

S-PLUS ユーザカンファレンス 2004

金融・経済データベース  
NEEDS-FAMEの活用



日経メディアマーケティング株式会社  
URL <http://www.nikkeimm.co.jp/>

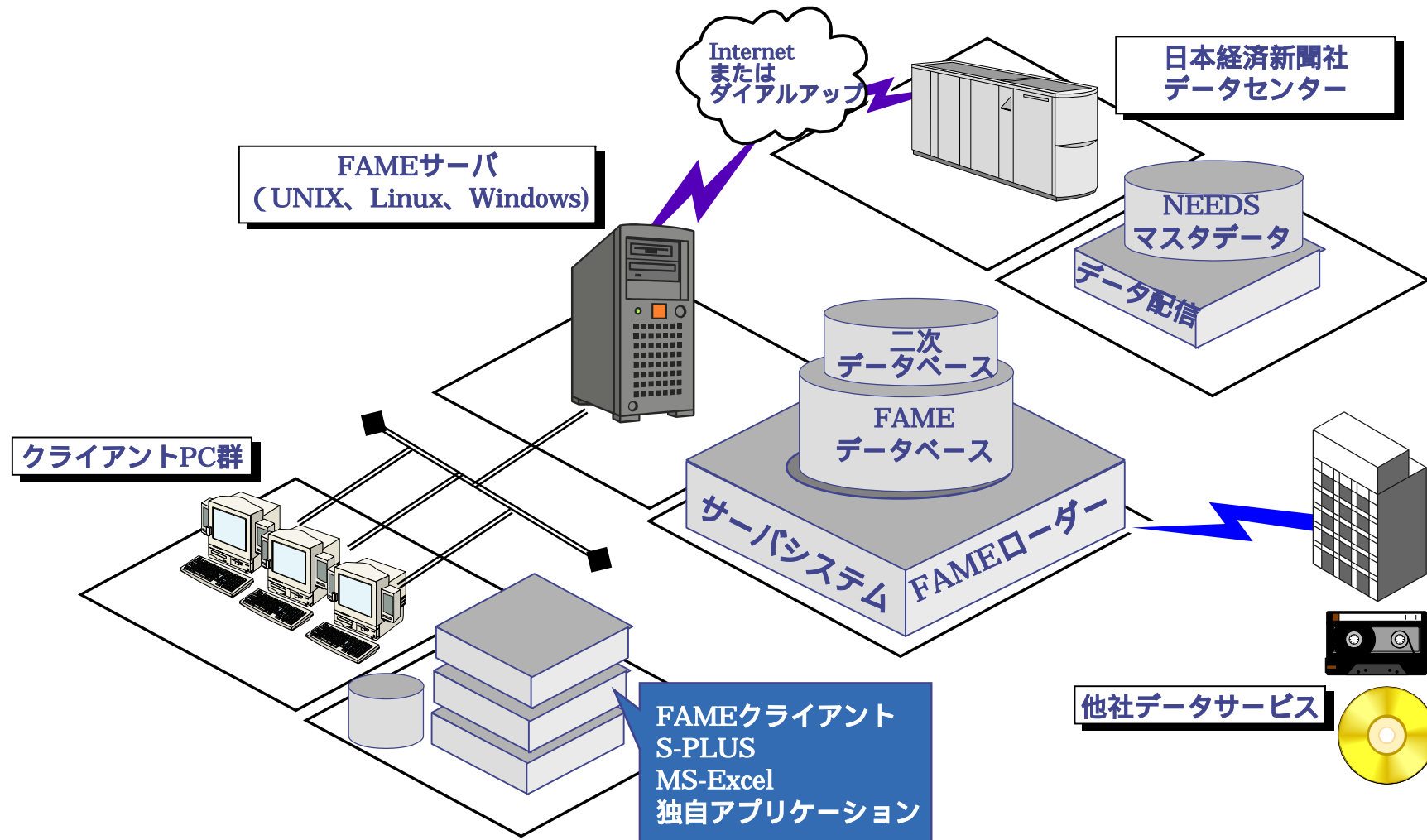
## NEEDS-FAMEサービス

- 品質の高さとカバレッジの広さで定評のある日経NEEDSの金融・経済関連データを提供します。
- プラットフォームとしては、金融データベースとして世界的に実績のあるFAMEを採用。パフォーマンスの高い柔軟なシステム環境を実現します。
- 提供データはFAMEデータベースとして蓄積。情報拡充などで投入データが仕様変更される場合、更新プログラムを即座にアップデート。システムの維持管理からユーザを解放します。
- 情報の一元化・集約化で無駄を省き、外部情報購入のコストを抑止できます。

## FAMEデータベース・システム

- 汎用リレーショナルデータベースとは全く異なるアーキテクチャ。金融・経済データなど、時系列データの扱いに特化した強力なデータベース・エンジンを実装。
- データベース作成・管理機能だけでなく、データ分析用アプリケーションとしての側面を併せ持つ。
- 小規模な業務から大規模システムに至るまで スケーラブルに対応。
- 金融・経済データをベースとする情報システム、時系列データウェアハウスのプラットフォームとして最適。
- フロントエンドのツールとしては、S-PLUSを始めユーザが使い慣れたアプリケーションを活用。

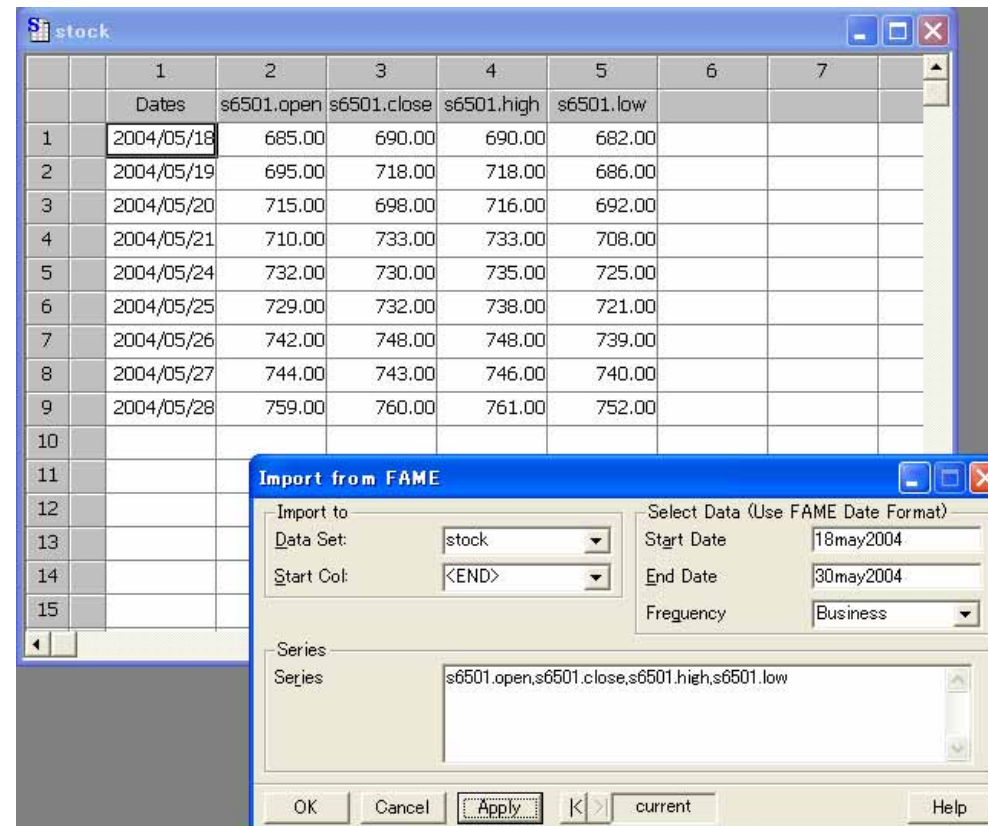
# システム構成例



# S-PLUSからのデータベース接続（１）

## ■ Import Data メニュー

- ◇ [From FAME...]メニュー  
コマンドを用いた方法
- ◇ FAMEデータベース上の  
時系列データをS-  
PLUSに直接取りこむた  
めのシームレスなインタ  
フェース



# S-PLUSからのデータベース接続（2）

## ■ Import Data メニュー

- ✧ [From ODBC Connection...]メニューコマンドを用いた方法
- ✧ FAMEのODBCドライバ(queryPoint)と接続することで、SQLベースの検索環境を実現するインタフェース

	1	2	3	4	5	6	7	8	9
	compcode	FAC	FLS	POPRO	FORPRO	FMPRO	FEP	FUP	sales
1	S1301	32005	157000.0	3900.0	3400.0	1800.0	16.47	1492004	true
2	S1331	32005	263000.0	7400.0	6000.0	1600.0	9.73	1492004	true
3	S1332	32005	520000.0	15000.0	14000.0	5000.0	18.04	1492004	true
4	S1333	32004	770000.0	12500.0	10500.0	4000.0	13.33	1332004	true
5	S1351	32002	52500.0		800.0	100.0	1.67	1632002	true
6	S1352	32005	20300.0	160.0	180.0	160.0	3.99	1492004	true
7	S1376	32005	44700.0		1300.0	850.0	25.21	2462004	true
8	S1377	32005	48000.0	2750.0	2800.0	1600.0	31.43	1492004	true
9	S1378	32005	25500.0	2630.0	1950.0	1050.0	42.12	1492004	true
10	S1380	32005	3770.0	160.0	160.0	250.0	59.82	1492004	true
11	S1381	32005	12410.0	620.0	620.0	340.0	60.53	2362004	true
12	S1491	32005	12500.0	0.0	0.0	0.0	0.0	1492004	true
13	S1501	32004	194600.0		-2600.0	-19000.0		13122003	true
14	S1503	32005	52600.0		900.0	700.0	4.54	2892004	true
	005	76000.0	4600.0	3600.0	2000.0	23.95	1492004	true	
	005	60000.0		1700.0	1300.0	19.55	1492004	true	
	2004	80000.0	11400.0	14300.0	9000.0	29.4	2082004	true	
	2002	125700.0		35000.0	1000.0	18.82	14122002	true	
	2004	29400.0	2800.0	3300.0	1600.0	26.23	2462004	true	
	005	84160.0	9120.0	11310.0	9560.0	167.27	1492004	true	
	005	7300.0	690.0	690.0	400.0	9.52	1492004	true	
	005	11700.0	1200.0	1200.0	700.0	34.57	3092004	true	
	2004	22210.0	940.0	940.0	450.0	103.06	3102004	true	

Import From ODBC

ODBC | Filter

From

Data Source: queryPoint

Add Sources... | Modify Source...

Table Name: DATA\_STOCKDATA

SQL Query: Select \* from DATA\_STOCKDATA where compcode='S1301'

To

Data frame: DATA.STOCKDATA

Start col: <END>

Insert at start col

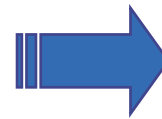
Overwrite target

OK | Cancel | Apply | current | Help

# FAME 直接利用の操作例 (4GL)

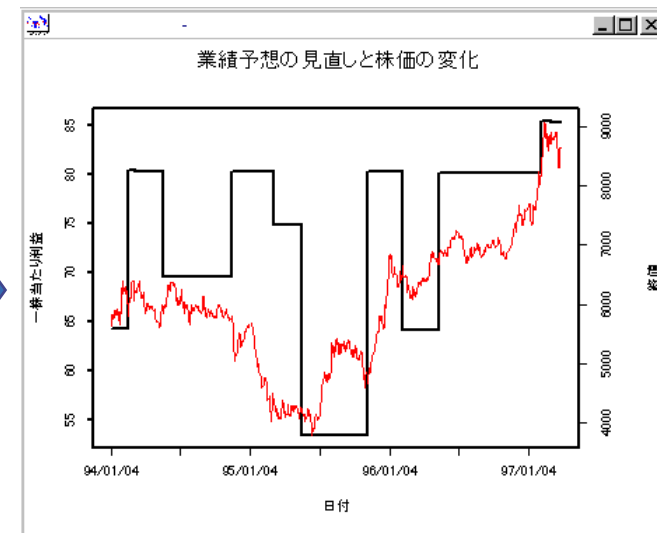
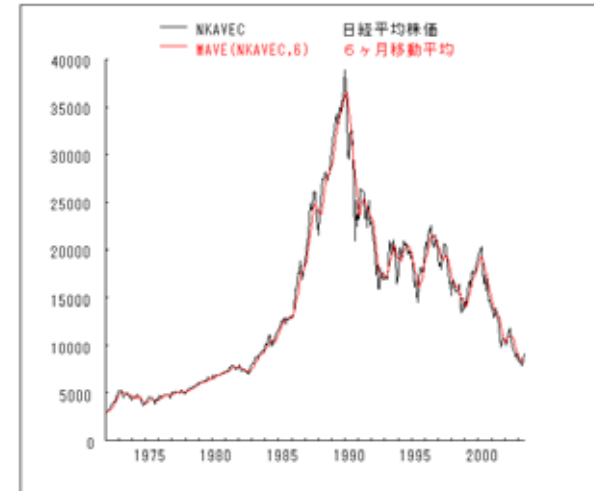
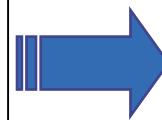
コマンド一発で自動的に  
期種変換 (例: 日次 月次)

frequency Monthly; convert on  
graph NKAVEC, mave(NKAVEC,6)

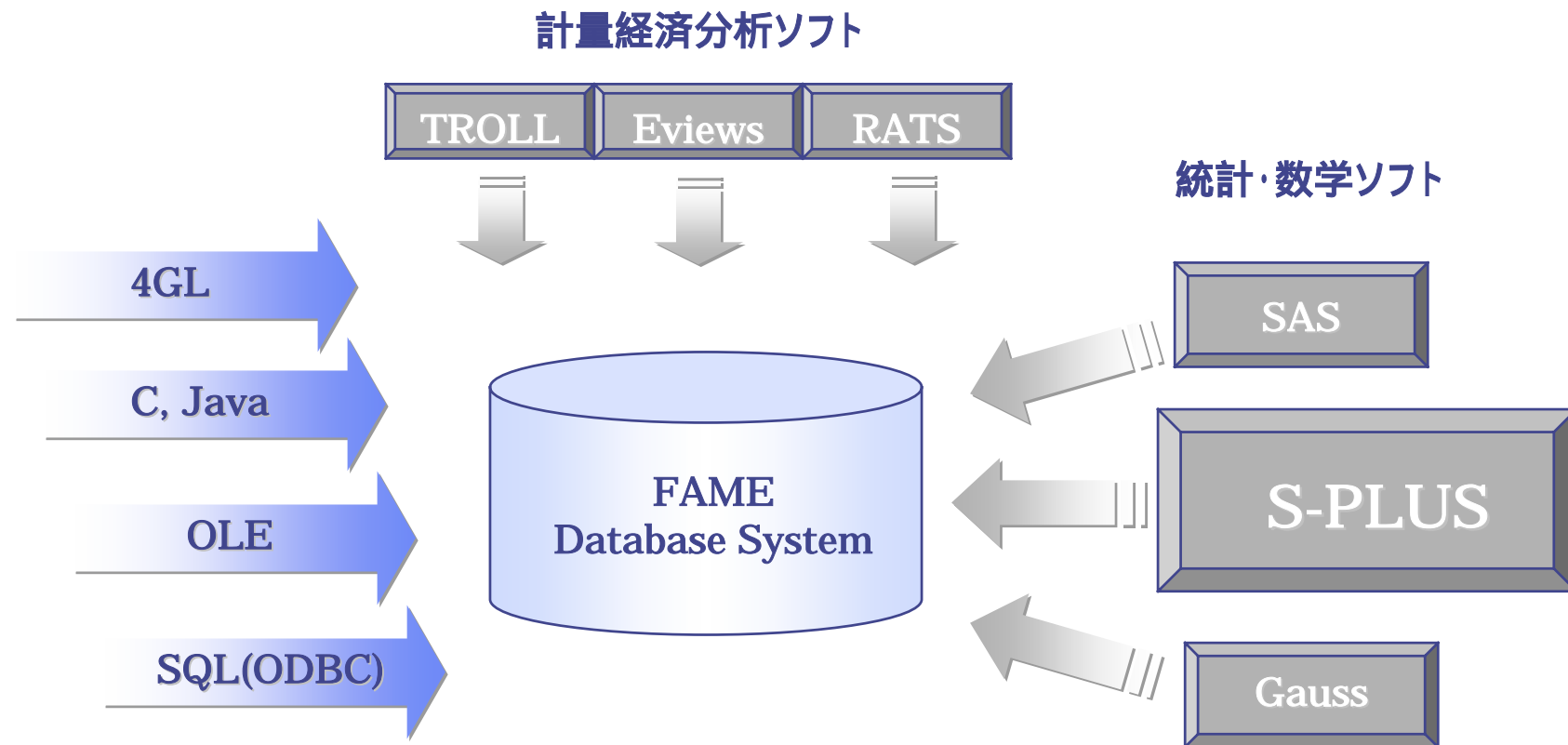


不定期データは単純にスタック  
利用時に時系列化して利用

	決算期	予想発表日	一株当り利益
1	2003/03	2002/04/26	33.25
2	2003/03	2002/09/10	37.42
3	2003/03	2002/09/14	37.66
4	2003/03	2002/10/31	25.12
5	2003/03	2003/03/11	17.51
6	2003/03	2003/03/13	13.99
7	2003/03	2003/03/15	17.18
8	2004/03	2003/04/28	21.56



# 連携・対外インターフェース





# データベース・ラインナップ - 企業情報 -

## 個別企業のファンダメンタル分析に欠かせない情報を網羅

企業基本データ	全国有力企業約3万社の事業内容、役員、大株主、労務状況、要約財務諸表など。
会社属性データ	全国有力企業約3万社の社名、所在地、設立年月日、上場情報など基本属性データ。
上場会社財務データ	金融機関と外国部上場会社を除く上場会社の本決算673項目、中間決算331項目、連結決算586項目、中間連結決算348項目。
ジャスダック上場会社財務データ	ジャスダック上場会社（金融機関を除く）の本決算、中間決算、連結決算、中間連結決算データ。
非上場有力会社（有価証券報告書） 財務データ	有価証券報告書を提出する会社（金融機関を除く）の本決算、連結決算データ。
銀行/証券/保険財務データ	有価証券報告書を提出する銀行/証券/保険の本決算、中間決算、連結決算、中間連結決算データ
上場会社財務速報データ	金融機関と外国部上場会社を除く上場会社の本決算、中間決算、連結決算、中間連結決算（決算発表時に収録）。
ジャスダック上場会社財務速報データ	金融機関を除くジャスダック上場会社の本決算、中間決算、連結決算、中間連結決算（決算発表時に収録）。
金融財務速報データ	上場、ジャスダック上場の銀行、証券、保険会社の本決算、中間決算、連結決算、中間連結決算（決算発表時に収録）。
セグメント情報データ(確報)	上場、ジャスダック上場会社の連結決算、中間連結決算ともに事業別、地域別、海外売上高のセグメント情報。
セグメント情報データ(速報)	上場、ジャスダック上場会社の連結決算、中間連結決算ともに事業別、地域別、海外売上高のセグメント情報（決算発表時に収録）。
業績予想データ（日経記者予想）	上場・ジャスダック上場会社の本決算、中間決算、連結決算の業績予想データと実績データ。
企業保有株式データ	金融機関を除く上場・ジャスダック上場会社の一時保有・投資有価証券の株数、簿価など。

# データベース・ラインナップ - 市場情報 -

## 価格情報の他、個別企業の資本異動情報によりきめ細かい分析をサポート

株式・債券データ	上場・ジャスダック上場銘柄の価格や増資などの権利落・配当金関連データと上場債券、店頭CBの価格、償還日、発行利率など。
厚基連評価時価ファイル	国内証券（株式、債券、先物、オプション、非上場債券）と海外証券を対象に、は厚生年金基金連合会の指針に即して、年金資産時価評価用にカスタマイズした時価情報。
非上場債券データ	開示対象非上場公募債券6,000銘柄・主要非公募債6,000銘柄の評価時価と属性データ。
債券標準価格（JSPrice）	日経、野村グループの四社で共同算出する債券標準価格データ。市場実勢を反映させつつ、四社で精査した価格。
先物・オプションデータ	株価指数先物、債券先物の価格、出来高、気配値等を収録。株価指数オプション、債券先物オプション、個別株オプションの価格、出来高など。
資本市場指標・証券市場指標データ	日経平均株価などの指標データ、三市場信用取引残高、投資部門別株式売買動向など。
TOPIX	東証の公表する株価指数関連の基礎情報、上場株式数、配当込み指数。
企業ファイナンスデータ	上場・ジャスダック上場会社約3,000社の会社別の時価発行増資や株式分割などの資本異動関連情報、株式の転換情報、起債情報、転換価格や現存額などの変化情報。
債券インデックスデータ	上場債券、公募の利付き普通債全銘柄を対象に総合的な利回りを算出。
BB国債データ	取引所の時価以外に、流通市場におけるBB国債引け値データや公社債店頭基準気配を収録。
国内商品市況データ	主要商品市況の現物価格データ、日経商品指数など。
ティックデータ	個別株式、先物・オプション、株価指数における、日中の約定（気配）値や出来高（気配数量）、発生時刻を収録。

# データベース・ラインナップ - 金融/マクロ/産業 -

## 国内経済統計のほとんど全域をカバー

金融統計データ	マネーサプライ、金利、資金循環勘定、金融機関主要勘定など主要金融データ。
為替・金利日次データ	国内・海外の為替・金利に関する日次データ。
日経総合経済ファイル	国民所得統計、生産活動、企業経営、金融・財政、貿易・国際収支など国内の主要経済統計。
生産・出荷・在庫統計データ	経済産業省「主要製品生産・出荷・在庫実績」の全品目データ。
物価指数データ	日銀の企業物価指数（従来の卸売物価指数）、輸出入物価指数、投入・産出物価指数。
新概念企業物価指数	企業物価指数のうち、毎年ウェートの変わる連鎖型指数と、消費税要因を補正した税抜き指数。
消費統計データ	総務省の「家計調査」「消費者物価指数」。
SNAストックデータ	「国民経済計算年報」から家計や企業が保有する資産や負債のストックデータ。
エネルギー統計データ	石油、石炭、ガス、電力の需給データと価格などエネルギー関連指標。
法人企業季報統計データ	財務省の「法人企業統計季報」を四半期ベースで収録。
法人企業統計年報データ	財務省の「法人企業統計年報」の詳細データ。
規模別総合経済データ	「中小企業調査月報」「日銀短観」「金融経済統計月報」などから大企業・中小企業別統計。
産業データ	経済産業省「生産動態統計」などの政府統計、各種業界統計の産業別データ。

# データベース・ラインナップ - 海外情報 -

## ワールドワイドな金融・経済・証券データの提供

North American Pricing	米国、カナダの株価、ミューチュアルファンドの価格、資本異動、属性データ
U.S. Options	米国のオプション価格、属性データ
U.S. Commodities and Futures	米国の商品先物データ
U.S. Corporate Bonds	米国の債券価格、属性データ
Global Pricing	北米以外の各国の証券価格、資本異動、属性データ
S&P Compustat	北米企業の財務データ
First Call	米国、カナダ、メキシコ企業の業績予想データ
I/B/E/S	各国の企業の業績予想データ
DRI Databases	各国のマクロ経済・金融データ
MSCI	各国の主要インデックスデータ、MSCI採用銘柄の株価指標データ
Worldscope	各国の企業プロフィール、ファンダメンタルズデータ

その他、日本経済新聞社のデータ以外の投入も可能。  
 (Bloomberg社の債券データ、東洋経済新報社の業績予想、各種債券格付け  
 情報など、多数の実績があります)

## 数々の導入実績

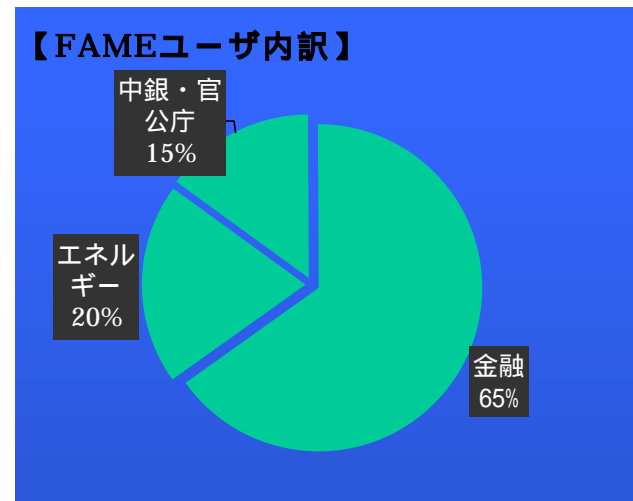
導入は世界40カ国、300社以上。

用途は証券投資分析、ポートフォリオ管理、リスク管理、銘柄管理、指数サービス、景気予測 など多岐。

RiskMetrics社では、サービス用データをFAMEでメンテナンス。

Financial Times(FT)社の指数はFAMEを用いて計算。

OECDでは統計書の作成をFAMEで行っている。



- 【国内】 金融機関の情報系システムのプラットフォームとしてのご利用
- ...調査研究部門（アナリスト、エコノミスト）、資産運用部門
  - ...各種情報端末の整理統合を目的として。
  - ...基幹業務向けの情報発信基盤として。

## お問い合わせは

### 日経メディアマーケティング 株式会社 金融公共営業本部ソフトウェア部

〒101-0047 東京都千代田区内神田2-3-4

受付（平日）03-5295-6231

E-mail : [needs-fame@nikkeimm.co.jp](mailto:needs-fame@nikkeimm.co.jp)

URL : <http://www.nikkeimm.co.jp>