

## 第 25 回 人工知能学会 金融情報学研究会 (SIG-FIN)

<https://sigfin.org/025/>

### == 10月10日 (土) プログラム ==

一般発表 20分(発表 15分 + 質疑 4分 + 予備 1分) (招待講演はございません)

(9:45 ごろから Zoom に入れる予定です。)

10:00~11:00 予測・金融モデル 1 (3件)[座長]酒井浩之(成蹊大学)

(1)Extreme Opinions on Social Media,

三輪宏太郎(九州大学)

(2)携帯電話 GPS データに基づく自動車生産量のナウキャストと株式投資戦略,

水門善之(東京大学, 野村証券), 柳井都古杜(野村証券)

(3)コロナショック環境下における AI トレーダーの投資パフォーマンス,

石原龍太(かんぽ生命保険)

11:15~12:15 人工市場・強化学習 1 (3件)[座長]落合友四郎(大妻女子大学)

(4)強化学習を用いたライフサイクル投資,

上田翼(三井住友 DS アセットマネジメント)

(5)高頻度取引は金融危機時に市場に悪影響を与えるのか? ~人工市場による一考察~,

星野真広, 山本浩平(神奈川工科大学), 水田孝信(スパークスアセットマネジメント), 八木勲(神奈川工科大学)

(6)自発的に市場規模が定まる金融取引モデル,

片平啓(筑波大学), 陳昱(東京大学), 秋山英三(筑波大学)

(12:15-13:30 昼休み)

(お昼休みに Zoom はいったん切断されます。13:15 ごろから再度入れるようになります。)

13:30~14:50 テキストマイニング(4件)[座長]関和広(甲南大学)

(7)タグに基づくデータ拡張と因果文抽出を用いた市況コメント生成の試み,

坂地泰紀(東京大学), 近藤洋平(大和アセットマネジメント), 和泉潔(東京大学),

長尾慎太郎(大和アセットマネジメント), 加藤惇雄(大和総研)

(8)債券市場における金融極性辞書の自動構築,

今井康太, 酒井浩之, 高野海斗(成蹊大学), 北島良三(東京工芸大学), 末廣徹, 稲垣真太郎,

木村柚里(みずほ証券)

(9)有価証券報告書からのリスク文抽出の試み,

藤井元雅(東京理科大学), 坂地泰紀, 佐々木一(東京大学), 増山繁(東京理科大学)

(10)経済データを用いた政府の景気基調判断文の生成とバイアスの検証,

末廣徹, 木村柚里, 稲垣真太郎(みずほ証券)

15:05～16:25 予測・金融モデル 2 (4件)[座長]水田孝信(スパークスアセット)

- (11)解釈性を持つマクロファクター構成手法,  
野間修平, 中川慧, 伊藤彰朗(野村アセットマネジメント)
- (12)評価関数の可視化による株価予測モデルの汎用性評価,  
坂下好希(東京大学), 瀬之口潤輔(東京工科大学)
- (13)t 過程ボラティリティ変動モデル,  
濃野歩(東京大学), 内山祐介(MAZIN), 中川慧(野村アセットマネジメント)
- (14)Adaptive Elastic Dynamic Mode Decomposition を用いたモメンタム戦略の改良,  
内山祐介(MAZIN), 中川慧(野村アセットマネジメント)

16:40～17:40 人工市場・強化学習 2 (3件) [座長]中川慧(野村アセット)

- (15)人工知能は相場操縦という不正な取引を勝手に行うか?-遺伝的アルゴリズムが人工市場シミュレーションで学習する場合,  
水田孝信(スパークスアセットマネジメント)
- (16)多変量時系列データを用いた分散型強化学習による低リスク行動の学習,  
佐藤葉介, 張建偉 (岩手大学)
- (17)Estimation of agent-based models using Bayesian deep learning approach of BayesFlow,  
塩野剛志(クレディ・スイス証券)

---

人工知能学会 金融情報学研究会 (SIG-FIN) の今後の開催予定を知りたい方はメーリングリストが便利です。  
右のサイトにて、どなたでも登録が可能です。 <https://sigfin.org/mailman/listinfo/jsai-fin>  
ホームページでも随時情報を更新しております。 <https://sigfin.org/>