

2017年2月17日  
株式会社フィスコ (3807 JASDAQ)

## フィスコ AI 株価自動予測システムの第二弾をリリース ～業績や出来高の判断を更に精緻化、買いの勝率は 67%～

株式会社フィスコ(JASDAQ 上場、証券コード「3807」、本社:東京都港区、代表取締役社長:狩野仁志、以下、「フィスコ」)は、従前にサービスを提供していた LaQoo+ (ラクープラス)による株価自動予測システムを大幅に改良し、2016年6月にAI(人工知能)による株価自動予測システム「フィスコ AI( <https://www.fiscoai.com/> )」をリリースいたしました。今回、当該銘柄が買いなのか売りなのかを判断する際の材料として、業績や出来高の動向分析を更に精緻化した第二弾をリリースいたします。

フィスコでは従来より LaQoo+による株価自動予測システムをてがけ、アルゴリズムトレードの研究を継続してきました。昨今におけるコンピュータの処理能力の向上にあわせ、AI(人工知能)の機能が増進し、最先端かつ異次元の仕組みをつくる環境が整ってきたと判断、2016年2月より子会社である株式会社カイカ(JASDAQ 上場、証券コード「2315」、本社:東京都目黒区、代表取締役社長:牛 雨、以下「カイカ」)との連携によるフィスコ AI 株価自動予測システムの開発を推進してまいりました。

前回の改訂(ver.1)では、投資家の動向を加味した株価自動予測システムへとバージョンアップし、デザインも一新しています。具体的には、フィスコでは全上場企業の業容およびコメントを無料で提供する「フィスコ Web( <https://web.fisco.jp/> )とアプリ( <http://app.fisco.jp/> )」を提供しており、日々膨大な投資家による閲覧履歴が積み上がっております。そのデータを活用することで、投資家の動向を反映するシステムを構築しています。

今回の改訂(ver.2)では、業績や出来高の判断を更に精緻化し、2016年10月1日から2017年1月20日までの計測において買いスタンスで勝率 67.3%(1,319 勝 625 敗 16 分け)、騰落率(※)+19.3%、売りスタンスで勝率 54.1%(119 勝 98 敗 3 分け)、騰落率(※)+20.6%を記録しております。具体的には、売上高、利益の実績および予想、出来高、株価などの中から株価の動きに影響の高い要素を抽出し、勝率および株価上昇率の最大化を目指す AI を搭載しております。

※騰落率: 買いもしくは売りサインが出た翌営業日の始値を基点として、買いもしくは売り手仕舞いサインが出た翌営業日の始値で各銘柄の騰落率を計算し、それらの累計を銘柄数で除して計算しています。

2017年2月以降においては SNS や掲示板、アナリストレポート、政府および金融当局の発表文などテキストデータの解析にも注力していく方針です。

なお、フィスコは 1995 年の創立以来、一貫して中立・公正をモットーとし、株式、為替のほか、商品、先物、オプションといった金融商品全般にわたって、投資家に資する経済情報・企業情報を配信して参りました。その知見を生かし、従来から LaQoo+による個別株価の自動予測システムを提供してまいりました。

現在、マーケットの変化に即応する自動学習型の株価自動予測モデル構築を目指し、新時代に相応しいフィスコ AI 株価自動予測システムを開発しています。この開発にあたっては金融機関でのシステム構築ノウハウが豊富であり、フィンテック分野を今後の戦略的注力領域として位置づけているシステム会社のカイカも参画しております。

従来、株価の調査や株価自動予測システムはアナリストによる地道な作業、単一アルゴリズムによる柔軟性の乏しいシステムが主なものでした。この問題を打開すべく、アナリストの分析の質・量を飛躍的に向上させ、柔軟性の高いアルゴリズムに重点を置いて開発を進めてまいります。また、AI が成長することでアナリストも成長し、それがまた AI の成長を促すような共存共益、かつ相互の成長スパイラルの仕組みの構築も目指します。今回の改訂では株価が上昇もしくは下落しやすい条件の発見、検証、銘柄の絞込みというアナリストの仕事の過程のうち、株価が上昇もしくは下落しやすい条件の発見と検証に使用する時間を節約できることとなります。その分、アナリストは新たな仮説の発見、検証に時間を費やすことができ、それを次回以降の改定に生かしていきます。

フィスコのマーケットに対する着眼点、カイカの 40 年に渡る金融機関のシステム構築経験と数多くのノウハウをベースとした実証実験・システム開発により、日々変化の激しいマーケットに即応可能な自動学習型の株価自動予測システムを構築して参ります。

#### 【株式会社フィスコの概要】

会社名： 株式会社フィスコ <http://www.fisco.co.jp/>  
所在地： 東京都港区南青山五丁目 4 番 30 号  
設立日： 1995 年 5 月 15 日  
資本金： 1,242 百万円(2016 年 12 月 31 日現在)  
代表者： 代表取締役社長 狩野 仁志  
事業内容： 金融機関、投資家、上場企業を支援する各種情報サービスの提供

#### 【株式会社カイカの概要】

会社名： 株式会社カイカ <http://www.caica.jp/>  
所在地： 東京都目黒区大橋一丁目 5 番 1 号  
設立日： 1989 年 07 月 14 日  
資本金： 6,391 百万円(2016 年 10 月 31 日現在)  
代表者： 代表取締役社長 牛 雨  
事業内容： 情報サービス事業