

Global Macro Forecasts

Exponential Technologyとの提携による高度な経済指標予測

LSEGのGlobal Macro Forecasts (グローバル・マクロ・フォーキャスト)は、最先端の指標を活用し、グローバル経済のトレンドに関する実用的なインサイトを提供します。米国の消費者物価指数(CPI)、米国の小売売上高、コンファレンス・ボードの消費者信頼感指数(CCI)、ミシガン大学消費者信頼感指数などを予測します。ヘッジファンド、マーケット・メーカー、ファンド・マネージャー、バイサイド、セルサイド・リサーチ、エコノミスト、ウェルス・マネージャーのために設計されており、経済指標が公表される1か月前から2日前までの期間をカバーしています。前月比および前年比の変化率と絶対値に加え、1年間、2年間、5年間の正確な実績統計を提供します。

従来、機関投資家は将来公表されるマクロ経済指標を予測するうえで、主にブローカーが提供するコンセンサス経済予想に依存していました。しかし、正確でタイムリーなマーケット・インテリジェンスは、投資の成果に重要な影響を及ぼす可能性があります。LSEGのGlobal Macro Forecastsは、トップラインのCPIに加え、食品、住居費、ガソリン、輸送費など、CPIの個別の構成要素の予測を明らかにします。こうした予測によって、起こり得るマクロ経済のサプライズに備えて事前にポジションを構築し、ポートフォリオを守ることや、経済予測がコンセンサス予想に織り込まれていない場合に、攻めの姿勢でアクティブなリスク・テイクを行うことができます。さらに、予測値はロイター・ニュース、ECL、Polls、Tick History データなどのLSEGのデータに基づいており、信頼性の高い優れたソリューションを提供します。

Global Macro Forecastsは、各マクロ経済指標について、新たなリアルタイムの事業活動とアンケート調査のデータ、機械学習アルゴリズム、高度な統計的手法など、ファンダメンタルズのモデリング手法を利用し、発表の数週間前から経済指標を正確に予測します。Global Macro Forecastsには、アンケート調査や遅行指標に基づく従来の予測とは異なり、リアルタイムのデータ・ストリーム、将来見通しに関するアンケート調査の回答、特定時点の経済データが組み込まれており、タイムリーで信頼性の高い予測をボトムアップで構築します。



本図は、米労働統計局が公表する消費者物価指数(CPI)の前月比変化(%)を示したものです。3月17日、**Exponential Research**は、4月10日の公式発表に先立ち、3月のCPIが前月比 **-0.1%の低下**となることを正確に予測しました。同社の予測は、アンケート調査に回答した**67人のエコノミスト全員の回答を下回りました**。エコノミストの予想の最低値は横ばい(0.0%)でした。Exponential Researchによる各月のCPIの最初の予測は、常に当月の第3月曜日に公表されます。

アクセス性

Global Macro Forecastsでは、フロント・オフィスのアクティブ・リスク・テイカーと、ミドル・オフィスのリスク管理部門を支えるREST APIと視覚化ツールを通じて、独自のインサイトにアクセスできます。

本データセットは、各マクロ経済指標の予測と、比較用の過去の報告データを提供します。また、さまざまな過去のルックバック期間について、正確性とエラーに関する実績を定量化した追加的な指標も提供しています。

LSEGの最先端の手法は、独占配信のロイター・ニュース・アーカイブやマーケット・データなどの幅広いテキスト・データを活用し、マクロ経済に関するマーケット・インテリジェンスの独立した必要不可欠な情報源を提供します。

競争優位性

Global Macro Forecastsは、高度な統計モデルと機械学習を使用して、膨大な量の公表データと独自データを処理し、各マクロ経済指標について新たなボトムアップのモデルを構築します。

毎月や毎四半期の経済指標が公式発表された直後、通常はブローカーによるコンセンサス予想が公表されるよりはるかに早いタイミングで、次の月や四半期の予測を配信します。経済指標が公式発表されるまでの間、継続的にアップデートを行い、予測の精度を高めます。投資家は、マクロ経済指標の発表に先立ってポジションを再構築し、不正確なコンセンサス予想に対する裁定取引を行い、公式発表が市場予想と異なる場合の一時的な過大反応や過小反応を利用することができます。

ユーザーとユースケースの例

ヘッジファンド、アセット・マネージャー、年金基金、ソブリン・ウェルス・ファンド 本データセットをマクロ経済予測に統合し、独自の分析を強化。	ウェルス・マネージャー リバランスのタイミングを改善することで、パフォーマンスを向上させ、顧客維持を支援。
セルサイド・リサーチ マクロ経済イベントの予測と市場ダイナミクスの理解を改善し、より正確な意思決定のための情報を提供。	エコノミスト 政府発表に先立ち、マクロ経済のサプライズを予測。カテゴリー・レベルの精度で、独立したボトムアップの情報源に照らして予測を検証。

LSEGのGlobal Macro Forecastsが選ばれる理由

LSEGは、グローバル・マクロ経済予測のリーダーであるExponential Technologyと提携し、同社リサーチ・チームの専門知識と、LSEGの厳密で正確なデータセットを統合しています。

LSEGのGlobal Macro Forecastsのデモについては、担当のアカウント・マネージャーまでお問い合わせいただくか、**LSEGまでご連絡ください。**



ウェブサイト lseg.com/ja |  @LSEGplc  LSEG

© 2025 LSEG. LSEGが事前に書面で許可した場合を除き、LSEGが提供するコンテンツを再発行または再配信（フレーミングその他の方法によるものを含む）することは禁止されています。LSEGは、コンテンツの誤りまたは遅延、またそれに依拠して行われた行為につき、いかなる責任も負わないものとします。「LSEG Data & Analytics」のロゴマークおよびロゴタイプは、LSEGおよびその関連会社の商標です。



LSEG DATA & ANALYTICS