

データの準備時間を 削減することで、 データ探索、モデル構築、 テストへの注力が可能に

さまざまな識別子、頻度、単位に対応して正規化された
統合データベースにより、管理に費やす時間と労力を削減

クオンツやデータ・サイエンティストは、複数のソースからデータを収集し、クレンジング、正規化する作業に業務全体の40%~80%もの時間を費やしています。その後によりやくデータを機械学習や従来の統計モデルに使用できるようになるのです。

同時に、差別化された戦略を追求するには、これまでにない革新的なデータセットが必要となります。しかし、独自データやサードパーティのニッチなデータを素早く分析用に準備するのは容易なことではありません。



データの準備時間を削減することで、アイデアの考案やテストにかける時間を確保

LSEGのクオンツ分析では、すぐに利用可能な金融データを収録した、正規化された統合データベースに直接アクセスできるため、データの準備に労力をかける必要がなくなります。このLSEGのソリューションは、さまざまな頻度、通貨、単位への対応や、コーポレート・アクションに合わせてデータを調整する手間を解消します。また、先読みバイアスや生存バイアスの発生を防ぐため、特定時点(ポイント・イン・タイム)のデータや上場廃止企業のデータも提供しています。

SAS、MATLAB、R、S-PLUSなどの統計パッケージや、Python、C#などのプログラミング言語と容易に連携させることが可能です。

あらゆる識別子に対応したセキュリティ・マスターでいち早く市場機会を捕捉

LSEGのクオンツ分析は、複数の識別子スキーム(CUSIP、SEDOL、RIC、Bloomberg Ticker、BarralD、MSCI Securityなど)に対応しており、それらを単一かつ不変の固有識別子としてマッピングします。そのため、一つの事業体に関するすべての証券を容易に分析し、さまざまなデータソースのデータを使用してファクターを構築できます。

本ソリューションではLSEGをはじめ、S&P、MSCI、Russellなどの主要ベンダーが提供する広範なデータを統合し、配信しています。これには、マルチアセットの価格、信用売残、業績予想、ファンダメンタルズ、株式保有比率、企業イベント、ディール、ESG、マクロ経済、インデックス、業種分類などが含まれます。

的確かつ迅速に独自コンテンツをクオンツ分析データにマッピング

クオンツ・リサーチにおける新たな重点課題は、サードパーティのコンテンツや独自コンテンツを素早く活用し、隠れたシグナルを探り出すことにあります。LSEGは、CUSIPやSEDOLなどの識別子に対応してきた比類のない実績を有し、クオンツ分析の時系列データセットと独自データの同期に要する時間と作業負荷を大幅に軽減しました。

さらに、Snowflake上でクオンツ分析を実行することで、LSEGや他のプロバイダーのデータを処理する際のデータ管理の軽減にも役立ちます。Snowflakeのデータ共有機能を使用すると、お客様のSnowflakeアカウントで自社データとLSEGのデータを組み合わせ、このコンテンツ・セット全体に対してクエリを実行できます。

信頼性の高いタイムスタンプと特定時点データを利用し、複数の景気サイクルにわたってバックテストを実施

LSEGのクオンツ分析は、マルチアセットの証券価格データ、企業データ、過去の構成銘柄リストに関して比類のない実績を有し、さまざまな市場環境下でモデルがどのように推移するかを検証することが可能です。高品質なデータにタイムスタンプの一貫性が加わることで、LSEGのクオンツ分析は、バックテスト用の信頼できる選択肢となっています。

バックテストにおいて実用段階でのモデルのパフォーマンスを確認できます。クオンツ分析には独自の特定時点データや修正データ、上場廃止企業のデータが使用され、先読みバイアスや生存バイアスが生じにくいことも特長です。

ご使用のクラウド上でクオンツ分析データをサービスとして利用

LSEGのクオンツ分析はクラウドベースのサービスとして数日のうちにプロビジョニング可能であり、新しいクオンツ分析や機械学習のプロジェクトに必要なデータへのアクセスを遅滞なく提供します。LSEGは、データベース管理とコンテンツ更新を年中無休で実施しています。クオンツ・データ・ソリューションの導入に伴う資本のロックインは生じません。LSEGでは、AzureとSnowflakeの2つのマネージド・サービス環境に対応しています。

クオンツ分析の主要コンテンツ

LSEGをはじめ、MSCI、Russell、S&P、Compustat、NYSE、NASDAQ、FTSE、Axiomaなどのベンダーが以下を提供しています。

- LSEG StarMine® モデル
- LSEG ESG データ
- MarketPsych Analytics
- 時系列価格データ：株式、債券、デリバティブ
- 指数価格、構成銘柄、ウェイト
- 銘柄ID
- セクターおよび業種分類
- LSEG I/B/E/S® 業績予想
- LSEG Worldscope Fundamentals
- M&A
- 株式保有比率および内部者データ
- 企業イベント
- 信用売残
- LSEG Datastream® マクロ経済指標

配信オプション

LSEGのクオンツ分析(QA)は、お客様のニーズに合わせてさまざまな環境でご利用いただけます。

お客様側で管理		サービスとして利用	
LSEG QA: 現地導入 (オンプレミス)	LSEG QA: 現地導入 (VM ホスト)	LSEG QA: クラウド(Azure)	LSEG QA: クラウド (Snowflake)



LSEG DATA & ANALYTICS