



データセクション、ファイブスター投信投資顧問は

ビッグデータ株価予測システムを共同開発

～日本初となるビッグデータを活用したファンド運用を8月20日より開始～

データセクション株式会社（本社：東京都渋谷区、代表取締役社長 CEO：澤 博史、以下データセクション）は、ファイブスター投信投資顧問株式会社（本社：東京都中央区、代表取締役社長：篠原直人、以下ファイブスター）とビッグデータを活用した株価予測システムを共同で開発いたしました。このシステムを基にファイブスターでは、日本株公募ファンド「FS・DS ビッグデータ活用型ロングショートファンド（仮称、以下ビッグデータファンド）」を7月22日に募集開始し、8月20日より運用を開始いたします。

当ファンドは Twitter・Blog などのソーシャルデータや、為替レート・日経平均など各種経済指標等、様々なビッグデータの分析によって近未来を予測し、その結果に基づいて実際のファンド運営を行う、日本で初めてとなるビッグデータファンドとなります。

【1】背景

IT 技術の進歩により、スマートデバイス・ソーシャルメディアが普及した結果、膨大かつ多様なデータ群（ビッグデータ）の分析が可能になりました。多くの行政機関・民間企業などは、新たな産業モデルの構築や、利便性の向上を目的にこうしたビッグデータ分析・活用を行っています。

特に、金融領域ではビッグデータによる“株銘柄の近未来予測”について、大きな可能性が見込まれ、期待が集まっています。すでに海外では、ビッグデータを応用したソフトウェアを開発し金融ビジネスに活用するなど、ビッグデータによる近未来予測への取組みを開始しています。

データセクションでは、ビッグデータの元来の価値は近未来予測にあると考え、近未来予想技術の研究開発を行ってまいりましたが、このデータセクションが既存事業で培ってきたビッグデータを基にした近未来予想技術と、ファイブスターの機関投資家としての豊富な経験により共同で「株価予測システム」を開発いたしました。

【2】株価予測システムについて

今回構築する「株価予測システム」では、データセクションが既存事業で培ったビッグデータ解析技術・知見と、投資運用に実績があるファイブスターの運用ノウハウを融合する

ことで、株価変動に最適化した予測システムを構築いたしました。

「株価予測システム」は、Twitter・為替・各種マクロ指標等の広範なビッグデータと、各銘柄の株価変動の相関性、因果性を統計的に解析するシステムであります。このシステムにより各銘柄の「最適な投資タイミング」を「迅速」に探知することが可能になります。

【3】ビッグデータファンドについて

今回のビッグデータファンドにおいて、ファンドマネージャーは「株価予測システム」を通じた分析結果を中心に、マクロ分析・個別企業分析を基礎としたファンダメンタル分析結果を有機的に加味させた上で、過去の日本株ファンドでは前例がないと思われる先進的・複合的・機動的なポートフォリオの構築を目指します。

具体的には、日本株（日本の金融商品取引所上場株式）を投資対象とし、運用戦略は株式の「買い」と「空売り」を組み合わせた「ロングショート運用」を行います。これにより、日本株全体の株価の上昇・下落の如何を問わず、絶対リターンを追求してまいります。また、ビッグデータによる近未来予測により、“リスク”となりうる株価の上げ下げを事前に予測し、最適なポートフォリオの構築、投資機会の最適化を目指します。

【4】ファンドマネージャーのご紹介

ファンド運用は、ファイブスターのファンドマネージャーである大木昌光が担当いたします。大木は、外資系証券会社でのセルサイドアナリスト（銀行・ノンバンク担当）としての11年以上の経験を経た後にファンドマネージャーに転じ、日本株ロング・ショート戦略運用者として約5年の運用経験を有します。その間、暦年ベース・年度ベースのいずれにおいても全てプラスリターンを打ち出し、昨年4月から今年3月の1年間でのリターン（20%の成功報酬控除後）も+20.7%と、同期間のEurekahedge Japan L/S Index（同戦略採用ファンドの平均）の+8.5%を大きく上回っております。昨年11月27日からは、ロングオンリーの日本株公募ファンドである「MASAMITSU 日本株戦略ファンド」の主担当も務め、設定来収益率は4月末現在で+16.3%と、参照指数のTOPIXの+14.3%を上回っております。

【5】今後の展開

将来的には、「株価予測システム」を随時改良していくことで、投資対象の拡大・分析精度の精緻化などを目指します。

ーデータセクション

今回の株価予測システムに限らず、一般企業においても近未来予測技術を活用することで、社会の需要予測を行い、物流の最適化、製品仕入れの最適化、製造量コントロール等が行えることを目指していきます。

ーファイブスター

投資家の大切な資産を 1 円でも多く増やすことに貢献すべく、今後も多くの人に求められる新しい運用商品を出し続けていきます。今回のビッグデータファンドは、その重要な一歩となるものと確信しております。

【6】 組織紹介

データセクション株式会社（東京証券取引所マザーズ市場：証券コード 3905）

本社所在地：東京都渋谷区渋谷 2-17-2 太陽生命渋谷ビル 7 階

代表者：代表取締役社長 CEO 澤 博史

設立：2000 年 7 月

資本金：407,045 千円（2015 年 3 月 31 日現在）

事業内容：SaaS サービス事業/リサーチコンサルティング事業/ソリューションサービス事業

URL：<http://www.datasection.co.jp/>

ファイブスター投信投資顧問株式会社

本社所在地：東京都中央区入船 1-2-9 八丁堀 MF ビル 8 階

代表者：代表取締役社長 篠原 直人

設立：2009 年 4 月

資本金：211,750 千円

事業内容：投資運用業/投資助言・代理業

URL：<http://www.fivestar-am.co.jp/>

【7】 本リリースに関するお問い合わせ先

データセクション株式会社 広報担当

TEL：03-6427-2565（代表）

E-mail：info@datasection.co.jp

ファイブスター投信投資顧問株式会社

TEL：03-3553-8711（お客様相談窓口）

E-mail：info@fivestar-am.co.jp

【8】 本リリースについて

プレスリリースに掲載されている、サービス内容、価格、その他の情報は、発表日現在の情報です。その後、様々な要因により予告なしに変更となる場合があります。あらかじめご了承ください。