



Business | ビジネス活用

ケーススタディ

三菱UFJ信託が開発中のビッグデータ活用型ファンド、第一弾はニュース分析で株式を運用

2015.04.20 加古川 群司

金融・保険 企画・開発 製品・サービス向上

三菱UFJ信託銀行が開発中の「ビッグデータ活用型」ファンドの第一弾の概要が明らかになった。資産運用のプロ向けに配信されているニュースをコンピュータで即座に分析し、株式市場の中から割安と考えられる銘柄やその逆の銘柄を自動的に選び出すというもの。この結果をもとにファンドマネージャーが株式を売買する。

2015年2月から、約10億円の自己資金でこのパイロットファンドのテスト運用を始めている。発売時期は未定だが、パイロットファンドの運用結果と顧客のニーズを踏まえてなるべく早く商品化したい意向だ。

関西学院大学大学院経営戦略研究科の岡田克彦教授のチームと、三菱UFJ信託銀行グループのシンクタンクである三菱UFJトラスト投資工学研究所

(MTEC) が共同開発したモデルを使用している。岡田教授とMTECは今回試験運用を始めたモデル以外にも、インターネット上のブログや検索語の情報を活用したものなど様々な種類のビッグデータを活用した資産運用方法を研究しており、今回はその第一弾という位置づけだ。

人間には見落としがある

今回のファンドの基本的なアイデアは、大量のニュースの中に埋もれて見過ごされた情報をコンピュータで見つけ出すというもの。資産運用担当者の情報端末には1日に数千本の金融・経済関連などのテキストニュースが配信されるが、全てのニュースを同じように注意して見ているわけではない。「最初のニュースは全て見ていても、その続報を1カ月間全て追いつけることは人間にはできない。見落とししている情報もある。特にニュースが多い時期には情報が見落とされる可能性も高くなる」(資産運用部の三橋和之チーフファンドマネージャー)。

今回のパイロットファンドでは約800銘柄の株式を対象とし、ニュースが投資家の



顧客から受託した資産を株式などで運用するディーリングルーム

業種／業務／効果／データの軸から事例を探す

事例検索

Most Popular

記事ランキング

【速報】ビッグデータ活用に向け経産省が大幅な規制緩和へ

未来の課題を高速に分析する

国が地域経済のビッグデータ活用システム、各自治体に「データ分析官」を来春に配置へ

生き残るためには、5年以内に機械学習を使わなければならない

なぜ「外部データ×感覚データ」が重要なのか

BigData / IoT Analytics / 人工知能の第一人者が50名以上登壇！



From the Editor

編集部からのお知らせ

2015.3.13

書籍「トップデータサイエンティストが教える データ

心理にポジティブなものかネガティブなものかを自動で判定。さらに、ニュースの量の増減の具合や株価の動き方などから、割安と考えられる銘柄やその逆の銘柄を選び出す。2015年2月以前のニュースもシステムに取り込んでいる。

割安株をいかに見つけるか

例えば、ポジティブなニュースが出てても株価がほとんど動いていない銘柄があれば、情報が市場に十分に織り込まれておらず割安の可能性があると考えるわけだ。損切りなどのルールもシステムに組み込んである。

三菱UFJ信託銀行が他の大手金融機関に先駆けてビッグデータ活用型の新しいファンドの開発に取り組むのは、「世の中にまだない、新鮮味のあるファンドを作りたい」（三橋氏）という強い意欲があるからだ。「これまでにないスピード感で（ファンド開発を）進めている」（同氏）と言う。

試験運用開始から2カ月がたち、大量のニュースをコンピュータで活用することの効果調べている。現在の運用成績がコンピュータによるニュース分析が奏功したためなのか、それ以外の相場動向などの要因によるものなのかを判定するには、運用成績のデータをもっと蓄積する必要があるようだ。

いいね！

シェア

ツイート

0



4月21-22日「BigData Conference 2015 Spring」開催

ビッグデータ活用は様々な業務効率の改善にとどまらず、業界競争ルールとあらゆる産業の事業モデルを変革するインパクトを持ちます。本イベントは、企業のケーススタディに加えて、IoTや人工知能、ディープラーニングといった最新キーワードのビジネス活用について質の高いカンファレンス・プログラム、ディスカッションを繰り広げます。

写真は22日キーノート「2025年の産業と社会を予測する～人工知能・ディープラーニングによる変化はどこから始まるのか～」などに登壇する東京大学の松尾豊准教授

日経ビッグデータのコンテンツをすべて閲覧可能にする定期購読お申込みはこちら

国内外70事例収録！マーケティングテクノロジー総覧発売中

ビッグデータ業界を洞察するパートナーレポート随時更新中！

Recommend

関連記事

- 日経ビッグデータ関連記事
- ケーススタディ
- データ市場
- 市嶋洋平
- 経産省がビッグデータの新政策、40億円投じて“データ市場”創出
- ケーススタディ
- ライター岩元直久
- 「BigData Conference 2014 Autumn」報告
- “ビッグデータ人材”をいかに確保する
- ケーススタディ
- 加古川群司
- （特集）データで見抜く人間行動【前編】
- データから人間の行動を読み解き、ビッグデータで儲けるための3原則

活用実践教室」とムック「エクセルでできる! 簡単 統計解析の基本」を発売します。

2015.2.24
イベント「BigData Conference 2015 Spring」を4月21-22日に開催します。

2014.12.22
ムック「データプレゼンテーションの教科書～図解と数字で説得する!～」を好評発売中です。

2014.12.06
ムック「2015年のビッグデータ」と、ムック「実践！ビジネスに役立つ“超”分析の教科書」を好評発売中です。

2014.10.20
書籍「データ×アイデアで勝負する人々」を発売しました。

Latest Issue

日経ビッグデータの最新号



4月号特集

個客理解を極めて成長する

山積する課題に喘ぐタクシー業界をイノベーションで変える日本交通

年間購読のご案内

申し込む

お問い合わせ



Partner Report

パートナーレポート

Patner Reportとは？

- データの視覚化で犯罪を取り締まる
- by SASジャパン
- Internet of Thingsで属人化から脱却し、新たなサービス展開へ
- by 日本オラクル
- 機械学習の魅力とワナ
- by 富士通
- 決済連動マーケティングサービス“CLO”が拓く可能性
- by 大日本印刷
- 一覧へ

か、データ活用の全社組織を拡大するリ コーの取り組み



日経ビッグデータ サービス概要 | 登録内容のご変更 | 利用規約 | よくある質問 | お問い合わせ

日経BP社 会社案内 | 個人情報保護方針/ネットにおける情報収集/個人情報の共同利用 | 著作権について | 広告ガイド

日経BP社

Copyright © 2015 Nikkei Business Publications, Inc. All Rights Reserved.