

投資とビッグデータ

下

ビッグデータの活用はどこまで進むのか。市場価格の動きを研究する高安美佐子・東京工業大学准教授と、ブログ分析を生かすヘッジファンドを運用する松尾豊・東京大学准教授に話を聞いた。

「ビッグデータをどう活用しますか。」「人間の活動がアーカイブとして記録に残るようになり、数理的に分析できる時代に入ってきた。蓄積が進む膨大なデータ。経済や社会の幅広い現象が、物理学の『粒子』のように精密に見えるようになりつつある」

「ビッグデータをどう活用しますか。」「人間の活動がアーカイブとして記録に残るようになり、数理的に分析できる時代に入ってきた。蓄積が進む膨大なデータ。経済や社会の幅広い現象が、物理学の『粒子』のように精密に見えるようになりつつある」

「ビッグデータをどう活用しますか。」「人間の活動がアーカイブとして記録に残るようになり、数理的に分析できる時代に入ってきた。蓄積が進む膨大なデータ。経済や社会の幅広い現象が、物理学の『粒子』のように精密に見えるようになりつつある」

の値動きを物理学の手法で読み解き、予測できる可能性が広がっている。

物理学でリスク管理



高安 美佐子氏(東京工業大学准教授)

「市場データから何が読み取れますか。」「(約定ごとの最小の)価格の変動は単純なランダムウォークでは説明で

「相場は逆張りの投資家がどのほど安定し、逆張りの動きが強くなりすぎれば、やがて暴落に

「相場は逆張りの投資家がどのほど安定し、逆張りの動きが強くなりすぎれば、やがて暴落に連鎖しうる異常を効率的に監視する応用が可能だ。取引所で異常値を検出するなどリスク管理にも生かせるだろう」



松尾 豊氏(東京大学准教授)

益の源泉だ。ネット上の大量のテキストから浮かび上がる投資家心理、予測精度が上がると

情報選別なお課題

「最大の利点は、情報量の差が超過的な市場分析も運用に取り

「最大の利点は、情報量の差が超過的な市場分析も運用に取り

「最大の利点は、情報量の差が超過的な市場分析も運用に取り

「最大の利点は、情報量の差が超過的な市場分析も運用に取り

「最大の利点は、情報量の差が超過的な市場分析も運用に取り

「最大の利点は、情報量の差が超過的な市場分析も運用に取り

高井宏章、須永太一朗、川瀬知浄、篠崎健太、鈴木巨が担当しました。