平成 30 年 3 月 26 日

報道関係者各位

株式会社アイフィスジャパン

AI 技術によるアナリスト・レポート分析の実証研究結果の公表 について

～研究成果の応用により、市場平均を上回るリターンの獲得が判明～

金融情報サービスを提供する株式会社アイフィスジャパン（本社：東京都千代田区 代表取締役：大沢和春、以下「アイフィスジャパン」）は、資産運用分野における AI 技術の応用可能性を探るため、成蹊大学理工学部 酒井浩之 准教授、東京大学大学院 工学系研究科 システム創成学専攻 坂地泰紀 助教と共同で、自然言語分析と AI によるアナリスト・レポートの実証分析を実施し、その成果を第 20 回 人工知能学会 金融情報学研究会にて発表しましたので公表します。

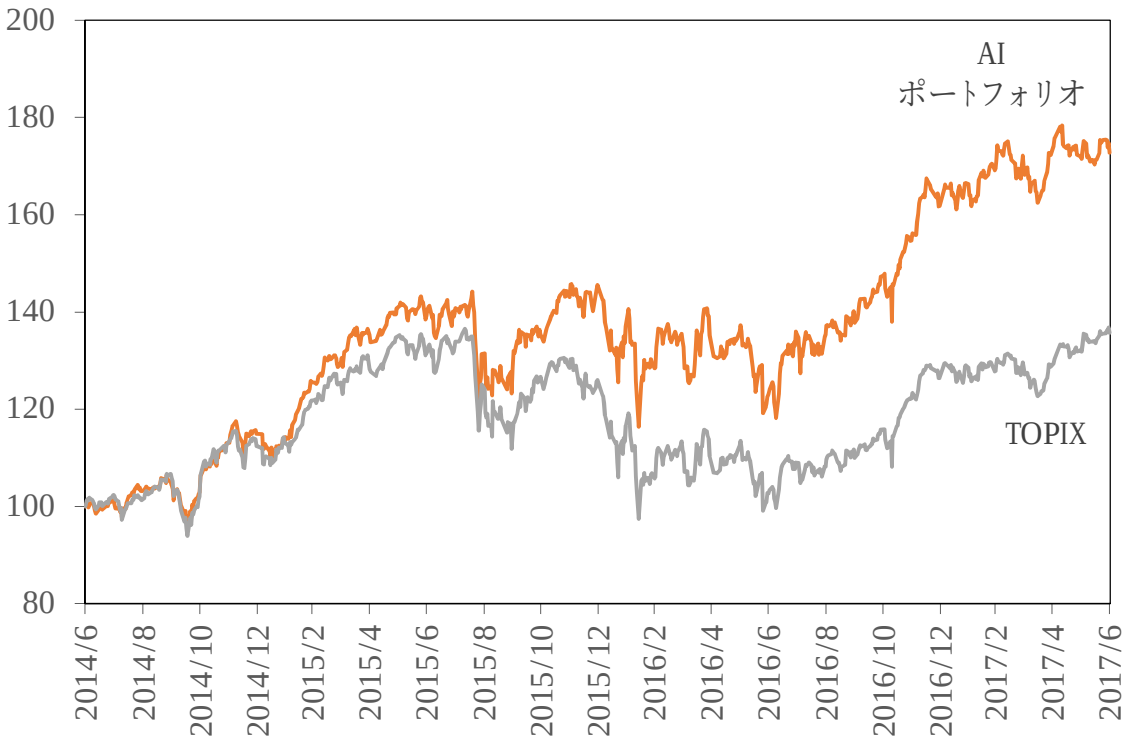
近年、インターネット上のニュースや SNS（ソーシャル・ネットワーキング・サービス）、また新聞記事、企業の開示情報などに含まれるテキスト情報を AI 技術やテキストマイニングにより解析し、その結果を投資先選定に活用する動きが広まってきています。

アイフィスジャパンでは、これまでも酒井准教授、坂地助教と共同で、AI 技術によりアナリスト・レポートから重要情報を抜き出す手法や、アナリスト・レポートの内容をもとにポジティブ／ネガティブに分類する技術等を開発してきました。

今回、これらの研究成果の資産運用分野での応用可能性を探るため、発行されたアナリスト・レポートをポジティブ／ネガティブに分類し、その後の株式リターンとの関連性を検証したところ、市場平均を上回るリターンを獲得できる可能性があることが判明しました。本成果は、2018 年 3 月 20 日開催の人工知能学会 金融情報学研究会にて発表されております。

アイフィスジャパンでは、本研究成果により得られた知見を活用し、お客様向けのサービスに順次実装することで高い付加価値を提供してまいります。また、引き続き大学など外部との共同研究を進め、資産運用業界の更なる拡大と発展に貢献してまいります。

AI により分類された銘柄によるポートフォリオのパフォーマンス



「AI ポートフォリオ」は、AI により発行されたアナリスト・レポートごとにポジティブ／ネガティブを判定し、その分類によるパフォーマンス特性を反映する形でポートフォリオを構成したものです。そのパフォーマンスは、平均騰落率が TOPIX を上回る結果を示しております。

◆　株式会社アイフィスジャパンについて

上場市場：東京証券取引所　第一部（証券コード：7833）
代表者：代表取締役　大沢和春
所在地：東京都千代田西神田３-１-６　日本弘道会ビル
設立：平成７年５月
資本金：３億８,２５１万円（平成２９年１２月３１日現在）
従業員数：連結１７１名（平成２９年１２月３１日現在）
主な事業の内容：金融情報サービス
・証券調査レポートの電子配信サービス
・企業業績予想およびコンセンサスデータの提供サービス
・金融・財務関連ドキュメントの制作およびプリンティングサービス
・金融機関向けシステムインテグレーションサービス
ホームページ：http://www.ifis.co.jp/

【本件に関するお問い合わせ先】
株式会社アイフィスジャパン　経営管理グループ
IR 担当　　大澤　　TEL 03－5275－6334