



プレス・リリース

2001年6月28日

株式会社フィスコ

相場予測モデル「アトラクター・モデル」導入で

リサーチアンドプライシングテクノロジー株式会社と提携

7月2日よりロイター社、クイック社、ブルームバーグ社の情報端末を通して
同モデルの予想結果の配信を開始

本件担当

株式会社 フィスコ

藤井英敏: fujii@fisco.co.jp

リサーチ アンド プライシング テクノロジー 株式会社

倉都康行: ykuratsu@rpotech.co.jp

株式会社フィスコ(代表取締役 三木茂)は、リサーチアンドプライシングテクノロジー株式会社(代表取締役 倉都康行)と、カオス理論をもとにした「市場予測モデル」の構築と利用に関し業務提携致しました。

株式会社フィスコ(以下、フィスコ)は、従来の「過去から現在」の金融市場情報に加え、例えば、「天気予報」のような「将来」の市場予測情報を、理論的なモデルに基づき今後投資家に情報提供して行きます。このためには科学的根拠に立脚した信頼度の高い「モデル」を構築する必要があり、今般、この分野でのノウハウのあるリサーチアンドプライシングテクノロジー株式会社(以下、アール・ピー・テック)と提携することとなりました。

フィスコは、当初6ヶ月間、電子専用端末(ロイター、ブルームバーグ、クイック等)を通じて同社顧客向けに予測値を追加料金なしにて配信し、当該モデルの信頼性を検証して行きます。なお、今回導入するカオス予測モデルの名称を「アトラクター・モデル」としました。

■ 「アトラクター・モデル」の説明

「アトラクター・モデル」は、「カオス」の理論に立脚したもので、このモデルは、午前9時のマーケットの寄り値から同日の前場の引け値を予測、また、前場の引け値から同日の終値を予測しようとするものです。さらに、引け値から翌日の寄り値および引け値を予測することも試みます。

■ 表示画面イメージ

アトラクター・モデルは、全部で 16 タイプありますが、画面上では、その中でパフォーマンスの高いタイプの「予測値」を、朝昼夕 1 回ずつ毎日 3 回発信します。

朝は、午前 9:20 頃、前場引け値を予想。昼は、12 時 40 分ごろ大引けの予想を、そして、夕方は 5 時ごろ明日の大引け予想を配信いたします。

アトラクター・モデルによる予測値

<当日の予測>

対象日	タイプ名	寄付き	前引予測	前引	後場寄付	大引予測	大引け	累積判定率	累積収益率
-----	------	-----	------	----	------	------	-----	-------	-------

<2001/6/X>

実測値	12,884		12,883
-----	--------	--	--------

	12,824		12,826	
--	--------	--	--------	--

Athena <1>		12,862	
Iris <2>		12,920	
Helios <4>		12,816	
Triton <2>		12,819	

	12,768		55.56%	98.95%
	12,759		33.33%	-30.84%
	12,767		55.56%	-16.70%
	12,832		44.44%	-117.45%

<翌日(X+1日)の予測>

実測値			
-----	--	--	--

		12,847	
--	--	--------	--

Athena <1>			
Iris <3>			
Helios <4>			
Triton <1>			

	12807		100.00%	141.50%
	12861		50.00%	0.40%
	12837		100.00%	141.50%
	12739		75.00%	22.30%

Copyright 2001 FISCO Ltd. / R.P. Tech Inc

累積は6月13日より

アトラクター・モデルの 16 タイプ

Athena <1>, <2>, <3>, <4>

Iris <1>, <2>, <3>, <4>

Helios <1>, <2>, <3>, <4>

Triton <1>, <2>, <3>, <4>