

## 企業業績をTVのデータで先読み

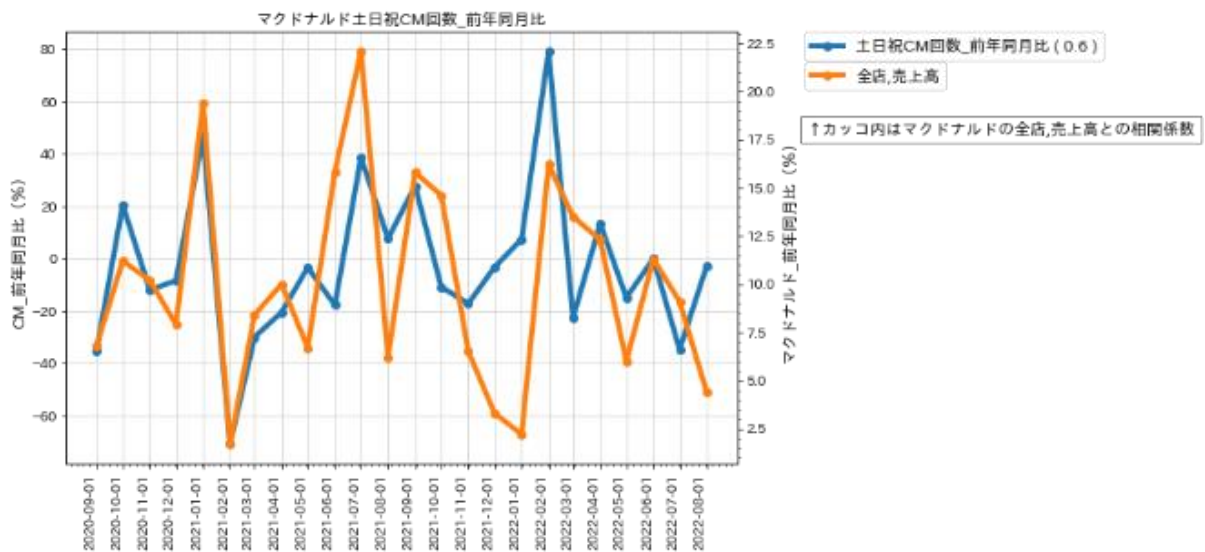
株式会社エム・データは、テレビで放送された番組やCMをテキスト化（データベース化）した「TVメタデータ」を提供している。ある企業の商品を番組で取り上げた場合、「いつ」「どこで」「誰が、何を」「どのように」「何秒間・何回」放送されたかをオリジナルのデータ収集システムを使用しデータ生成したものだ。テレビから得た情報は消費行動に影響すると仮定し、検証したところ、実際に売上高との相関関係が確認できた。

エム・データが提供しているのはTV番組データ、TVCMデータ、商品データ、スポットデータなどがある。放映当日のデータ提供もできる。今回は金融情報サービスのQUICKが提供するデータ・プラットフォーム「QUICK Data Factory」を使い「TVメタデータ（TV-CMデータ）」を使って分析した。TV-CMデータは、放送されたテレビCMの企業名と商品名、放映秒数を基本情報とし、CMのシチュエーションや出演しているタレント、使用されている楽曲などをテキスト化したデータになる。

### 月次売上高を予測

外食大手の日本マクドナルドホールディングス（2702）の月次売上高と比較した。発表されるのは翌月になる。

マクドナルドのCMの放映回数を月単位で集計して前年同月比の変化率を算出し、全店売上高の前年同月比の増減率と比較した。全日、平日、土日祝それぞれのパターンで月次売上高と比較したところ、土日祝との相関関係が最も強かった。



グラフを参照すると2つのデータが概ね連動していることが分かる。相関係数は0.6となっており、中程度の相関となっている。テレビから収集できるデータで、企業の売上高を一定程度、予測できることになる。

## 商品戦略を推測

企業の商品戦略もテレビのデータから推測できる。丸亀製麺を展開するトリドールホールディングス（3397）のTV-CMデータを商品ごとに集計したところ、2021年4～6月は丸亀うどん弁当のCM放映が目立っていた。決算説明資料では、テイクアウトを強化したとの記載がある。21年7～9月には、トマたまカレーうどんのCM放映が増えていた。当該期間の決算資料にも、当該商品の記載があった。

年	商品名											計
	うどんて日本に 元気を届けるモチカ-	外鶏天 ぶっかけ	トマたま 加-うどん	牡蠣たま あんかけ	釜揚げ うどん	丸亀 うどん 弁当	丸亀 こども うどん 弁当	企業	鬼おろし 肉ぶっかけ	焼きたて 肉うどん	熱盛 鍋焼き うどん	
~2021-03-01まで					13			4467				4480
2021/4/1					115	195		43				353
2021/5/1						158		93				251
2021/6/1						151		1				152
2021/7/1						50	146		81			277
2021/8/1			20			48	203					271
2021/9/1			216			17						233
2021/10/1			16		7	223						246
2021/11/1					31	151		125				307
2021/12/1					219							219
2022/1/1	1			115	14						5	135
2022/2/1					27							27
2022/3/1												0
2022-04-01~		48	420	0	0	278	0	549	196	172	0	1663
計	1	48	672	115	426	1271	349	5278	277	172	5	8614

同社は定期的に新商品を投入している。全てをテレビCMとして放映している訳ではないが、決算資料に記載されるのはCMをしている商品が中心だ。つまり、テレビのデータ分析によってトリドールHDが注力している分野や具体的な商品が分かる。決算資料が開示されるのは期が終わった翌月か翌々月になるため、会社側の公式な発表前に、商品戦略を先取りできる。

以上の検証により、エム・データのTVメタデータは企業業績や経営戦略の分析に活用できそうなことが示された。今回はTV-CMデータの検証だったが、番組で企業や商品・サービスが紹介された際の業績相関が高いことから、今後はTV番組データでの検証も進める予定。エム・データはテレビ番組及びCMの放送実績データ（TVメタデータ）の蓄積・編集・加工・配信及び集計・分析・二次調査・マーケティング調査を主な事業としている。近年はTVメタデータをオルタナティブデータとして、機関投資家等へのデータ提供にも取り組んでいる。

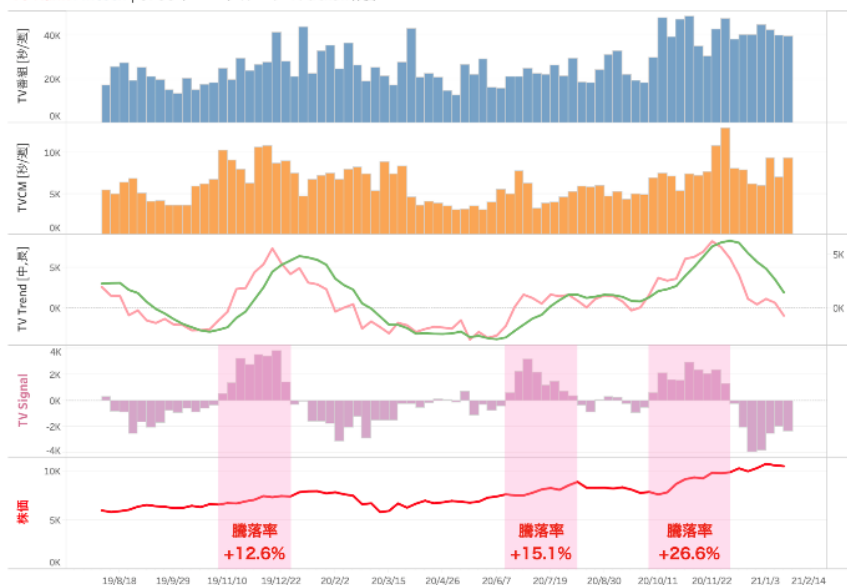
<https://mdata.tv/>

エム・データ社が生成する「TVメタデータ」は、24時間365日のテレビ放送（番組及びCM）をテキスト化・DB化したデータです。

いつ、どの番組で、誰が、何を、どのように、何秒伝えたか記録したもので、放送量や内容を企業（銘柄）別に集計でき、企業のマーケティングの活動量を可視化することで、株価の先行指標、上昇シグナルとするオルタナティブデータ活用が可能です。また企業（銘柄）別の放送量を時系列の変化で集計することで、TV指数としてインデックス化できます。

## 「勝率8割！ 上方修正発表の3週間前にシグナル点灯」

TV Rank Fintech | 6758 ソニーグループ TV trend x 株価



TOPIX Core30銘柄

オルタナデータ①  
テレビ番組露出

x

オルタナデータ②  
テレビCM露出

① x ②  
中・長期トレンド

244週 2016/11~2021/6  
675シグナル TVトレンド上昇期  
532勝 株価上昇  
(2週以内、勝率78.8%)

検証データ  
株価

図の事例はソニー社のCMと番組露出量を分析したもので、移動平均を長期と中期の折れ線グラフで重ね、中期線が長期線を上抜けるゴールデンクロスでTVトレンド上昇の開始点（シグナル）とします。

これを上位30銘柄で過去5年のバックテストをしたところ、シグナル出現675回の内、532回（約8割）でシグナルから2週間以内の株価上昇が確認され、TVメタを活用することで株価上昇シグナルを最大で数週前にキャッチできた検証結果でした。

センチメントに影響を与えるTV情報で、様々な切り口での銘柄発見や投資判断ができ、他のデータと組み合わせた新たな指標化が期待されます。