

各 位

2018年10月31日

株式会社アイズファクトリー
エピック・パートナーズ・インベストメンツ株式会社

次世代 AI 株式売買の実証実験開始

国内初のアンサンブル学習を用いた AI 株価騰落予想システム構築

株式会社アイズファクトリー（本社：東京都千代田区、代表取締役：大場智康、以下、アイズファクトリー）は、独立系ヘッジファンドである、エピック・パートナーズ・インベストメンツ株式会社（本社：東京都千代田区、代表取締役：武英松、以下エピック）と、AIによる次世代株式売買の実証実験を共同で行うことで合意いたしました。アンサンブル学習の手法を用いた株価騰落予想システムの構築は国内初（※注）の取り組みです。

アイズファクトリーとエピックの両社は、これまでも株式売買における騰落データの解析を行い、AIによる予測モデルの構築をしてきた結果、解析上は一定の成果が出せるモデルの構築にいたりしました。今回は、この解析結果をうけて、日本株を対象とした株式売買の実証実験を開始いたします。今後数ヶ月をかけて、アイズファクトリーが構築した実証用の株価騰落予測モデルが算出する騰落予測をもとにエピックのトレーダーが売買を行うことで、予測モデルの精度を更に高めるとともに、実運用における面での検証も行います。

独自のAIプラットフォーム『bodais』で実現するアンサンブル学習

実証実験は、独自のAIプラットフォーム『bodais（ボダイス）』で実施します。bodaisは、アイズファクトリーが開発した自動進化型データ解析クラウドサービスです。一般に、大量のデータを解析するには、データクレンジングなどの多くの前処理が必要となりますが、bodaisは、アイズファクトリー独自のノウハウを搭載することで前処理にかかる時間を大幅に短縮可能なため、データ解析に不慣れな方でも比較的簡単に希望の解析を行います。今回のエピックとの取り組みでは、アンサンブル学習と一般に呼ばれる解析手法をベースに予測モデルを構築しています。具体的には、膨大な数の仮想トレーダーをbodais上に構築し、これら複数のモデルを融合して株価騰落に関する1つの予測モデルを構築しています。アンサンブル学習を採用する趣旨は、未学習のデータに対する予測精度の向上を図るためです。このたび実証実験を行うために構築した予測モデルでは、株価騰落に関連すると思われる膨大な変数（海外指標、為替データ、財務指標、日本株の過去の騰落データなど）のうち、約1000個の変数を用いています。これら大量のデータを扱う際に、bodais上に実装されている変数選択の機能と、独自の大規模分散処理技術とにより、アンサンブル学習による株価騰落のモデルを実証可能なレベルで実装しています。

自動進化型解析プラットフォーム bodais についてはこちらもご参照ください <https://bodais.com/#about>
本件にかかる技術は国際特許出願中です。

※注：当社調べ、2018年9月現在

エピック・パートナーズ・インベストメンツ株式会社について

従来証券会社の自己売買部門を中心に行われてきた投資手法である株式ロング・ショート運用を、投資顧問業として日本国内に広く一般に提供することを目的として、2005年4月に設立。日系・外資系大手証券会社の自己勘定運用部門出身者を中心に投資助言、ファンド運用を開始。以来、マーケット・ニュートラル専門業者として、優れたリスク調整後リターンを積み上げ、卓越した運用ファンド・運用業者に与えられる様々な国際的な賞を受賞、今日に至る。

投資運用業、投資助言・代理業の登録業者（関東財務局長（金商）第432号）、また一般社団法人日本投資顧問業協会加盟業者で、2018年9月末現在役職員17名、うちファンド・マネージャー9名在籍。また、個人富裕層、機関投資家、外国人投資家を含む幅広い顧客層を有しており、4つのオフショア・ファンド商品と複数のマネージド・アカウントを運用中。いずれも、リスクを抑えたマーケット・ニュートラルの手法で運用している。

Web サイト <https://www.epic-partners.jp/>

株式会社アイズファクトリー (i's FACTORY) について

2000年4月、理学博士が中心となり設立。人が人としてより良く生きるために『人間味あふれる AI - Humanizing AI -』を構築提供する技術専門家集団。大手企業と共同研究開発した世界初となる解析エンジンも含めて300以上のデータ解析プロジェクトで構築されたオリジナルな解析エンジン・ツール群を有する。さまざまな AI サービスアプリを簡単に構築できる、自動進化型 AI プラットフォーム「bodais」をリリース。高度な専門知識が必要とされるデータ解析の門戸を広げ、多くの企業に利用されている。近年は AI エンジン共同研究開発・AI サービス共同提供に加え、各企業への AI 研修、AI 人材オンサイト支援、働き方改革支援を始め、AI を利活用して、企業の人手不足やノウハウの継承といった多くの企業が抱える課題を多面的にサポートしている。

Web サイト <https://bodais.com/company/>

以上

【本件に関するお問い合わせ先】
株式会社アイズファクトリー 中井
Email: mrk@isfactory.co.jp