

QUICK 株式リスクプレミアム

国内上場株式の分析に不可欠なデータをご提供

1. 国内上場株式の株式リターン・資本コスト等の算出に必要な各種データをご提供します

2. 各データの算出式と定義は、解説資料をご用意しております

3. 必要な項目のみご選択いただけるよう、サービスメニューは細分化しております

4. ヒストリカルは、2003年1月～（一部項目を除く）をご提供します

5. データ更新は、月次となります

ご提供内容

以下のサービスメニューから必要な項目のみをご選択いただけます。

No.	項目名	コメント
1	QUICK 株主資本コスト	・QUICK 株主資本コスト (株式リスクプレミアム+長期リスクフリーレート)
2	個別株式リスクプレミアム (A)	・残余利益モデルを用いて、市場の株価から逆算したもの ・個別株式のファクター感応度に、対応するファクターリスクプライスを乗じたものを合計した値 (注) 当サービスの提供アイテムで「1.QUICK 株主資本コスト」に収録のアイテムを計算することができます
3	個別株式リスクプレミアム (B)	・個別株式のファクター感応度に、対応するファクターリスクプライスを乗じたもの (ファクター別リスクプレミアム)
4	残余利益モデル関連	・残余利益モデルを用いて逆算した、個別株式の株式リスクプレミアム ・3ステージ残余利益モデルの各種パラメーターも収録 ・各種株式リスクプレミアム (および業績予想主体) 別の、理論株価の市場価格に対する倍率
5	モデルのファクター時系列	・Fama=French の3ファクター計算方法を日本の株式市場に適用して算出する3つのファクター ①株式市場ファクター、②サイズファクター、③バリュウファクター ・オプション価格モデルをベースに計算する、企業の債務超過確率を利用したファクター (DMS ファクター)
6	ファクターリスクプライス	・個別株式のファクター感応度を説明変数とし、個別株式の株式リスクプレミアム、過去5年の月次超過リターン平均を被説明変数とするクロスセクション回帰での係数推定値
7	個別株式ファクター感応度	・個別株式の過去5年の月次超過リターンを被説明変数とし、「5.モデルのファクター時系列」収録のファクターを説明変数とした時系列回帰での係数推定値
8	債務超過確率 (オプション価格モデルベース)	・オプション価格モデルをベースに計算する、企業の債務超過確率 ・日々の値と過去12カ月平均 (月末値)
9	非流動性指標	・拡張型 Amihud の非流動性指標 (illiquidity)

ご提供方法

ファイルでご提供します。詳細は、別途にご相談ください。

お問い合わせは



サービスの詳細やご契約につきましては、
弊社営業担当まで、是非お問い合わせください。

corporate.quick.co.jp