	<p>情報には、投資家の取引行動を変える力があります。例えば、ソーシャル・メディア上に不安が広がっていれば、投資家が警戒感を持っていることを示し、その結果、相場の急落を招きやすくなります。ファンダメンタルズに関して明るい材料のニュースがあれば、投資家の意識にじわじわと広がり、長期的な株価モメンタムを生み出すこととなります。Thomson Reuters MarketPsych Indices は、相場に明らかな影響を及ぼす市場関係者の認識や関心事、懸念を正確に描き出します。</p> <p>利用シーン</p> <ul style="list-style-type: none"> • ソーシャル・メディア上で、最も革新的と考えられているテクノロジー関連株はどれか、最も信頼を集めている銀行はどこかを特定 • 農産物の需給に関する言及を監視 • 通貨間の価格予測の比較 • 各国の社会不安やインフレ見通しのレベルを追跡 • 最も不確実な国債の判定 • 仮想通貨に対する市場心理の揺れを追跡 • 個別の銘柄に関する市場心理状態を監視 <p>相場周期から介入のタイミングを見極め、どの情報が相場を動かしているのか把握するうえで欠かせない市場心理を把握できます。</p>

用途・活用例

- **クオンツ・トレーダーや投資家**：変化する市場サイクルの見極め、アルファ創出戦略の補強、リスクモデルの向上の促進に。モメンタム戦略、平均回帰戦略、ボラティリティ戦略の調整にも有効。
- **グローバル・マクロ・ヘッジ・ファンド**：国、市場、アセットクラスごとに市場心理から見た市場サイクルの把握に。グローバルな資産配分でさらに効果的な判断が可能に。
- **オンライン証券**：クライアント向けの取引アイデアの創生に有効。現在のイベントや市場へのインパクトをわかりやすく表現したビジュアル資料づくりに。企業や地域に関するソーシャル・メディア上のセンチメントの動きを明確に表示可能。
- **リサーチ・アナリスト**：市場を動かすイベントの監視に。アセットごとの価格変動要因の特定に。
- **リスク・マネージャー**：各資産クラスにおける投機やクラウディングのリスク監視に。
- **為替トレーダー・通貨トレーダー**：投資テーマに影響を与えそうなニュースやソーシャル・メディアの流れの特定に。マクロ経済不均衡や国・通貨に対する意識を監視することにより、アービトラージの機会探索に。
- **商品取引企業・エネルギー系企業**：需給問題、労災事故、気象被害など、農産物やエネルギー商品に関するグローバルな情報の流れの追跡に。トレンドの発生、消滅、反転の時期の的確な見極めに。
- **エコノミスト**：通貨間のリスク認知の監視に。グローバルな金利予測や失業率などマクロ経済の主要テーマに関する変化の発見に。ニュースや情報の入手と同時に主要経済指標の更新に。
- **報道機関・コンサルタント**：調査対象企業の株価を動かしているネタの理解に。隠れた問題への対応を強化し、透明性のある市場づくりを促進するためのコミュニケーション手段として。
- **仮想通貨の投資家、採掘者（マイナー）、取引所**：AIと機械学習を導入して市場心理の揺れを予測。下落局面におけるリスクヘッジ。人気の通貨と革新的技術を特定。

画期的なテクノロジー

MarketPsych は、行動経済学に即したクオンツ運用の分野をリードする企業です。インターネット上のニュースやソーシャル・メディアのテキストを高速分析する MarketPsych のテキスト・アナリティクス・エンジンには、特許取得済みの自然言語処理ソフトウェアが搭載されていて、グローバルな情報の流れから得られる重要な指標を提供します。

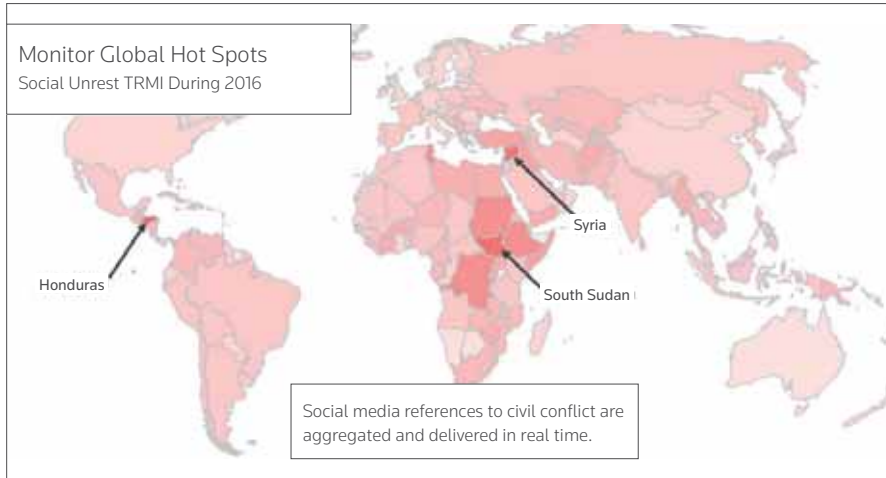
市場を読み解く

MarketPsych は、精神科医・クオンツ・トレーダーで、『Inside the Investor's Brain: the Power of Mind over Money』（邦訳『脳とトレード』）の著者でもあるリチャード・ピーターソン博士により設立されました。同社は、実験科学とハイエンドのソフトウェア開発という2つの専門知識をベースに、文章の中から、市場に影響がありそうな意味を見つけ出す言語解析ソフトウェアの開発に取り組んでいます。Thomson Reuters MarketPsych Indices は、こうしたデータが持つ価値や予測可能な面に着目し、トレーダーや投資家、リスク・マネージャーといった方々を対象に、有効な情報をまとめています。

トムソン・ロイターについて

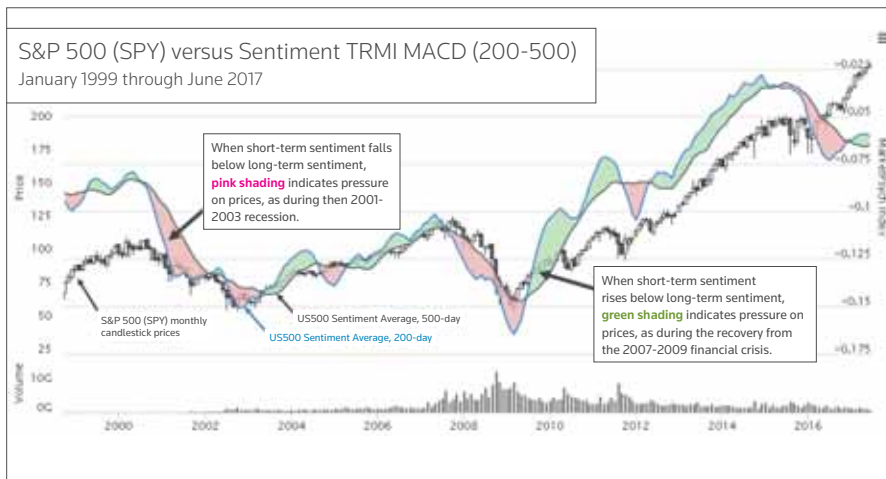
トムソン・ロイターは、企業や専門家向けのインテリジェントデータの提供で世界をリードしています。信頼性の高い、市場を動かすニュースを世界の金融関係者に配信してきた圧倒的な資産を有するトムソン・ロイターは、最も幅広いニュース・カバレッジ、市場を動かす独占コンテンツ、業界をリードする自然言語処理機能、最小限の遅延で重要情報を配信する体制を整え、クオンツ戦略の支援と人間による意思決定の支援の両面で力を発揮するマシン・リーダブル・ニュース・サービス分野でも世界をリードしています。

市場動向を注視し、動向から発生するイベントを把握



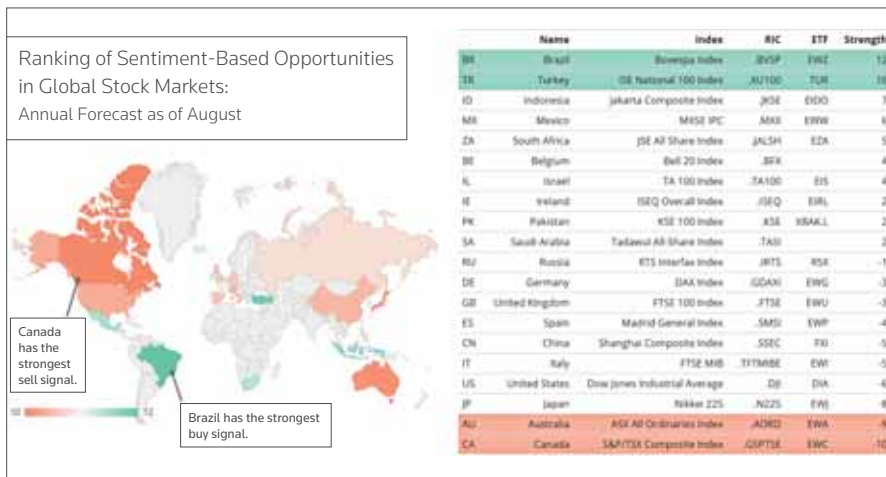
ヒートマップとダッシュボード

アナリスト向け機能としては、TRMI を利用して重要情報のサマリーをダッシュボードとヒートマップの形で即座に作成できます。左の図は、2016 年中の社会不安への言及を表示したグローバル・マップです。このようなヒートマップは、従業員やサプライチェーンへの政治的・物的リスクの監視に使われます。例えば証券アナリストの場合、どの銘柄が最高の収益予測になっているのか、あるいはどの辺りの投資家に不安感が高いのかをヒートマップで即座に確認できます。



センチメントでトレンドの潮目を見極める

メディアのセンチメントは相場を左右します。センチメントの移動平均線のクロスオーバーを使ってトレンドを追い、反転のタイミングを見極める必要があります。左の図では、S&P 500 に関する発言がネガティブになると、相場は下降局面に転じています。逆に、センチメントが上昇すると、それにつられて相場も上昇しています。こうしたセンチメントに基づく移動平均は、MarketPsych 調査で大きな先行予測能力を発揮します。ヒストリカル・データのテストでは、TRMI の喜び指標はアップル社の株価の重要な先行指標になっている一方、PriceDirection 指標は原油価格の重要な先行指標になっています。



ランクづけによる予測モデル

左のマップは、Thomson Reuters MarketPsych Indices を基に策定したグローバル株式投資戦略を示しています。このモデルによると、オーストラリアやカナダなどポジティブなセンチメントが広がっている国は、翌年、ブラジルやトルコなどセンチメントの弱い国を下回る可能性が高いことがわかります。証券会社であれば、TRMI 上で同様のリサーチ・アプリケーションを開発し、センチメントをベースにしたリサーチ・アイデアをクライアントに提供できます。

Web サイト : thomsonreuters.co.jp/financial

お問い合わせ先
 URL : tr-jp.otoiawase
 電話 : 03-6743-6515