

2013年8月9日
株式会社ホットリンク
国立大学法人東京工業大学

金融ビッグデータのリアルタイム可視化、 変動リスク予測ツールを全世界に向けてリリース ～ホットリンクが日本初のBloomberg App Portal上で提供開始～

【リリースサマリー】

株式会社ホットリンク（本社：東京都千代田区、代表取締役社長：内山幸樹、以下「ホットリンク」）は、2013年6月28日より、金融市場の状態を可視化し、変動リスクを予測するツール「Order Book Tracer（オーダーブックトレーサー）」をBloomberg App Portalのアプリとして販売開始しました。このツールには、東京工業大学の高安美佐子研究室で開発された、金融ビッグデータ分析技術 PUCK-tools Version. 2を用いています。

Bloomberg App Portalには、世界中のツールベンダーよりBloomberg利用者を対象としたツールが提供されています。「Order Book Tracer」は日本発の技術を用いた日本企業初の、Bloomberg App Portal上の金融ビッグデータ分析ツールとなります。

【背景】

近年はコンピュータトレーダーの出現や東証次世代売買システム「アローヘッド」など高性能取引システムの整備により証券取引は高速化し、膨大な金融商品注文情報（板情報）や取引成立履歴（約定履歴）のデータが市場から提供されています。しかし、これらの数値が羅列されたデータを、PC上の文字情報として追い、判断することは人間の処理能力を超えるものです。ビッグデータ分析・クラウドコンピューティング時代には、これまで不可能だった数値情報のリアルタイム可視化、金融取引の変動リスクに対する高精度予測が求められていました。

【詳細】

今回リリースされた「Order Book Tracer」では、板情報や約定履歴の時々刻々と変化するデータを定量的に可視化し、現在・過去の変動幅を正確かつリアルタイムに把握することにより、変動リスクの予測が可能となります。「Order Book Tracer」は、東京工業大学高安美佐子研究室で開発されたPUCK (Potentials of Unbalanced Complex Kinetics) tools Ver. 2.0を搭載しています。これは、リーマンショック時のようなトレーダーの過度な（パニック的な）順張り投資行動によって生ずる市場の異常な乱高下であっても、従来の金融工学より正確に金融リスクを見積もることができる新技術です。本商品は、金融商品の価格の動きや売買状況の視覚的に認知し、トレーダーの冷静な判断による取引の実現により、安定した資産運用をサポートします。

「Order Book Tracer」は「株式」「為替」「先物（株・商品）」「国債」について利用が可能です。

■ 「Order Book Tracer」の3大機能 ※株価指数の先物取引を例に説明

①金融情報のトレンドと変動リスクのリアルタイム予測 [図1-①]

過去の10分程度の約定情報から現在の市場の金融リスク及び未来の価格変動を推定することが可能となります。

②過去の板情報履歴の可視化 [図1-②]

現在は数字の羅列として与えられている板情報や約定履歴を可視化することにより、他のディーラーの行動を視覚的に把握することが可能となります。

③価格帯別約定履歴の可視化 [図1-③]

価格帯毎の約定履歴を可視化することによりどの価格帯で活発に取引が行われたかを把握することが可能となります。また分割された大口の注文も統合して視覚的に捉えることが可能となります。

本ツールは月額125ドルで、Bloomberg App Portalサイトよりトライアル・お申し込みが可能です。

金融ビッグデータ分析事業は、ホットリンクのビッグデータ分析事業としては、ソーシャルメディア分析事業に続く、第二弾となります。

ホットリンクはこれからも、ビッグデータ分析・可視化を実現し、利用者が活用しやすいビッグデータ事業を展開します。

<Webサイト> <http://obt.hottolink.com/> (英文)

[図1] 「Order Book Tracer」の表示画面



■東京工業大学高安美佐子研究室・PUCK-toolsについて

東京工業大学大学院総合理工学研究科知能システム科学専攻

<http://www.smp.dis.titech.ac.jp/>



高安美佐子研究室は、統計物理学・経済物理学の研究を行っています。社会や生命のような複雑なシステムで起こる現象を膨大なデータから観測し、現象の背後にあるメカニズムを数理モデルにより理解する研究、さらには、その応用により、社会に役立つ技術の構築で、顕著な業績を世界に発信しています。

■株式会社ホットリンクについて (<http://www.hottolink.co.jp/>)



ホットリンクは、ビッグデータを分析・加工し、ビジネスへの有効活用を支援するテクノロジーカンパニーです。ソーシャルメディア分野では大量のソーシャルメディアデータをリアルタイムに検索・分析が可能な「[クチコミ@係長](#)」、ソーシャルメディアから風評をモニタリングする「[e-mining](#)」を、現在まで累計 1500 社以上に提供してきました。また同様に、ソーシャルメディアデータおよび、感情/属性分析エンジンを API 方式でも提供しています。また、2013 年 6 月から金融分野では、日本企業初の Bloomberg 利用者向け金融ビッグデータ分析ツールを提供しています。

ホットリンクは利用者が簡単にビッグデータを活用できる世界を目指します。

詳細は、<http://www.hottolink.co.jp/> をご覧ください。

<本件に関する報道関係者からのお問い合わせ先>

株式会社ホットリンク

広報担当：竹本・出（いで） TEL：03-5745-3903 FAX：03-5745-3901 E-mail：hotto@hottolink.co.jp