

人工知能(AI)によるリアルタイム株式出来高予測モデルを

大和証券と開発

予測精度がベンチマークに比べて最大 39%、平均 7-10%の改善 (※1)

株式会社 Cogent Labs (本社：東京都渋谷区、代表取締役：飯沼純、エリックホワイトウェイ、以下「コージェントラボ」) と大和証券株式会社 (以下「大和証券」) 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。

コージェントラボと大和証券は、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。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。コージェントラボでは、CEO エリックホワイトウェイほか金融市場に従事し詳細に仕組みを知るメンバーと、最先端のAIを熟知した専門家が、最新の分析手法や予測手法を取り入れて設計開発を行いました。今回のAIを利用したアルゴリズムトレーディングサービスについてコージェントラボと大和証券は、独占的なライセンス契約を締結しました。

コージェントラボは今後も、今までの予測手法では得られない新たな知見に基づき、お客様の金融取引のパフォーマンス向上に役立つAIを活用した実用的なサービスほか、さまざまなソリューションを金融業界に提供してまいります。

※1 このシミュレーション結果は大和証券による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。

■大和証券 Head of Algorithmic Trading David deGraw 様のコメント

2015年にコージェントラボと協働でディープラーニングのアルゴリズム取引への応用に取り組み始め、翌年にPOCを完了させ、今回実装と言うマイルストーンを実現しました。コージェントラボは、金融分野における高い専門性とディープラーニングに関する最先端の技術を兼ね備えた、類い稀な企業だと実感しています。私たちは早い段階から、株価や出来高の非線形的変化を予測することができれば、アルゴリズム取引の執行成績を向上させ、同時に安定させられると理解していました。POCの結果を見て、ディープラーニングを活用すれば、従来の手法よりも優れた結果を得られると確信しました。

■株式会社 Cogent Labs について

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。

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 TENOHALAB

URL：<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