

# LSEG StarMine Analytics for Wealth

LSEG の堅牢なモデルと高度な分析で投資目標の最適化とリスク軽減をサポート

## 概要

今日では、どのような投資家も、市場に対応するための準備が必須となっています。今後の市況、市場動向、ギャップの生じる場所、トレンドの開始時期をより正確に予測することが求められているのです。

LSEG StarMine Analytics for Wealth は、機関投資家、ヘッジファンド、クオンツ・リサーチ企業、データ・サイエンティストに限り利用されている高度な分析とモデルを個人投資家に提供します。

投資プロセスにおいて StarMine (スターマイン) のモデルと分析を利用することは、博士号レベルの専門家から成る調査部門の知識を投資判断に取り入れることに匹敵します。

確かな経済的洞察と綿密な分析に裏打ちされた LSEG StarMine の強固なモデルと分析を活用することで、より高いリターン達成に必要な機会を特定し、インサイトを深め、最も有望な投資アイデアに絞り込むことができます。

## モデルと分析

LSEG の分析とモデルは、モメンタム、バリュー、スマート・マネー、リスク、センチメント、M&A などの重要な分野を網羅しています。全 16 のモデルと分析のほか、同業他社上位 10 社の比較情報にアクセスできます。さらにオプションで、ニュースやソーシャル・メディア・プラットフォームのセンチメントを測定する StarMine MarketPsych Media Sentiment Model をパッケージに追加できます\*。

モデルと分析の一覧と詳細については別表をご覧ください。また、[LSEG のインサイトの活用によりトレーディングの成果がどのように伸びるのかについては、担当チームへお問い合わせください。](#)

## メリット

### 高度な分析を活用し情報に基づいた意思決定を実行

- 他の市場参加者よりもいち早くトレンドを特定し、収益性の高い機会を捕捉
- 内部データの専門家が市場トップクラスのデータを結集させて構築したモデルを、迅速な意思決定と時間・コストの削減に活用

### より収益性の高い機会を特定

- StarMine は優れた予測モデルとしての実績を長年にわたって確立
- 見過ごされがちなファクターを活用し、ポートフォリオにおいて優れたアルファの創出とリスク管理を促進

### 成果を追跡するリサーチで市場を見極め

- セルサイド・リサーチの信頼性と実績を評価し、より多くの情報に基づいた意思決定に貢献

## 配信

データは 1 日の終わりに日次で更新され、API 経由で配信されます。ご利用可能なパッケージは以下の 2 つです。

- 1.スタンダード – プライベート・パスワードによる保護
- 2.プレミアム (5 年分の過去データを含む) – 社内の専門家向け

\*StarMine MarketPsych Media Sentiment Model は個別に購入可能。



## 別表

モデルと分析	概要	ご利用のメリット	評価
モデル			
<b>Analyst Revision Models (ARM)</b> (地域、推奨情報、収益、付随情報、選好指標の5つのARMモデルをスコアリング)	業績予想に基づく企業の将来性に関するアナリストの見解の変化を追跡。ポジティブな修正は信頼が高まっていることを示し、ネガティブな修正は懸念を抱えていることを示す。	<ul style="list-style-type: none"> <li>ハイレベルの金融コミュニティが、企業の将来性について楽観的になっているか、悲観的になっているかを把握</li> <li>銘柄の動向を把握し、よりの確かな予測をサポート</li> </ul>	1~5段階でスコアリング 1 - アナリストが業績低迷を予測 5 - 堅調な業績を予測
<b>Price Momentum Model</b>	業種レベルで短長期の株価のトレンドとモメンタムに着目。	<ul style="list-style-type: none"> <li>トレンドの特定</li> <li>潜在的な機会の特定、および利益が最大となる取引タイミングの見極め</li> </ul>	1~5段階でスコアリング 1 - 弱い株価トレンド、アンダーパフォーマンスの可能性あり 5 - 好調な株式モメンタム、アウトパフォーマンスの可能性あり
<b>Intrinsic and Relative Valuation Model</b>	企業のファンダメンタルズ (キャッシュフロー、収益等) と、市場の他の銘柄と比較した相対バリュエーションを分析し、株価の総合的な可能性を把握。	<ul style="list-style-type: none"> <li>銘柄が割高か割安かを判断</li> </ul>	1~5段階でスコアリング 1 - 銘柄が割高、アンダーパフォーマンスの可能性あり 5 - 銘柄が割安、アウトパフォーマンスの可能性あり
<b>Earnings Quality Model</b>	さまざまな財務指標と会計慣行を評価し、企業が公表している収益の信頼性、透明性、持続性を判断。	<ul style="list-style-type: none"> <li>粉飾決算、不正な会計慣行、あるいは財務上の不正行為を示す危険信号または懸念分野を特定</li> <li>財務上の落とし穴を回避</li> <li>収益の質が低い (財政難の影響を受けている可能性が高い) 企業を特定することでリスクを最小化</li> <li>長期的なサステナビリティの恩恵を受けることが可能、および収益の質が高い企業への投資が可能</li> </ul>	1~5段階でスコアリング 1 - 企業の収益の持続可能性や信頼性が低いことを示唆 5 - 企業の収益の持続可能性や信頼性が高いことを示唆
<b>Smart Money Models</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>- US Insider Filings</li> <li>- US Short Interest</li> <li>- Smart Holdings</li> </ul>	経験豊富な投資家の投資パターンとシグナルを分析して投資先を特定し、さらにモニタリングを実施。	<b>US Insider Filings</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>- 企業のインサイダー (経営幹部、取締役など) が保有する株式の動きをモニタリング</li> </ul> <b>US Short Interest</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>- 空売られた株式数を確認し、将来のショート・スクイーズなどに応用</li> </ul> <b>Smart Holdings</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>- 機関投資家の投資先を分析し、将来性のある銘柄またはセクター、投資を避けるべき銘柄またはセクターに関するインサイトを収集</li> </ul>	1~5段階でスコアリング 1 - 投資先に懐疑的、アンダーパフォーマンスの可能性あり 5 - 投資先に確信的、アウトパフォーマンスの可能性あり
<b>Combined Alpha Model</b>	市場ベンチマークをアウトパフォームする銘柄の特定を目的として、経営効率、収益見通し、競争力、市場センチメントなどのファクターを分析し、企業の総合的な健全性と成長可能性を評価。	<ul style="list-style-type: none"> <li>市場をアウトパフォームする可能性のある銘柄について信頼性の高い全体像を把握</li> </ul>	1~5段階でスコアリング 1 - 見通しがネガティブ 5 - ポジティブなコンセンサス、アウトパフォーマンスの可能性を示唆
<b>Credit Risk Model</b>	借り手が債務不履行 (デフォルト) に陥る可能性を評価。	<ul style="list-style-type: none"> <li>デフォルトの可能性がある、またはセンチメントが弱い企業を特定することでリスクを最小化</li> </ul>	1~5段階でスコアリング 1 - クレジット・リスクが高く、財務不安定の可能性あり 5 - クレジット・リスクが低く、財務が安定している
<b>M&amp;A Target Model</b> (別パッケージで提供)	買収のターゲットとなる可能性があり、株価上昇が期待できそうな企業に関する重要なインサイトを提供。M&Aのターゲット企業を特定することで戦略的な資金配分を可能にし、株価上昇の要因となり得る将来のM&Aからリターンを獲得。	<ul style="list-style-type: none"> <li>M&amp;Aのターゲットになり得る企業の特定</li> <li>M&amp;A活動による株価の値動きを利用し、リターンを獲得</li> </ul>	1~5段階でスコアリング 1 - M&Aのターゲットになる可能性が低い 5 - M&Aのターゲットになる可能性が高い
<b>MarketPsych Media Sentiment Model</b>	企業、株式市場、または特定のセクターについて、ニュースやソーシャル・メディアのプラットフォームでどのようなことが話題になっているかをモニタリング。	<ul style="list-style-type: none"> <li>センチメントの強弱を把握することにより市場動向を予測</li> </ul>	1~100でスコアリング 1 - メディア・センチメントがネガティブ、アンダーパフォーマンスを示唆 100 - メディア・センチメントがポジティブ、アウトパフォーマンスの可能性あり

分析			
<b>Predicted Surprise</b>	高度なアルゴリズムを用いて企業の収益報告書に、アナリスト予測との大幅な乖離（収益サプライズ）があるかどうかを予測。市場の変化が起きる前にその可能性を予測し、戦略的投資判断を実現。	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 決算公表前に収益サプライズの可能性を特定</li> <li>- 市場動向を事前に予測</li> <li>- 戦略的投資判断を支援</li> <li>- 収益サプライズによる株価の値動きから収益獲得の機会を特定</li> </ul>	スコア: ネガティブ/なし/ポジティブ ネガティブ – 収益予測に未達の可能性 なし – 予測通りの可能性 ポジティブ・サプライズ – 収益予測を超過する可能性
<b>Short Squeeze Indicator</b>	ショート・スクイズ（踏み上げ）による株価上昇が見込まれる銘柄についてシグナルを発生し、ボラティリティからリターンを得る機会を投資家に提供。	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 株価急騰が見込まれる銘柄をアラートで通知</li> <li>- キャピタル・ゲインの獲得機会を提供</li> <li>- 空売りに関するリスクを強調</li> </ul>	スコア: ネガティブ/なし/低 ネガティブ – ショート・スクイズの可能性が低い、空売りポジションの保有者にとって安全 なし – ショート・スクイズの明確なシグナルがない ポジティブ – ショート・スクイズの可能性が高く、株価急騰が見込まれる
<b>Bold Estimates</b>	他のアナリストの予測やコンセンサスとは大きくかけ離れた、企業業績（収益など）に関するトップ・アナリストの強気の予測。多くの場合、著名なトップ・アナリストが最初に予測を修正するものであり、彼らが大胆な予測を立てた場合は銘柄に大きなチャンスがあることを示唆。	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 企業の業績または業種のトレンドに潜む変化をいち早く提示</li> <li>- コンセンサスとは異なる強気の予測に基づいて収益機会を特定</li> <li>- 市場センチメントに関するインサイトと、企業の業績見通しに関するアナリストの自信の度合いを開示</li> <li>- リターンを最大化し、リスクを緩和する可能性のある、大胆な予測に基づいた意思決定を実行</li> </ul>	スコア: ネガティブ/なし/低 ネガティブ – アナリスト予測が市場予測の精度を下回る なし – アナリスト予測と市場予測が一致 ポジティブ – アナリスト予測が市場予測の精度を上回る
<b>Revision Cluster</b>	グループ内のアナリスト全員が企業の業績予想を短期間で同方向に修正した際、投資家に通知。新製品の発表、大きな契約の獲得または喪失、規制の変更など、株価に大きな影響をおよぼしかねない重要な出来事が起きた、あるいは発覚したことを示すものであるため、通知の重要性は極めて高め。	<ul style="list-style-type: none"> <li>- 企業に影響をおよぼす重大な出来事に関するインサイトを提供</li> <li>- 株価への潜在的な影響を予測</li> <li>- アナリスト予測の修正に起因するキャピタル・ゲインの獲得機会を提供</li> </ul>	スコア: 低/中/高 低 – 将来の業績について、アナリストが楽観から悲観に傾き、改善に懐疑的であることを示す 中 – アナリストのセンチメントに変化なし 高 – 業績についてアナリストの楽観性が増し、改善に確信的であることを示す

トレーディング成果の向上に役立つインサイトの詳細については、[こちらから](#)セールス・チームへお問い合わせください。

[lseg.com](https://lseg.com) | [X](#) @LSEGplc [in](#) LSEG

© 2024 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、コンテンツのエラー、中断または遅延、あるいはコンテンツに依拠してなされた行為につき、何らの責任も負わないものとします。ロゴ・ワードマーク「LSEG Data and Analytics」は、LSEG およびその関連会社の商標です。



**LSEG** DATA & ANALYTICS