

平成 29 年 7 月 20 日

各 位

大和証券株式会社
株式会社大和総研人工知能(AI)による株価予測モデルを用いた選定銘柄の
株価パフォーマンス報告について

株式会社大和総研（以下「大和総研」）が開発した人工知能（AI）による株価予測モデルを用いて選定した銘柄のパフォーマンスについて、平均騰落率が TOPIX を上回る結果となりましたのでご報告いたします。

銘柄の選定については、大和総研にて先進的な機械学習手法を用いて国内上場企業における決算データなどを解析し、独自に開発した AI による株価予測モデルを用いて、本決算発表後の 1 ヶ月間（20 営業日）に上昇する可能性が高い 20 銘柄を選定いたしました。

なお、大和証券株式会社（以下「大和証券」）では、平成 29 年 5 月 12 日よりお客さま向けに当該銘柄情報を提供いたしております（※）。

■ 株価パフォーマンス結果

AI 選定銘柄をご紹介した日の終値を起点に、ご紹介した日から数えて 20 営業日目の終値までの期間でパフォーマンスを測定したところ、全 20 銘柄中 16 銘柄が TOPIX をアウトパフォームし、全 20 銘柄の平均騰落率は TOPIX 比で 5.42% 上回る結果となりました。

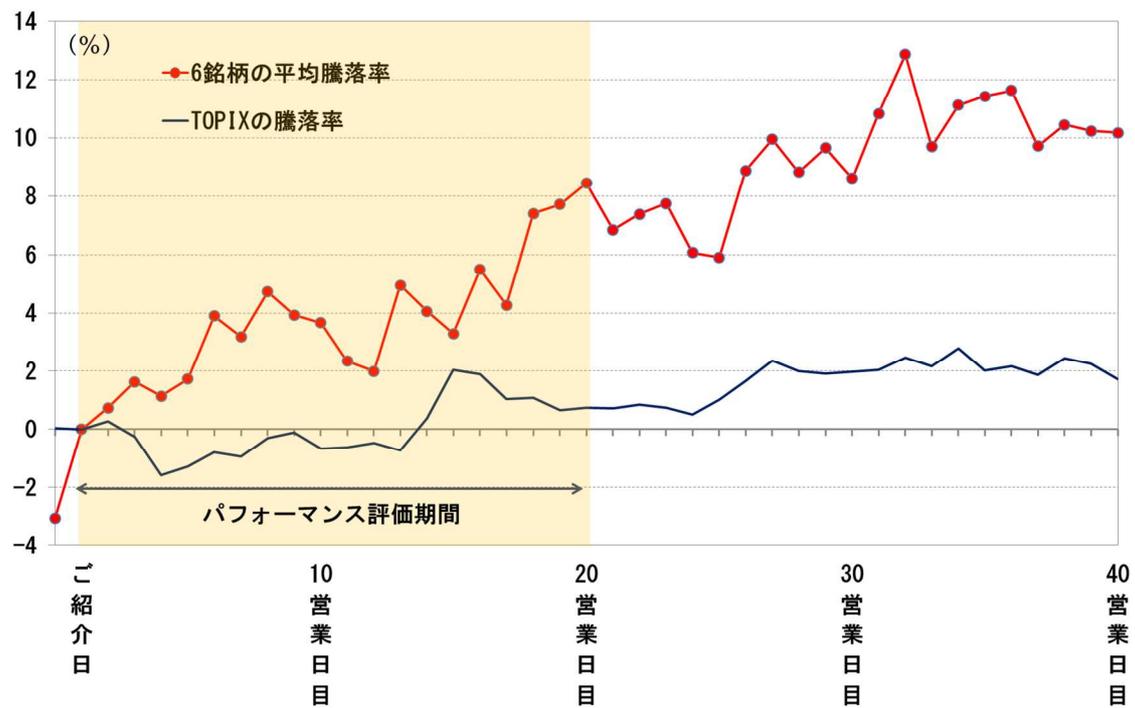
< 5 月にご紹介した全 20 銘柄の平均騰落率の推移 >

	10 営業日目	20 営業日目	30 営業日目	40 営業日目	現時点 (7 月 14 日)
平均騰落率(%)	3.64	6.14	8.21	6.04	8.63
TOPIX 比 平均騰落率(%)	4.14	5.42	6.16	3.83	5.77

■ ご紹介日からの株価推移（5 月 15 日に選定した 6 銘柄の例）

5 月 15 日の午前中に AI が選定した 6 銘柄を大和証券のお客様にご紹介しました。この日の終値を起点とした当該 6 銘柄の平均騰落率の推移は以下の通りです。

<5月15日にご紹介した6銘柄の平均騰落率の推移>



大和証券と大和総研は、今後も継続してAIによる株価予測モデルの高度化に努めるとともに、お客様満足度のさらなる向上に向けて、より有益なサービスの提供を目指して取り組みを進めてまいります。

(※) 平成29年5月9日付ニュースリリース

「人工知能 (AI) による株価予測モデルを用いた銘柄情報の提供について」

http://www.daiwa-grp.jp/data/attach/2193_56_20170509a.pdf

以 上