

最先端の金融工学分野“フオンツ”で 発想からモデル構築までを担う S-PLUS

フオンツ・リサーチ株式会社 様

“S言語”を核としてデータ解析を行うオブジェクト指向の対話型システムとして、人文社会科学系、自然科学系を問わず、幅広く利用されている**S-PLUS**。近年注目される金融工学の分野でも、各種の解析手法やデータマイニングなどを駆使してシミュレーションや意思決定支援を行うツールとして活用されている。



フオンツ・リサーチ(株)
取締役 会長 岩月秀樹氏

金融工学に特化した専門集団

金融の変革期を迎えた現在、統計的・数量的方法や科学的な考え方を使って株式などの投資対象を分析・運用する手法（あるいはその専門家）であるフオンツを活用する意味は、ますます大きくなっている。

「フオンツ手法は、現実の金融取引を数学的にモデル化し、膨大な株価・財務データなどを統計処理することによって、リスクをコントロールしながら高いリターンを追求していきます。金融の世界では、ますますこのようなハイテク技術が求められています」（岩月秀樹フオンツ・リサーチ会長）

フオンツ・リサーチでは、フオンツ手法で導き出した各種の情報を活用し、金融機関や機関投資家向けに、情報提供サイトの

運営や金融全般にわたるコンサルティング・システムの開発を実施。また個人投資家向けには、ネット・トレーディングに対応した株式銘柄の評価・選択やファイナンシャル・プランニングのための情報などを提供している。

「当社の特徴は、金融工学の専門家集団として、株式・債券・投資信託などすべての投資資産を対象に、金融工学を駆使した独自の加工技術・情報などの最先端サービスを提供することにあります」

フオンツを支えてきた S-PLUS

岩月氏は、エンジニアから金融業界に転身し、外資系証券会社に在籍した約10年間で、フオンツ・アナリストとして揺るぎない実績を築き上げてきた経歴を持つ。

「その間、そして現在に至るまで、思えば**S-PLUS**があったからこそ実現できた仕事やビジネスばかりです。データ分析、モデルの開発、アイデアの検証過程に、常に**S-PLUS**を使ってきました」

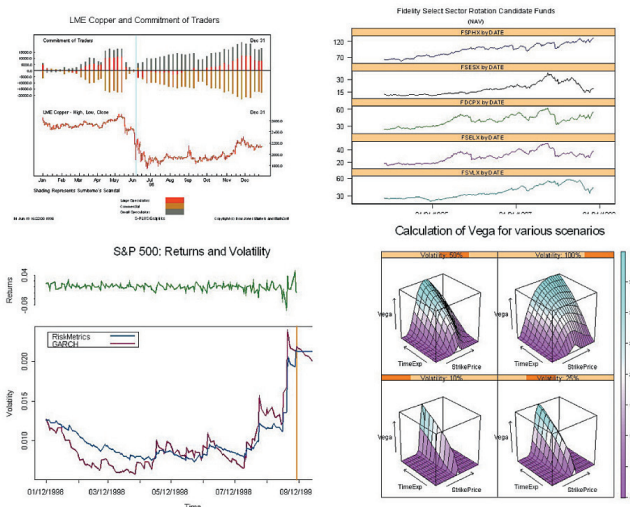
岩月氏が挙げる**S-PLUS**導入のメリットは、アイデアを迅速にモデル化する理想的な

ツールであること、理論とリアルな市場を照らし合わせ、モデルの最適化を行う試行錯誤が簡単にできること、さらにプログラムをライブラリ化し、幅広い応用が可能になることなど多岐にわたる。

「例えば株式関連の膨大なデータを処理するプログラムを作るとき、他の言語なら数百ステップ必要なプロセスが、**S-PLUS**の演算機能を使うとほんの数ステップに短縮できる。余分な作業に時間を取られず、本来の仕事に時間を活かせる価値は非常に大きいと思います」

岩月氏の名を世に知らしめた実績のひとつに「マーケットの歪み度分析」という分析手法の開発がある。マーケットの歪みを時系列に分析することによって発見したこの手法の構築も**S-PLUS**があればこそ実現できたという。

「現在のような複雑な経済状況のなかでこそ、多様な条件を自在に組み込んでモデルを構築できる**S-PLUS**は、フオンツの世界で威力を発揮するはず」と岩月氏。その言葉通り、同社では不動産の評価・分析モデル、未公開企業の評価モデルなど、日本では未発達な分野でのモデル開発に積極的な動きを見せている。こうした新たなビジネスモデルを発想し、構築するケースでは、**S-PLUS**の多彩かつスピーディな機能・性能が最大限に活用されていくはずである。



金融工学分野における S-PLUS の活用事例