

ツイート・センチメントとクラウドによる利益予想 —決算発表前後における貴重な情報源として—

Jim Kyung-Soo Liew、Shenghan Guo、Tongli Zhang (著)
高山裕一 CMA (訳・編集)

目次

- | | |
|---------------------------|----------|
| 1. はじめに | 3. 変数の構成 |
| 2. エスティマイズとウォール街のコンセンサス比較 | 4. 回帰分析 |
| | 5. 結論 |

1. はじめに

実証ファイナンスの最先端において、数多くの刺激的な新データの出現により急速に拡大し続けている領域の一つに、「クラウド（大衆）」に耳を傾ける研究がある。数々の実証分析から、金融市場に関し、クラウド（大衆）から発せられる情報は重要であると研究者たちは結論付けるようになっており、その仮説を実証することに驚くほど成

功している。しかし本当は驚くに当たらないかもしれない。既に、ウィキペディア、イエल्प (Yelp)、トリップアドバイザー (TripAdvisor)、アマゾンのようにクラウドのレビューや口コミに頼るウェブサイトは私たちの日常に溶け込んでい

る。われわれは、クラウドの意見を求めるようになってきており、クラウドの意見をますます信頼するようになってきたように見受けられる。

集合知 (wisdom of crowds: クラウドの知恵)

Jim Kyung-Soo Liew

米国メリーランド州ボルティモア市 ジョンズ・ホプキンス大学Careyビジネススクール 金融学、助教。

Shenghan Guo

米国メリーランド州ボルティモア市 ジョンズ・ホプキンス大学大学院 応用数学・統計学科修士課程在学

Tongli Zhang

米国メリーランド州ボルティモア市 ジョンズ・ホプキンス大学大学院 応用数学・統計学科修士課程在学

高山 裕一 (たかやま ゆういち)

日興アセットマネジメント(株)国際営業企画本部長。2000年ロンドン大学シティ校コース・ビジネス・スクール経営学修士。1990年慶應義塾大学経済学部卒。同年4月三井信託銀行入社。みずほ信託銀行、東京海上アセットマネジメントを経て、16年5月より現職。16年6月CAIA協会日本支部を立ち上げる (初代支部長)。英国、米国など在外勤務経験15年。CAIA FRM。