



平成 27 年6月4日

各 位

会 社 名 オ リ コ ン 株 式 会 社
 代 表 者 名 代 表 取 締 役 社 長 小 池 恒
 (東証 JASDAQ コード番号 4800)
 問 い 合 わ せ 先 企 業 広 報 部 長 黒 須 栄 誉
 TEL.03-3405-5252(代表)

連結子会社による新事業開始のお知らせ

当社の連結子会社であるオリコン D サイエンス株式会社(関東財務局長(金商)第 2779 号、代表取締役：小池恒、以下「同社」)が、本日、新事業(資産運用業務)を開始しましたので、下記のとおりお知らせいたします。

記

1. 新たな事業の概要

同社が開発した金融工学モデルから算出される、売買シグナルを用いた自社運用(国内上場株式を対象)を本日 6 月 4 日より開始いたしました。

同社では、従前よりビッグデータを活用する取組みとして、日本株式投資の総合的な情報サービスの立ち上げを掲げ、全上場銘柄を対象に過去 10 年間に亘る 200 を超える説明変数(分析要素)を分析し、そこから指標を算出するという金融工学モデルの研究・開発に注力してまいりました。当該モデルの開発は完了しましたが、サービスの提供を開始するにあたっては、実際の株式市場における運用実績(トラックレコード)を蓄積し、さらに信頼性を向上させることを優先すべきとの判断から、当該モデルに基づいて、まずは自社にて運用を行う旨を、平成 27 年5月8日の決算発表時にご報告しておりましたが、本日その準備が整い、業務を開始する運びとなりました。

なお、ベンチマーク数値としている「TOPIX 配当込」を対象に、2013 年から 2014 年の期間にておこなったバックテストの結果は以下のとおりです。

①年率リターン、年率リスクとの比較

	年率リターン		年率リスク	
	当該モデル	TOPIX 配当込	当該モデル	TOPIX 配当込
2013 年	58.5%	47.2%	19.0%	23.9%
2014 年	22.4%	11.7%	9.4%	18.8%
2 年間の平均	40.8%	29.5%	13.8%	21.5%

②ベンチマークとの対比指標

	当該モデル
アクティブリターン (どれだけベンチマークを上回る利益を上げられたか)	5%
アクティブリスク (ベンチマークとの収益率の乖離度合)	13.2%
インフォメーションレシオ(ベンチマークからの超過利益を得るために、どれだけリスクがとられたか)	0.4

2. 今後の見通し

本件に伴う当社の連結業績予想に与える影響は、現在のところ軽微と考えております。業績に与える影響が生じた場合には速やかにお知らせいたします。

(参考) 当期連結業績予想(平成 27 年 5 月 8 日公表)及び前期連結業績

	連結売上高	連結営業利益	連結経常利益	連結当期純利益
当期業績予想 (平成 28 年 3 月期)	4,600 百万円	615 百万円	570 百万円	300 百万円
前期業績 (平成 27 年 3 月期)	4,510 百万円	495 百万円	440 百万円	231 百万円

以上