

報道関係各位

2020年2月28日
HEROZ株式会社

「AI 株式ポートフォリオ診断」のパフォーマンスの公開、および追加機能の提供開始について

HEROZ株式会社(代表取締役 CEO:林 隆弘、以下「HEROZ」)が、SMB C日興証券株式会社(代表取締役社長:清水 喜彦、以下「SMB C日興証券」)とともに開発し、2019年3月29日からSMB C日興証券が提供しております「AI 株式ポートフォリオ診断」(以下「本サービス」)について、これまでの診断内容の良好なパフォーマンスを公開いたしますとともに、本サービスの追加機能の提供開始についてお知らせいたします。

【要旨】

- 本サービスで購入をご提案した銘柄群の収益率(時価評価額の変動率)は、売却をご提案した銘柄群の収益率を上回り、日経平均株価と比較しても好成績
- お客さまの多様なニーズに応えるため、本日から追加機能のご提供を開始

【本サービスについて】

本サービスは、ディープラーニング(深層学習)の手法を用いて学習させた株価予測 AI による期待収益性の予測(1か月後)を用いて、現代ポートフォリオ理論に基づき、お客さまに適した銘柄の入れ替え(リバランス)を、購入銘柄と売却銘柄をセットにしてご提案するサービスで、ダイレクトコース※1のお客さまであれば、どなたでも無料でご利用いただけます。株式を保有していないお客さまには、新規にポートフォリオの構築をご提案する機能もございます。

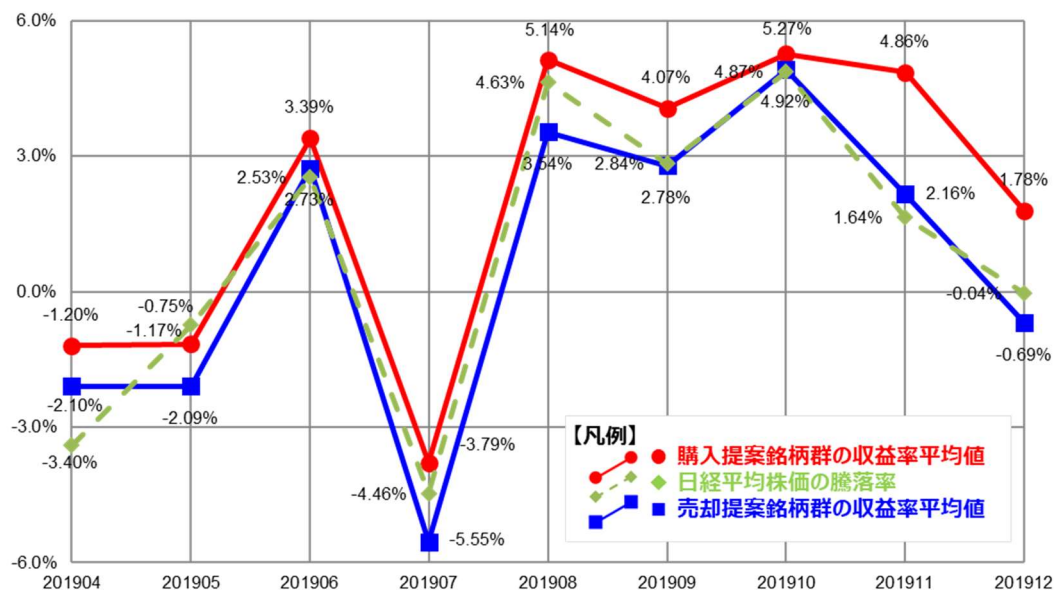
【パフォーマンスの公開について】

本サービスは、サービス開始から非常に多くのお客さまにご利用いただき、ご好評をいただいております。この度、過去のご提案内容について、収益率と収益改善確率(勝率)の両面から分析を行った結果、有意なサービスを提供させていただいていることを改めて確認し、そのパフォーマンスについて公開することにいたしました。

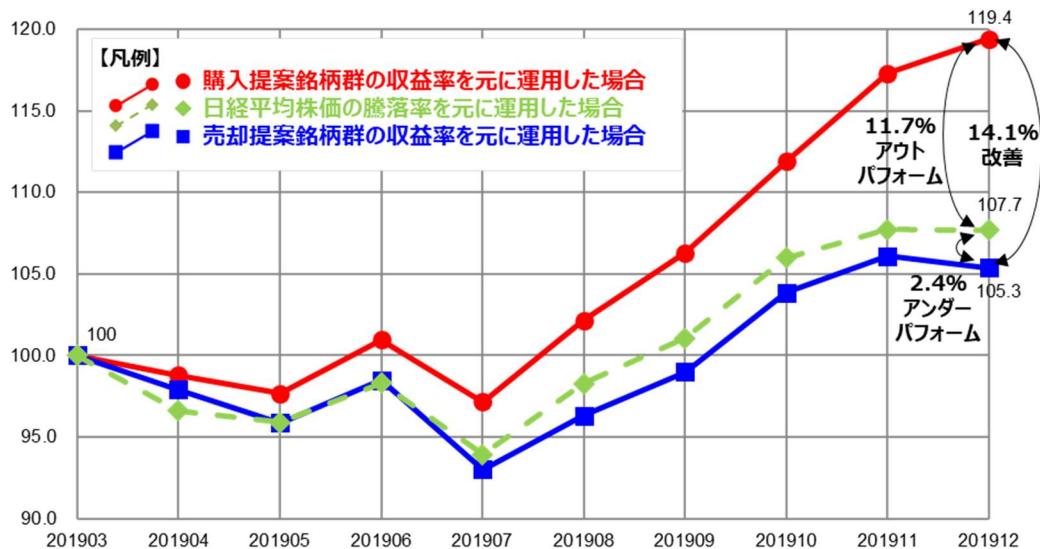
分析① 購入をご提案した銘柄群および売却をご提案した銘柄群の収益性について

購入をご提案した銘柄群および売却をご提案した銘柄群について、ご提案した 1 か月後の収益率を確認いたしました。その結果、購入をご提案した銘柄群の収益率が売却をご提案した銘柄群の収益率を上回っていること、および購入をご提案した銘柄群の収益率が日経平均株価の騰落率を上回っていることが確認できました。両銘柄群の月次の収益率の平均値および日経平均株価の騰落率の推移と、当該収益率で運用を行った場合の運用成績（9 か月間）の推移を以下に示します。

<月次の収益率推移>



<運用成績の推移>



※2019年3月末の資産を100とした場合の運用成績シミュレーション

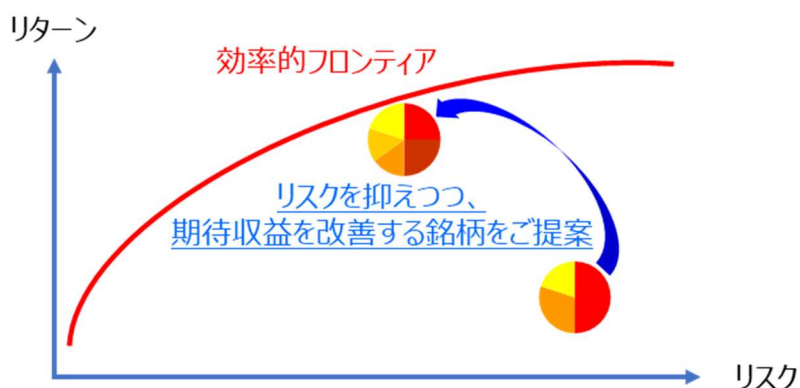
分析② リバランスを実施した場合に収益が改善する確率について

ご提案通りにリバランスを実施していただいた場合、1 か月後に元のポートフォリオよりも収益が改善する確率（勝率）を確認いたしました。通算で 57.8%、2019 年 9 月には 70%以上のご提案について収益の改善が確認できました。



収益率、収益改善確率ともに良好な結果となっておりますが、本サービスの提供価値は単に値上がりが見込める銘柄のご提案をするのみでなく、お客さまのポートフォリオを分析し、リスクを低減しながら収益の獲得が見込める銘柄をご提案し、効率的な資産運用を実現していただくことにあります。ぜひ本サービスをご利用いただき、効果をお確かめください。

＜本サービスのご提案によるポートフォリオの改善イメージ＞



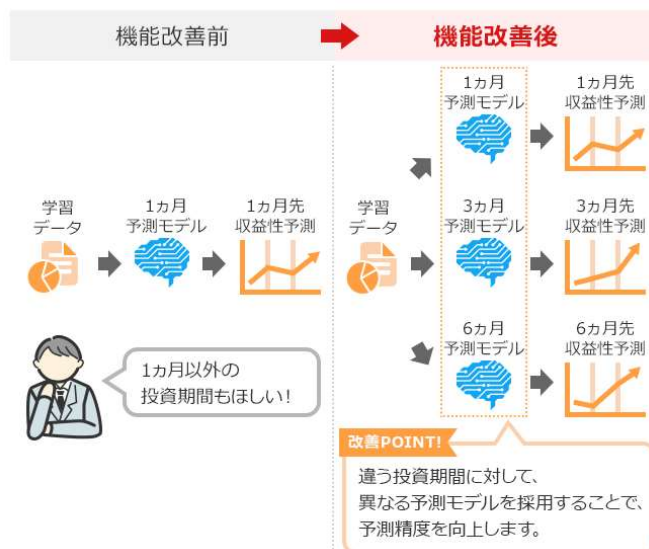
※今回公開した分析結果は、実際にお客さまにご提案した実績を利用し、実際の株価の値動きに基づいて算出したものですが、本サービスにより将来の収益が得られることを保証するものではありません。投資にあたっての最終的なご判断は、お客さまご自身で行っていただきますようお願いいたします。

【追加機能のご提供について】

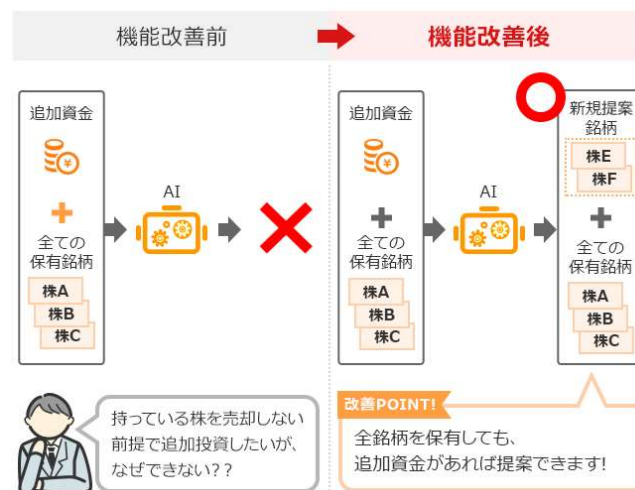
本サービスに対するお客さまの声にお応えし、追加機能のご提供を本日より開始いたします。追加機能の内容は以下のとおりです。

追加機能① ご提案条件の拡大

ご提案を行うための条件に、「投資期間」を追加いたします。これまでは1か月おきに再診断しポートフォリオの見直しを行うことを推奨しておりましたが、今回の機能追加により、より長期での予測を行い、その内容に沿った銘柄のご提案が可能になりました。

追加機能② 購入銘柄のみのご提案

これまで、リバランスのご提案は、購入銘柄と売却銘柄をセットにして行い、売却可能な銘柄がない場合にはご提案を行わない仕様となっておりますが、今回機能を追加したことにより、投資資金の追加がある場合には購入銘柄のみのご提案が可能になりました。



【S M B C 日興証券株式会社について】

S M B C 日興証券では、「お客さま本位のデジタルイゼーション」を実現するための様々な取り組みを実践しており、本サービスも含め、今後も最新技術を活用し幅広いお客さまにご利用いただけるサービスを提供してまいります。

【H E R O Z 株式会社について】

H E R O Z は、「驚きを心に」をコンセプトとして人工知能（AI）等の技術で「世界を驚かすサービスを創出する」ことを目指しています。

今後も独自 AI「HEROZ Kishin」を軸にディープラーニング（深層学習）等の機械学習の研究開発やビジネス活用を続け、人工知能（AI）革命を起こし、未来を創っていきます。

（※1）ダイレクトコースは、情報収集やお取引を主にパソコンやスマートフォンからご自身で行う方向けのコースで、現物株式の委託手数料は最低 137 円、信用取引の委託手数料は 0 円、投資信託は 1,000 本以上取り揃えています。

詳細はこちら → <https://www.smbcnikko.co.jp/service/course/direct/>

（※2）「HEROZ Kishin」は、将棋 AI をはじめ、H E R O Z で培った AI 技術を活かし、これまで人間には解決できなかった問題に挑戦し、新時代を創造する H E R O Z 独自 AI です。

詳細はこちら → <https://heroz.co.jp/service/btob/>

※社名である H E R O Z 及び H E R O Z のロゴマークは、当社の登録商標です。

※その他すべての商標は、各々の所有者の商標または登録商標です。

【本件についてのお問い合わせ】

H E R O Z 株式会社 広報担当

URL : <https://heroz.co.jp/contact/>

Email : press@heroz.co.jp

本プレスリリースは送信専用メールアドレスから送信させていただいております。