

2023年7月11日

各位

株式会社 FOLIO ホールディングス

「AI 投資」を推進する FOLIO が、 高度な AI 技術を持つ AlpacaTech 株式会社を連結子会社化へ

株式会社 FOLIO ホールディングス(本社:東京都千代田区、代表取締役 CEO: 甲斐 真一郎、以下「当社」)は、AlpacaTech 株式会社(本社:東京都千代田区、代表取締役 CEO: 四元 盛文、以下「AlpacaTech」)の株式を取得し、当社の連結子会社といたしましたのでお知らせいたします。

今後は当社の子会社である株式会社 FOLIO(以下「FOLIO」)と AlpacaTech の強力な事業シナジーを活かし、より高度な AI 投資サービスを提供してまいります。



×



■本件株式取得について

AlpacaTech は FOLIO にとって、従来より信頼関係を築いてきたビジネスパートナーです。これまでも FOLIO の投資運用ノウハウと AlpacaTech の AI アセットアロケーションシステムを掛け合わせ、「FOLIO ROBO PRO(以下「ROBO PRO」)」等の AI 投資サービスを提供してまいりました。

今回、当社が AlpacaTech を連結子会社化することで強力な事業シナジーを最大化し、AI 投資の拡充・高度化を一層加速していく事が可能となります。さらに事業面でのシナジーの他、異なる専門性を持つ両社のエンジニアの協働による開発力の強化や、新たなマネジメント層の人材が加わることによる経営基盤の強化なども見込んでおります。

尚、当社および FOLIO の代表取締役 CEO は、引き続き甲斐真一郎が務めてまいります。また、AlpacaTech の現代表取締役 CEO の四元氏が当社の経営に参画予定です。

今後も FOLIO と AlpacaTech 両社の強みを活かして、さらなる企業価値の向上を目指してまいります。

■AlpacaTech について

AlpacaTech は、最先端のデータサイエンスを活かした AI による金融市場予測ソリューションを提供しており、高度な AI 技術に加えて、ビッグデータ解析や金融向けデータ・ストレージなどの技術にも強みを持つ AI ソリューション企業です。

世界各国出身のデータサイエンティスト・データエンジニアが、豊富な経験をもとに顧客企業のニーズに合致する予測モデル・ソリューションを提供し、運用を継続していくことで効果的なパフォーマンスを出せる予測モデルの精度向上に努めております。

AlpacaTech

<https://www.alpaca-tech.ai/>



■FOLIO について

FOLIO は、「Keep Innovating The Financial Industry」をミッションとして、AI 投資を推進する企業です。2022 年度はラップ業務にかかる投資一任契約の契約増加件数で第 1 位^{※1}を獲得しました。

FOLIO では、AI による相場予測をもとに運用を行う ROBO PRO を 2020 年 1 月にリリースし、以降 3 年以上に渡って AI 投資のノウハウを蓄積してきました。その結果、ROBO PRO は 2023 年 4 月に金融庁より公表されたロボアドバイザーの過去 3 年の累積パフォーマンスで No.1^{※2}を獲得しました。

また FOLIO は投資一任運用プラットフォーム「4RAP」システムを金融機関向けに提供しています。4RAP を導入した SBI 証券から提供されている「SBI ラップ」^{※3}は、2022 年 3 月のサービス提供開始から約 14 ヶ月で、「SBI ラップ AI 投資コース」^{※4}及び「SBI ラップ×SBI 新生銀行」を合わせた預かり資産が 400 億円を突破しました。

・「AI 投資」を推進する FOLIO が投資一任契約増加件数 2022 年度通期で第 1 位を獲得

<https://prtimes.jp/main/html/rd/p/000000121.000022761.html>

・AI 投資「ROBO PRO」、金融庁が公表したロボアドバイザーの過去 3 年のパフォーマンスで第 1 位を獲得

<https://prtimes.jp/main/html/rd/p/000000119.000022761.html>

※1 一般社団法人日本投資顧問業協会が公表している統計資料「契約資産状況『ラップ業務』」に掲載されている協会会員の「投資運用」契約件数(個人及び法人の合計数)を用いて、2022 年 3 月末時点から 2023 年 3 月末時点までの増加件数を計算したものです(2023 年 6 月 FOLIO 調べ)。FOLIO の契約件数は、SBI ラップおよび FOLIO が提供する投資一任サービスの契約件数の合計値です。

※2 「国内運用会社の運用パフォーマンスを示す代表的な指標(KPI)の測定と国内公募投信についての諸論点に関する分析」の公表について(別添)「2022 年末(4)ファンドラップ関連」(2023 年 4 月 21 日)

<https://www.fsa.go.jp/common/about/research/20230421.html>

・データは 2022 年末時点。対象は主な投資一任型ロボアドバイザー 5 社。

・各社がサイトで公開している「コスト控除後・円建て」の月次データを基に計測。各社公開データは、2017 年 8 月にロボアドバイザー提供会社が行った「情報開示の更なる向上に関する共同宣言」に基づき開示されている。

・ROBO PRO はサービス開始が 2020 年 1 月 15 日のため、計測期間の 3 年は 2020 年 1 月 15 日から 2022 年末までの約 3 年間で計算。

・運用実績は将来の運用成果等を示唆又は保証するものではありません。

※3 「SBI ラップ」は、それぞれ異なる金融商品である「SBI ラップ AI 投資コース」、「SBI ラップ×SBI 新生銀行」、「SBI ラップ 匠の運用コース」の総称です。

※4 SBI ラップ AI 投資コースと ROBO PRO は同じ AI を搭載していますが、異なる運用戦略を用いた別の金融商品です。

■FOLIO の AI 投資の競争力の源泉

① 相場の先読み役に役立つマーケットデータから厳選して、AI が多角的に分析

AIに「何を分析させるのか」によりアウトプットに大きな差が生じると考えられます。FOLIOのAI投資では、相場の先読み役に役立つ40種類以上のマーケットデータから2,000以上の特徴量を算出し、その中からデータを厳選し多角的に分析しています。

② 機械学習により年月の経過に合わせて予測精度の向上が期待できる

AIが相場の変動要因やその傾向を分析し機械学習を行い、予測モデルを自動で継続的に改善します。一般例として、予測を行う際に特定の特徴量を用いていることが精度を下げる要因となっていた場合に、今後はその特徴量を用いないことにする等の学習を行います。この「特徴量選択」が予測精度向上の鍵となります。

③ AI予測だけに頼らず独自の方法で最適ポートフォリオを算出

AIが算出した予測値のみを用いて投資配分を決定するのではなく、伝統的な金融工学理論を用いたうえで、AIが算出した予測値をどれだけ反映させるのか等、FOLIOが独自に設けたアルゴリズムを組み込み、最適と考えられるポートフォリオを算出しています。

FOLIOのAI投資はこれらを競争力の源泉とし、人を凌駕するパフォーマンスを目指します。

■AI投資で資産運用をもっと身近なものに

高齢化社会がより加速している昨今、長期的な視点に立った資産運用の重要性がさらに高まりつつあります。「誰もが当たり前資産運用できる社会」の実現を目指すFOLIOは、弊社のサービスを通じ、また連携している各金融機関を通じてより多くの皆様にAI投資サービスを提供できるよう努めてまいります。

■会社概要

株式会社 FOLIO ホールディングス

本社所在地：東京都千代田区一番町 16-1 共同ビル一番町 4 階

事業内容：グループ会社の経営管理および付帯業務

代表者：代表取締役 CEO 甲斐 真一郎

設立：2019年4月1日

株式会社 FOLIO

本社所在地：東京都千代田区一番町 16-1 共同ビル一番町 4 階

事業内容：第一種金融商品取引業、投資運用業

登録番号等：金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第 2983 号

加入協会：日本証券業協会、一般社団法人日本投資顧問業協会

代表者：代表取締役 CEO 甲斐 真一郎

設立：2015年12月10日

URL：<https://folio-sec.com>

AlpacaTech 株式会社

本社所在地：東京都千代田区内神田 1-13-14



事業内容 : 投資管理ソリューションおよび取引ソリューション開発

代表者 : 代表取締役 CEO 四元 盛文

設立 : 2022 年 7 月 8 日

URL : <https://www.alpaca-tech.ai/>

【FOLIO ROBO PRO のリスクと費用について】

金融商品の取引においては、株価、為替、金利、その他の指標の変動等により損失が生じ、投資元本が割り込むおそれがあります。お客様には、取得有価証券の時価評価額が 3,000 万円以下の部分は年率 1.00% (税込 1.10%)、3,000 万円を超える部分は年率 0.50% (税込 0.55%) の運用報酬料をご負担いただきます。ご契約の際は、契約締結前交付書面又は FOLIO ROBO PRO 投資一任契約書等の内容を十分にご確認ください。

リスク・手数料の詳細はこちら

<https://folio-sec.com/support/terms/transaction-fees>

本プレスリリースに関する報道機関からのお問い合わせ先

株式会社 FOLIO ホールディングス

担当: 逢坂 (sosaka@folio-sec.com)、植澤 (tuesawa@folio-sec.com)