2023 年 1 月 25 日
株式会社三菱 UFJ トラスト投資工学研究所
株式会社ＪＰＸ総研

# MTEC 及びＪＰＸ総研は、FLEX Full データを加工して提供する「株式売買注文データ加工サービス」を開始

株式会社三菱 UFJ トラスト投資工学研究所（以下、MTEC）及び株式会社ＪＰＸ総研（以下、ＪＰＸ総研）は、ＪＰＸ総研が提供している東京証券取引所（以下、東証）株式市場における株式売買注文のヒストリカル情報である FLEX Full データを、データ分析を行いやすい形式に加工して提供する「株式売買注文データ加工サービス」を開始します。

FLEX Full データとは東証においてリアルタイムで提供している株式市場の相場情報を日々蓄積し、ＪＰＸ総研がヒストリカル情報として提供しているデータセットです。FLEX Full データは株式の注文・約定の履歴を最も細かく分析できるデータであることから、取引時間内の価格形成や流動性（マーケットマイクロストラクチャー）の分析、取引コストの評価を行うにあたって機関投資家等に広く利用されております。しかしながら分析にあたっては、板情報を再現した上で必要な情報を抽出したり、加工したりするなどの下処理が必要となり、大規模な分析を行うには多大な計算リソースが必要です。「株式売買注文データ加工サービス」では、MTEC がビッドアスクスプレッド（最も低い売り注文価格と最も高い買い注文価格の差）をはじめとする、マーケットマイクロストラクチャーの研究においてよく利用される情報へ FLEX Full データを加工し、CSV 形式に変換して提供します。これにより、ユーザがデータ分析・活用する際の負荷やハードルを下げることが期待されます。

サービスの詳細は以下のホームページをご参照ください。
https://www.jpx.co.jp/markets/paid-info-equities/historical/04.html

**株式会社三菱 UFJ トラスト投資工学研究所（MTEC）**

MTEC は、わが国初の金融工学に特化したシンクタンクとして設立された、三菱 UFJ 信託銀行の子会社で、30 年以上に亘り、資産運用やリスク管理等の実務的なモデル開発、理論研究、学界活動などを通じ常に金融工学のフロンティアを歩んできました。近年では、三菱 UFJ フィナンシャル・グループの枠組みを超えたお客様にも投資助言やデータアナリティクス等のサービスを提供しています。

**株式会社ＪＰＸ総研**

ＪＰＸ総研は、市場全体の機能強化及び効率化に繋がるマーケット・サービスの創造を追求することを目的に、取引所ではない子会社として新たに設立されました。主に金融商品市場に関係するデータ・インデックスサービス及びシステム関連サービスを提供しています。

**お問い合わせ先**

株式会社三菱 UFJ トラスト投資工学研究所
調査営業部
電話：03-6665-7286（代表）
E-mail：indas@mtec-institute.co.jp

株式会社ＪＰＸ総研
フロンティア戦略部 データサービス企画グループ
電話：03-3666-1361（代表）
E-mail：inf_dev@jpx.co.jp