

プレミアム品購買データから読み解く消費者心理 —民間データとデータサイエンスが拓く、新しい投資・経済の視点—

伊藤 健
田代 大悟
饗場 行洋 CMA

目次

- | | |
|------------------|-----------------|
| 1. はじめに | 4. 増税前後の指標推移 |
| 2. 購買データを用いた経済分析 | 5. 景気指標との連動と先行性 |
| 3. 使用データと指標計算方法 | 6. 終わりに |

企業活動を反映した様々なデジタル・データが入手可能になっている近年、金融サービス業をはじめ、公的統計の分野でも民間データの利活用に向けた取組みが進む。筆者らは、経済産業省の令和元年度公募事業の一環として、日本最大の消費者購買（POS）データを用いて消費者心理の変化を推し量る指標を開発した。本指標は既存の消費者態度指数と類似のパターンを示しながら推移するとともに、複数の景気動向指標や株価指数とも連動あるいは先行することが示唆された。従来は公的統計のみに頼っていた景気動向把握や先行き見通しであるが、今後は、民間が保有するオルタナティブデータを用いることで、より迅速、詳細、多面的な分析ができる可能性が広がるであろう。



伊藤 健（いとう たけし）

野村證券(株) 金融工学研究センター クオント・ソリューション・リサーチ部 エグゼクティブ・ディレクター。2008年東京大学大学院理学系研究科物理学専攻修了。博士(理学)。同年4月、野村證券入社。09年よりインスティネット社（NY）でグローバルアルゴリズム取引担当シニアクオントアナリスト。18年4月よりAI・ソリューション・リサーチグループ・リーダー。



田代 大悟（たしろ だいご）

野村證券(株) 金融工学研究センター クオント・ソリューション・リサーチ部 クオント・アナリスト。2018年東京大学大学院工学系研究科システム創成学専攻修了。同年4月、野村證券入社。AI・ソリューション・リサーチグループ所属。



饗場 行洋（あいば ゆきひろ）

野村證券(株) 金融工学研究センター クオント・ソリューション・リサーチ部 シニアクオントアナリスト。2006年東京大学大学院理学系研究科物理学専攻修了。博士(理学)。同年4月、野村證券入社。インデックス開発業務などを経て、17年7月よりAI・ソリューション・リサーチグループ所属。