
株式売買注文データ 加工サービス

2023年1月25日

株式売買注文データ加工サービス

株式会社JPX総研が提供している東証株式市場の注文履歴を最も細かく分析できるFLEX Fullデータを、お客様のニーズに応じて加工いたします。

執行分析や日中株価・出来高分析などにご利用いただけます。

1. サービス概要

- ① 1日当たり、数GBに及ぶ株式売買注文履歴データを、時間経過を補足しつつ加工します。
- ② 2010年のarrowhead運用開始当初から、一貫した加工方法を適用します。
- ③ 電文形式のFLEX Fullデータから、分析に利用しやすいcsv形式に変換します。

2. ご利用方法

- ① ご用意している12種類のデータ加工メニューから、ご希望の加工方法をご選択頂けます。
- ② 加工前のFLEX Fullデータも合わせてご提供可能です。
- ③ ご契約後、2週間程度で加工後のデータをご提供します。
- ④ 加工後のデータは、インターネット経由でお客様がダウンロードして頂く形態です。

本サービスご提供にあたり、株式会社JPX総研と弊社は共同事業契約を締結しております。

1 三菱UFJトラスト投資工学研究所 (MTEC)

3. 12種類のデータ加工メニューと提供データのイメージ

	名称	提供形態
A	指値情報	銘柄単位
B	ビッドアスクスプレッド	一日単位
C	マイクロプライス	一日単位
D	ボリュームカーブ	一日単位
E	約定値別出来高	一日単位
F	VWAP	一日単位
G	約定価格ボラティリティ	一日単位
H	マイクロプライスボラティリティ	一日単位
I	注文回数、約定回数、キャンセル回数	一日単位
J	特別気配情報	一日単位
K	実行スプレッド、逆選択コスト、実現スプレッド	一日単位
L	オーダーインバランス	一日単位

FLEX Full 電文形式

```
QS 13 20725000+090005170290100 7100+0 12+0
QS 13 20720000+090005238092100 13900+0 12+0
:
```

① 注文板の変化を再構築

売り指値量	指値価格	買い指値量	売り指値量	指値価格	買い指値量	売り指値量	指値価格	買い指値量
1,100	2,073.5		1,100	2,073.5		1,100	2,073.5	
9,800	2,073.0		9,800	2,073.0		9,800	2,073.0	
6,900	2,072.5		7,100	2,072.5		7,100	2,072.5	
16,200	2,072.0		16,200	2,072.0		13,900	2,072.0	
3,900	2,071.5		3,900	2,071.5		3,900	2,071.5	
	2,070.0	261,800		2,070.0	261,800		2,070.0	261,800
	2,069.5	19,900		2,069.5	19,900		2,069.5	19,900
	2,069.0	25,100		2,069.0	25,100		2,069.0	25,100
	2,068.5	9,700		2,068.5	9,700		2,068.5	9,700
	2,068.0	48,600		2,068.0	48,600		2,068.0	48,600

② 再構築した注文板から、各種情報を集計

```
ビッドアスクスプレッド平均値
9:00:00~9:00:01 3.77円
9:00:01~9:00:02 2.81円
```

本資料に関するご留意事項

- 本資料に掲載している弊社の見解等につきましては資料作成時におけるものであり、経済環境の変化、相場の変動、税制等の各種制度変更等により、予告することなく内容を変更することがございますので、予めご了承下さい。
- 本資料に記載されている数値は過去のデータや一定の前提値等に基づく分析およびシミュレーションであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。また、分析手法、モデルおよびシミュレーション手法についても必ずしも完全なものではなく前提値に大きく左右される可能性があり、その内容も情報のご提供時から予告することなく変わる可能性がありますので、ご留意下さい。（前提値には当該資料に記載した内容のほか、分析手法、モデル、シミュレーションの内容も含まれます。）
- 弊社は、いかなる場合がありましても、本資料の提供先ならびに提供先から本資料を受領した第三者に対して、直接的、または間接的なあらゆる損害等について、賠償責任を負うものではありません。また、本資料の提供先ならびに提供先から本資料を受領した第三者の弊社に対する損害賠償請求権は明示的に放棄されていることを前提とします。
- 本資料の著作権は三菱UFJトラスト投資工学研究所に属し、目的を問わず無断で引用または複製することを禁じております。

本資料に関するお問い合わせ先
三菱UFJトラスト投資工学研究所 調査営業部
メールアドレス indas@mtec-institute.co.jp TEL03-6665-7286
(受付時間：9:00～17:00（土日・祝日除く）)

世界が進むチカラになる。

変化の速い時代、全てのステークホルダーが課題を乗り越え、
持続可能な未来、新たなステージへと進もうとしています。
その思いを叶えるチカラになること、そのために全力を尽くすこと。

これが未来に向けて変わらない
MUFGの存在意義です。