

【NRI からのお知らせ】

2018 年 7 月 17 日  
株式会社野村総合研究所

## 金融情報データ提供サービス IDS で 逆日歩発生予測データを提供開始

株式会社野村総合研究所（以下、「NRI」）は、現在提供している金融情報データ提供サービス IDS<sup>\*1</sup>（Integrated Data Services）において、逆日歩<sup>\*2</sup>発生予測データの提供を2018年5月25日に開始しました。

昨今、同一の株式銘柄について、現物取引の買い注文と信用取引の売り注文を同時に出し（クロス取引）、株価変動リスクなしに株主優待の権利を得る取引が、個人投資家を中心に多数行われ、その影響で当該銘柄の逆日歩が高騰する状況が散見されています。

NRIはこのような状況を踏まえ、個人投資家の投資判断材料となるように、逆日歩の発生確率や、株価に対する逆日歩の比率などを予測する仕組みを構築しました。この仕組みで作成される逆日歩発生予測データは、IDSを通じてファイルで提供し、金融機関のオンライントレードサイト等において、表示する形で利用いただくことを想定しています。

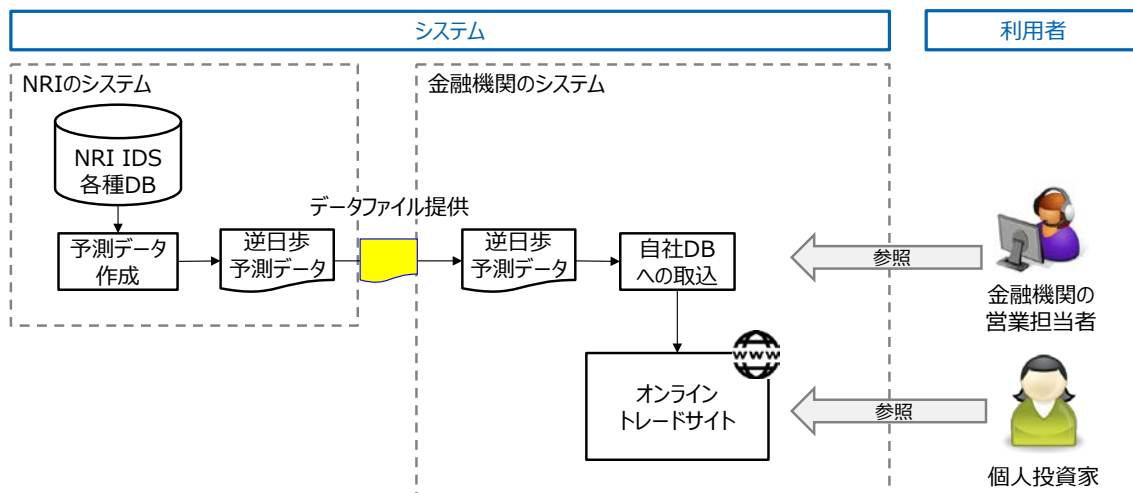
### ■IDSの逆日歩発生予測データの特徴

- ・1日3回の提供タイミング
- ・予測基準日に対して、1日3回の各時点で得られる、各銘柄の株価、時価総額、過去の逆日歩発生状況、貸借融資残高情報、株主優待データなどをもとに、NRI独自のロジックで作成

表 1 予測データの提供タイミングとインプットとするデータ

	提供タイミング	インプットとするデータ
第1報	予測基準日の前営業日 17:00 頃	大引け時点で得られる市場・株主優待データをもとに予測
第2報	予測基準日の前営業日 20:00 頃	貸借融資残高情報を含めて予測
第3報	予測基準日当日の 12:00 頃	当日株価や前営業日逆日歩情報を含めて予測

図1 予測データの提供イメージ



NRI では、今後も提供するデータの拡充等により、より付加価値の高いデータサービスを提供していきます。

※1 IDS : NRI による、金融情報データ提供サービスです。長年にわたって NRI が蓄積してきた国内外の経済・金融・企業・証券に関するデータとともに、データを利用する際のさまざまな課題に対するソリューションを、経験豊富なデータアナリストが提供しています。詳しくはこちらをご参照ください。

<http://fis.nri.co.jp/ja-JP/service/list/F-J/IDS.html>

※2 逆日歩 (ぎゃくひぶ) : 信用取引において、信用売りが信用買いを上回り、株券が足りなくなった場合、株券の貸方である証券金融会社が、不足を補うために機関投資家などから株券を借りる際に必要なコストです。最終的には信用取引を行う投資家が負担します。品貸料とも呼ばれます。

### 【ソリューションに関するお問い合わせ】

株式会社野村総合研究所 投資情報サービス事業部 金島、<sup>きさいち</sup>私市、小室  
 TEL : 045-613-7200 E-mail : ids-sales@nri.co.jp