プレスリリース

2017 年 2 月 14 日
データセクション株式会社

MASAMITSU データセクション・ビッグデータ・ファンド、
ロング・ショート戦略の国内著名ファンドで年間成績がトップクラスとなる実績を実現
～ファンド運用は人から人工知能の時代へ～

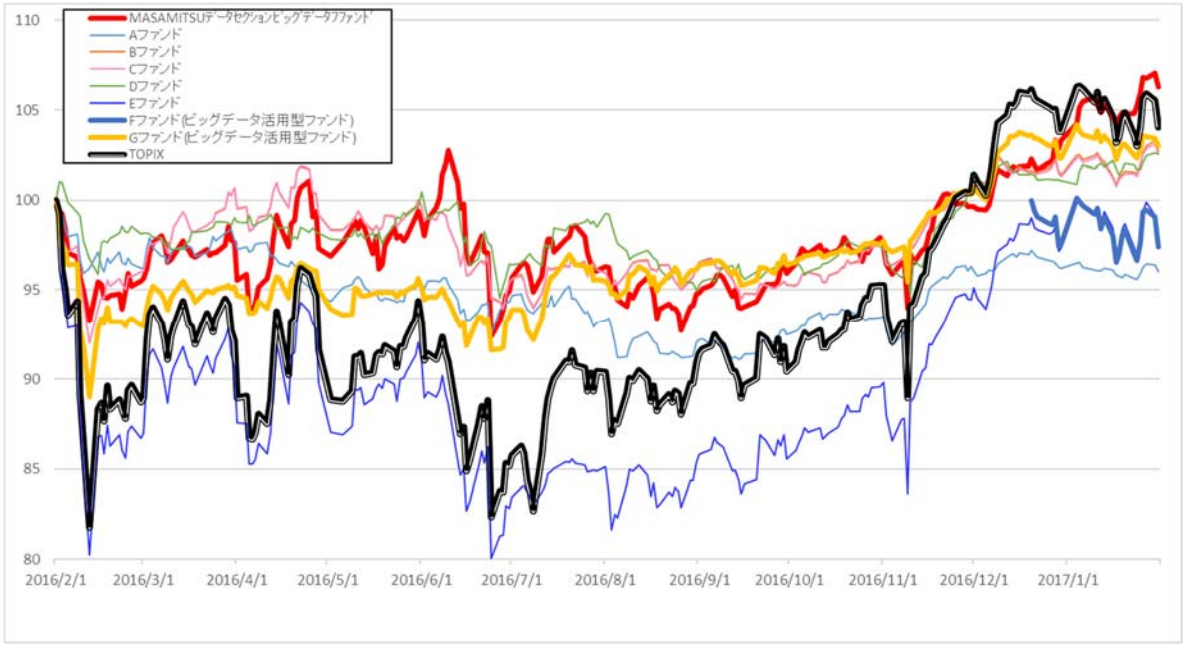
データセクション株式会社（所在地：東京都渋谷区、代表取締役社長 CEO 澤 博史、以下「データセクション」）と、ファイブスター投信投資顧問会社（本社：東京都中央区、代表取締役社長：篠原 直人、以下ファイブスター投信投資顧問）は 2015 年 8 月より運用を開始した「ビッグデータ」に基づく株価予想システム、「MASAMITSU データセクション・ビッグデータ・ファンド」が、2016 年 2 月から 2017 年 1 月の期間においての年間の運用成績が国内株式のロング・ショート戦略を持つ国内の著名ファンド※の中でトップクラスの実績を実現しました。中でも、2016 年 12 月以降は TOPIX 指数を上回る成績となりましたことをお知らせいたします。当ファンドは、為替レート、日経平均などの各種経済指標やソーシャルデータの分析によって近未来を予測する、ロング・ショート戦略のビッグデータファンドです。ディープラーニングを用いた新しい技術を組み合わせ、継続的な運用モデルの改善を行うことにより、安定した高い運用パフォーマンスを実現することが可能となりました。

※日本株式に投資し、戦略を開示している公募投信で、純資産残高が 5 億円以上のもの（出典：Bloomberg）

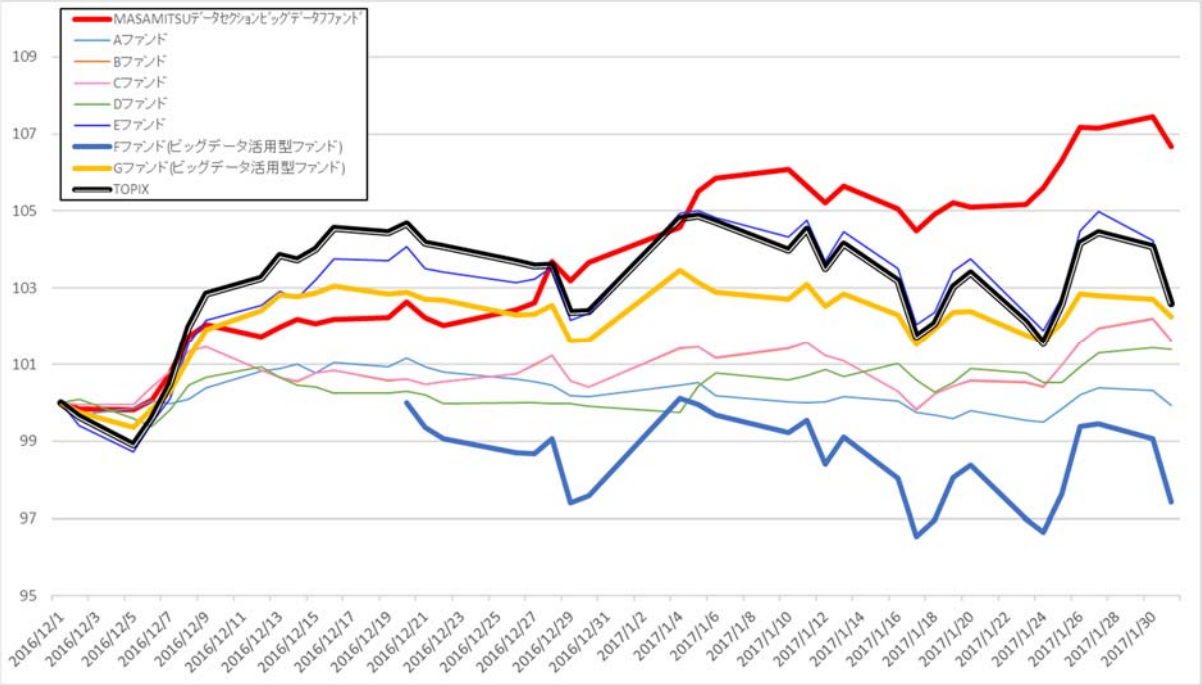
【１】運用成績について

日本株式を扱う著名なロング・ショート戦略ファンドの運用実績の比較は次の通りです。(太線はビッグデータ活用型ファンド)

① 2016 年 2 月 1 日～2017 年 1 月 31 日



②2016 年 12 月 1 日～2017 年 1 月 31 日



※縦軸：各期間最初の日を 100 としたときのリターンの騰落率

【２】当ファンドの株価予測システムについて

当ファンドに提供しているシステムは「マクロデータに基づくシステム」と「ソーシャルデータに基づくシステム」の２つから構成されており、当ファンド設定以後も、継続して両システムの改良に取り組んで参りました。

「マクロデータに基づくシステム」については、為替レートや金利、石油価格、海外株価指標等のマクロデータを元に各銘柄の株価を予測するものです。当初はマクロデータの変化と各銘柄の値動きの相関を統計的に算出を行い、短期的な株価変動を予測しておりましたが、現在は弊社のディープラーニング技術を活用し、過去の様々なマクロデータや株価データを学習させ、膨大なデータの中から、各銘柄ごとの中長期的な株価上昇（下落）の予兆パターンを検知することにより、より精度の高い予測を行うことが可能となりました。

ソーシャルデータに基づくシステムについても、Twitter や掲示板などのソーシャメディア上のデータ解析手法の改善を継続的に取り組んでおり、注目され始めているニュースや関連する投資テーマ、及び注目度が高まっている銘柄を早期に検知を行うことで精度の高い予測を行うことが可能となっております。

また両システムとも、現状は発展途上であり、継続的にシステムを改良し、ファンドマネージャを超えるリターンの創出を目指して参ります。

【3】募集について

当ファンドへの申し込みにつきましては、下記サイトの各販売会社へお問い合わせください。

http://www.fivestar-am.co.jp/hansoku4.html

【4】ファンドのリスクおよび留意点

・投資者の皆様の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金と異なります。 ファンドは、主に国内株式を実質的な投資対

象としますので、株式の価格の下落や、株式の発行体の財務状況や業績悪化等の影響により、基準価額が下落し、損失を被る場合があります。
・取得のお申込みの際は、販売会社から投資信託説明書（交付目論見書）をあらかじめまたは同時にお渡ししますので、必ず内容をご確認の上、投資に関してはご自身でご判断ください。また、あらかじめ交付される契約締結前交付書面などの内容もご確認ください。

【5】収益分配金に関する留意点

・分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、 基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。
・分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
・分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益、②経費控除後の評価益を含む売買益、③分配準備積立金、④収益調整金です。

【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）
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：515,530 千円（2016 年 12 月 31 日現在）
事業内容：消費者マーケティング事業/風評リスク対策事業/画像解析事業/ソリューション開発事業/海外 SNS 分析事業
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：211.75 百万円
事業内容：投資運用業/投資助言・代理業
URL：http://www.fivestar-am.co.jp/

■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

■本リリースについて

本プレスリリースは、ファンドの商品性格および運用状況等についてお伝えすることを目的として、作成したものです。 特定の商品の勧誘や売買の推奨等を目的としたものではありません。 また、本プレスリリースは信頼できると考えられる情報に基づいて作成しておりますが、情報の正確性、完全性を保障するものではありません。 本プレスリリースに記載している各事項は、現時点または過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆または保証するものではありません。本プレスリリースの記載内容、数値等については、作成時点のものであり事前の連絡なしに変更されることがあります。