

特集

資産運用におけるオルタナティブデータ活用の現在と今後

座 談 会

資産運用における オルタナティブデータ活用の現在と今後

と き 2023年6月27日（火）

ところ 日本証券アナリスト協会会議室（諏訪部氏はニューヨークからオンライン参加）

《出席者》（敬称略、五十音順）

岩 田 雄一郎 CMA

（三菱UFJ信託銀行
資産運用部先端金融工学室 室長）

諏訪部 貴 嗣 CMA

（ゴールドマン・サックス・アセットマネジメント
計量投資戦略グループ 株式リサーチ共同責任者）

山 田 徹 CMA

（野村アセットマネジメント
リサーチ・フェロー）

吉 野 貴 晶 CMA

（ニッセイアセットマネジメント 投資工学開発
センター長、統計数理研究所 客員教授、青山
学院大学大学院 客員教授）

《司会者》

廣 瀬 勇 秀 CMA

（三井住友DSアセットマネジメント
運用部運用開発グループ グループヘッド）

目 次

1. オルタナティブデータの定義
2. オルタナティブデータ活用につながる歴史の振り返り
3. 運用現場での活用状況概観によるメリットと課題
4. 海外と日本の状況比較
5. 現状の課題と今後についての展望
6. まとめ

1. オルタナティブデータの定義

廣瀬 今回の議論では、実務的に利用する広い範囲のオルタナティブデータを扱っていく。オルタ

ナティブデータには、ビッグデータ、非構造化データなど様々なものがあるが、まず吉野さんから、オルタナティブデータの定義について話をうかがいたい。