

「みんなの気分」で金融市場が分かるか： 金融テキストマイニング研究の紹介

和泉 潔（東京大学）

金融市場は世の中の経済活動の活発さを反映しているはずである。だからもし、みんなが持っている平均的な景況感を早く正確に知ることができたら、株価が予測できるはずだ。Web 上の大量のテキスト情報から現在人々が経済状況に対して抱いている気分を抽出することが出来るかもしれない。専門家でないごく普通の人たちが、経済と直接は関係ないような事柄について書いたものから、金融の専門家が発信する市場に関わる様々なニュースや経済レポートまで、web 上には常に大量のテキスト情報が溢れている。送られてきた情報の全てを、自分で目を通して市場分析に用いることは、もちろん不可能に近い。近年、機械学習を用いたテキストマイニング手法によって、テキスト情報と市場変動の関係性を発見し市場分析に応用する研究が増えてきた。経済指標やマーケットのテクニカル指標等の数値情報には指標化されていないような情報を、テキスト情報から素早く自動的に抽出することが期待されている。金融テキストマイニングの最新研究事例を紹介する。