

LSEG Tick History

世界580以上の取引所、取引ベニュー、コントリビューターをカバー。
30年を超えるヒストリカルティックデータをご提供します。

ヒストリカルティック・データはインベストメント、トレーディング、リスク、コンプライアンス、リサーチに関するワークフローにおいて重要な役割を果たしています。データセットがますます大規模化・複雑化する中、企業にとってデータ管理負荷を増やすことなく、過去の市場活動データにアクセスし、それを分析・活用する効率的な方法が必要です。

LSEGのソリューション

LSEG Tick Historyは30年以上にわたる過去の日中マーケットデータへのアクセスを提供します。データには、580を超える取引ベニューおよびコントリビューターの約定データ、気配値、板情報が含まれています。

100兆行を超えるデータを多様なアクセス手段でご利用いただけるため、クオンツ・リサーチや戦略策定、市場監視、バックテスト、取引コスト分析、規制対応ワークフローなど、あらゆる業務を支えることができます。

LSEG Tick Historyの特長

広範な過去データをカバー

- ・ 1996年1月以降、30年以上にわたるヒストリカル・マーケット・データをカバー
- ・ 580を超える取引所、取引ベニュー、コントリビューターのデータ
- ・ レベル1とレベル2のマーケット・データをカバー
- ・ クロスアセットのグローバルなカバレッジ

柔軟なデータ形式

- ・ 正規化データ/生データの両方の形式で提供可能
- ・ 正規化されたデータセットは、LSEGの共通的なシンボロジーとデータ・モデルに整合しているため、ティック・データ、リファレンス・データ、クオンツ・リサーチ、機械可読ニュースなどの補完的なデータと統合可能
- ・ 取引所が提供するオリジナル形式のデータが必要な場合や、独自のデータ処理環境に合わせたい場合には、生データ形式でも提供可能

エンタープライズ規模の分析に対応

- ・ 100兆行を超えるマーケット・データ
- ・ 80ペタバイト超の過去コンテンツ
- ・ 大規模なクオンツ・リサーチとバックテストをサポートする設計
- ・ AI、機械学習 (ML)、高度な分析ワークフローに最適

高精度なデータ抽出

- ・ カスタム抽出サービス (Custom Extract Service) を用いて、特定の金融商品、取引ベニュー、データ・フィールド、日付範囲、期間を選択可能
- ・ データ抽出のスケジュールは業務およびリサーチの要件に合わせて自動設定可能

フロントからバックまで、企業全体でTick Historyを活用

フロントオフィスにおけるユースケース

- ・ 戦略の策定とバックテスト
- ・ クオンツ・モデルの構築と検証
- ・ AI およびMLイニシアチブのサポート
- ・ 市場のミクロ構造と流動性の分析
- ・ 実行アルゴリズムの最適化
- ・ 取引コストと執行の分析

ミドルオフィスにおけるユースケース

- ・ 最良執行のモニタリング
- ・ 規制対応水準の取引コスト分析 (TCA)
- ・ 市場監視
- ・ 市場濫用の調査
- ・ モデルの検証とガバナンス
- ・ 取引ベニューのベンチマークとパフォーマンス分析

バックオフィスにおけるユースケース

- ・ 規制上の報告
- ・ 監査と調査のワークフロー
- ・ 記録保存要件への対応
- ・ データ・ガバナンスへの取り組み
- ・ 取引の照合プロセス

ソリューションとアクセスのオプション

Tick History – S3 Direct	• AWS上のLSEGの共有ストレージ・モデルを通じて提供されるS3 Directを利用して、最適化されたクラウド環境で過去データとポイント・イン・タイムのアップデートにアクセス • 効率的なストレージ、大規模な分析、複数のデータセットを横断するワークフローをサポート
Tick History – Databricks	• 正規化された過去のマーケット・データにDatabricks環境下で直接アクセスすることで、データ移動を削減し統合を簡素化 • Delta Parquet形式で提供され、Unity Catalogと統合されたデータにより、ガバナンスの効いたアクセスを実現するとともに、Databricksの高度な分析機能とAI機能を用いたクオンツ・リサーチやバックテスト、モデル開発、AIを活用した分析を可能に
Tick History – PCAP	• Tick History – PCAPは最高レベルの忠実度を求める企業向けに、GPS 同期されたナノ秒単位のタイムスタンプを含む、取引所から直接取得したパケットキャプチャ・データを提供 • 高度な市場ミクロ構造分析、執行リサーチ、戦略の精緻化をサポート
Tick History – Query	• Google BigQueryを基盤とする Tick History – Queryを利用することで、LSEGの過去のマーケット・データ・アーカイブへのクラウドネイティブなアクセスが可能となり、データセットのダウンロードや管理が不要に。これにより、クラウド環境内で直接、迅速なクエリ実行と分析が可能
Tick History Web & API	• Web上のインターフェイスやAPIを通じて、金融商品単位の過去データや取引ベニュー別の日次ファイルにアクセス • 必要なデータを選択し、抽出データをリサーチや分析、オペレーショナル・ワークフローへ直接統合

データ:

LSEGのリアルタイム・フィードから取得した、1996年以降の未加工の取引および気配値メッセージを収録しています。

地域	全世界: 米州、アジア太平洋、EMEA (欧州・中東・アフリカ)		
あらゆるアセット・クラス	- コモディティ/エネルギー - 経済指標 - 株式 - 債券	- 外国為替/短期金融市場 - 先物 - オプション	
スペシャリスト・データ	- BGC Partners - Carl Kliem - GFI	- ICAP (BrokerTecを含む) - LSEG Matching - Tradeweb	- Tradition - Tullet - Yieldbroker

メッセージ・タイプ:

リファレンス・データが統合されているため、Tick Historyではシームレスな時系列データを容易に作成できます。取引パターンのアノマリーや生存バイアスを考慮することも可能です。

時系列データ	- 約定と気配値 (レベル1) - 複数板情報 (レベル2とレベル3のデータ) - 価格別板情報	- 終値 - 日中サマリー (1秒、1分、5分、15分、1時間単位)
リファレンス・データ	- コーポレート・アクション (Corax) - 二次識別子 (ISIN、CUSIP、SEDOL、RIC など)	
MiFID II 固有のコンテンツ	- BATs APA (BATS SIを含む) - MarketAxess Vienna APA - NASDAQ Nordics APA	- NEX - TradeWeb AP

関連ソリューション

リアルタイム・データ・ソリューション	クオンツ・データ・ソリューション	価格情報とリファレンス・サービス	Machine Readable News
------------------------------------	----------------------------------	----------------------------------	---------------------------------------

© 2026 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」のロゴは、LSEGおよびその関連会社の商標です。