



カブドットコム証券株式会社  
(コード番号：8703 東証1部)  
代表執行役社長 齋藤 正勝

2001年6月7日

「株スコア (kabu.score)」によるポートフォリオ診断を開始

カブドットコム証券株式会社は、個別銘柄を「成長性、割安度、テクニカル、財務健全性、規模、リターン、値動き」などの項目から、全銘柄における相対順位で採点する「株スコア (kabu.score)」を元に、お客様の持ち株を時価評価に基づく残高比率を考慮し100点満点で総合評価する株式ポートフォリオ診断を開始いたします。

この「株スコア (kabu.score)」を使ったポートフォリオ診断では、お客様のカブドットコム証券での各持ち株の採点、および持ち株全体の採点を行います。ポートフォリオ全体の総合評価は、各銘柄の総合評価の採点に、お預かりしている株式の時価に基づく残高比率を考慮し100点満点で評価しますので、資金配分を反映した採点となります。これによって、お客様のポートフォリオ全体の特徴や状況の変化を、投資の初心者からベテランまで難しい分析無しで簡単に把握することができることとなり、投資家層の拡大や投資成果の向上に寄与するものと期待しています。

各項目で使用する指標等は以下の通りです。

成長性	(1)ROE (2)売上高成長率 (3)今期経常利益変化率
割安度	(1)PER (2)PBR (3)75日移動平均からの乖離率
テクニカル	(1)25・75・200日移動平均線からの乖離率 (2)出来高の変化(3)ゴールドンクロス、デッドクロス (4)ローソク足のパターン (5)信用残レシオなど
財務	(1)自己資本比率 (2)自己資本比率の業種内での相対値
規模	(1)時価総額 (2)平均売買代金
リターン	(1)25日移動平均線からの乖離率 (2)75日移動平均線からの乖離率
値動き	(1)60日ボラティリティ (2)ヒストリカル・ベータ

「株スコア (kabu.score)」とは、クオンツ・リサーチ社が算出した銘柄別評価データを元に、個別銘柄を採点するカブドットコム証券のオリジナル情報サービスです。全銘柄における相対順位によって10点満点の採点を「成長性、割安度、テクニカル、財務健全性、規模、リターン、値動き」など各々の項目で行い、その中の「成長性、割安度、テクニカル、財務健全性」によってその銘柄の総合評価を行います。データは営業日ベースで原則1日1回更新され、それに伴い変化があれば「株スコア (kabu.score)」も日々変動することから、株式

投資におけるさまざまな変化をタイムリーに捉える事が可能になります。

カブドットコム証券では今後、この「株スコア (kabu.score)」をポートフォリオ診断に限らず、スクリーニング機能、ランキング、任意に登録した銘柄およびそのトータルでの採点やシミュレーション、スコアの変化などによる通知サービスなどでも使用する予定です。また、より評価制度を高めるために採点項目の追加も検討しております。

#### <クオンツ・リサーチ社とは>

外資系金融機関のクオンツ経験者を中心に、金融のスペシャリストが集まって設立した知識集約型の独立系企業です。クオンツ(市場の数理分析)情報・モデルならびにクオンツ手法を取り入れたコンテンツをウェブを媒体とし提供しています。クオンツ・リサーチ社の銘柄別評価データは、最新の金融工学手法を利用した同社独自のノウハウによって算出されています。