

平成 29 年 11 月 2 日

各 位

大和証券株式会社
株式会社 Cogent Labs

人工知能（AI）によるリアルタイム株式出来高予測モデルについて

大和証券株式会社（以下「大和証券」）と株式会社 Cogent Labs（以下「Cogent Labs」）は、人工知能（AI）を利用したリアルタイムの株式出来高予測モデルを開発しました。

近年、人工知能（AI）技術である機械学習は、技術的進展や学術的評価の高まりから、ビジネスへの適用が盛んに進められています。大和証券では、その研究と応用に向けた取り組みを推進しています。この取り組みの一環として、大和証券と Cogent Labs は、株式出来高データなどを機械学習によって解析し、独自の株式出来高予測モデルを開発しました。この予測モデルは、最新のディープラーニングを取り入れることで、取引日中における出来高変化をより高い精度で予測することを目指したものです。過去データによるシミュレーションでは、予測精度がベンチマークに比べて 8 割近い銘柄で改善、最大 39%改善する結果が示されています（※1）。

機関投資家の大口注文の執行において、精度の高い市場の出来高予測を踏まえた執行スケジュールを組むことにより安定した執行成績が期待できることから、大和証券では、AI によるリアルタイム出来高予測モデルを搭載したアルゴリズムトレーディングサービスを、来年度上期中に機関投資家のお客様に提供する予定です。大和証券は、先進の AI 技術を活用しお客様のさらなる執行成績の向上に資するサービスの提供に努めてまいります。

（※1）このシミュレーション結果は過去の実績に基づくものであり、将来の成果を示唆あるいは保証するものではありません。平均では 7-10%の改善。

Cogent Labs 概要

会社名： 株式会社 Cogent Labs

代 表： 飯沼 純 / エリック ホワイトウェイ

所在地： 東京都渋谷区代官山町 20-23 TENOHA LAB

U R L : <https://cogent.co.jp/>

事 業：最先端の人工知能の研究・開発と関連ソリューションサービスの提供

コージェントラボは、人工知能を活用して人々の働き方や生活の未来を形作ることに取り組み、実生活の課題を解決する、使いやすく直感的なソリューションを提供します。時系列データを活用した予測、情報抽出、自然言語と音声処理、強化学習など、多分野にまたがる専門性を活用することで、最新の研究内容を実ビジネスに応用します。

以 上