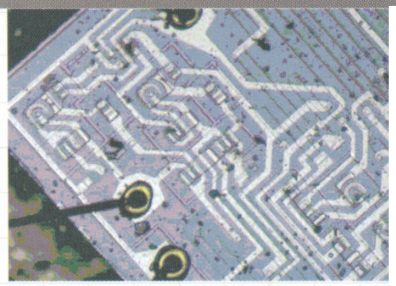
PR

ユーザー訪問／数理システム

金融工学に活かされる「S-PLUS／NUOPT」
～最先端“サイバー・トレーディング・ルーム”からの報告

森平　爽一郎
慶應義塾大学 総合政策学部　教授



データ処理能力だけでなく，美しいグラフィックを実現

慶應大学総合政策学部，森平教授は，同大学の藤沢キャンパス内に，今最も進んだ金融工学研究室である“サイバー・トレーディング・ルーム”を設立，運営している。アメリカの教育機関に，既に何カ所かあるこのような施設も，日本ではまだ唯一の存在。金融各界の熱い期待を担っている。

室内には，大型モニターと何台ものコンピューターが置かれ，世界のデータベースと24時間つながっている。そして，膨大な情報の解析に使われるソフトのひとつに「S-PLUS」がある。

「金融工学は，ただ大量のデータが処理できるということより，軽くてグラフィカルに計算結果が出てくるというのが必要で，「S-PLUS」では，それができる。さらに，ちょっと見てみたい，という時に使いやすい。画面がきれいだし，Power-Pointに入れられるから，プレゼンテーション用にはとてもいい。専門家でなくても，金融機関の人は，これを使っている人が多いのではないでしょうか。値段も手ごろですし」と氏は語る。

また，この“サイバー・トレーディング・ルーム”をよく利用する工学部の枇々木先生は，「S-PLUS」と「NUOPT」を組み合わせて使う機会が多い。同氏は，「細かいプログラムも書けるし，「S-PLUS Ver.4」以降はインターフェイスがよくなったので，簡単な使い方もできる。昔に比べて幅が広くなったのではないでしょうか。Excelのデータ取りこみができるようになって，とても使いやすくなった。ユーザーサポートもいいと思う」と語る。

Sは，世界中の研究者にとって共通言語になってきている。そのため，論文の最後にURLが載っていて，そのホームページにアクセスしてデータをダウンロードし，活用するといったこともかなり多くなってきているようだ。

「S-PLUS/NUOPT」を実際に利用した研究開発の実例

現在，この“サイバー・トレーディング・ルーム”では，不動産指数の作成，抵当証券の評価等に関して金融機関と共同で研究を行い，既にマーケットに商品も出している。その開発の多くに，S-PLUSが利用された。他に，企業の信用度，格付けの予測といったプログラムも研究開発している。

また最近，「トレーディング・ダービー」という6大学対抗，仮想株式運用競争が始まった。1億円を元本にいくらまで増やせるか，各校独自にシステムを作って競い合っている。他大学は，勘とチャートのテクニカル分析等を使ってポートフォリオを作成しているが，慶応湘南藤沢キャンパスの学生は，「S-PLUS」と「NUOPT」を使ってプログラムを作り，それが出すシグナルに従って売買し，現在のところ成績第1位ということだ。

「今まで日本の金融界は，規制に守られて，進歩が遅れた世界であった。その間に外国の人達は，自然科学の学者もこの分野に加わって，生き残る為に死に物狂いで技術を身に付けてきた。いきなりビッグバンだといっても，一朝一夕にはとても追いつけない」と語る森平氏。学生らが発想するプログラムについて，「これがうまく行けば，将来ファンドとして売り出せるかな」と微笑む氏の胸の内は，近い将来への期待と可能性を確信していることであろう。

日本には，この“サイバー・トレーディング・センター”ができるまで，理論を検証する場所さえなかった。今ここには，世界の金融のデータベースと，最新の解析ソフトがそろっている。このスペースを実験室にして，試行錯誤しながら新しい時代の金融商品を作り出していくことも夢ではないだろう。

- 商品の問い合わせ先 -
株式会社 数理システム
TEL：03-3358-6681
URL：http://www.msi.co.jp/