

[背景・目的] 株価の変動を確実に予測することは、常に最新の情報を把握している投資家であっても困難であるとされている。そこで、**Twitter** やブログといったソーシャルメディア上に生活者が投稿したデータであるソーシャルデータと、株価の変動の度合いを示すボラティリティを組み合わせる新しい解析手法を検討した。

[方法] 企業の **Wikipedia** アクセス数とその企業名が含まれたツイート数をそれぞれ平均値で規格化したうえで同期間のボラティリティとの共相関関数を算出し、**Twitter** の値のみがピークを示した期間で何が起きたのか考察した。

[結果・考察] 図 1 は **New Relic** の結果である。この図では 11 月中旬と下旬に **Twitter** の値がそれぞれ非常に大きなピークを示しているが、**Wikipedia** の値には比較的大きなピークは見られない。この期間には企業や個人による広告宣伝を目的としたツイート数が他期間に比べて約 3~50 倍みられ、それは株価終値の反発の時期と対応していた。これと同様のことが他企業でも起きているかどうか検証した。

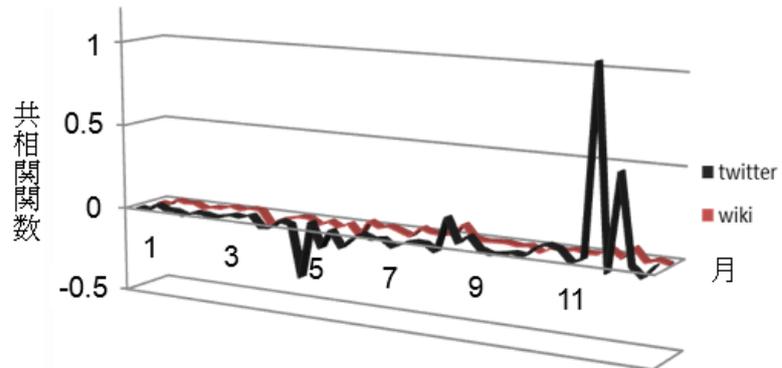


図1 New RelicのWikipediaアクセス数とツイート数のボラティリティとの共相関関数