

==プログラム ==

一般発表 20 分(発表 15 分+質疑 5 分)

(招待講演はございません) (午前はシングルセッション, 午後は 2 パラレルセッションです)

(9:30 開場)

10:00~11:20 深層学習・クラスタリング (5 階 5 0 1 教室) (4 件) [座長]水田孝信(スパークス・アセット)

- (1) 自己符号化器を用いた国債イールドカーブのファクターモデルの構築,  
水門善之(東京大学, 野村證券), 坂地泰紀, 和泉潔, 島田尚, 松島裕康(東京大学)
- (2) 外国為替市場におけるポジション管理戦略の クラスタリングに基づく将来価格予測,  
末重拓己(東京工業大学), Didier Sornette(ETH), 高安秀樹(Sony CSL), 高安美佐子(東京工業大学)
- (3) LRP を用いた深層学習株式リターン予測モデルの解釈の試み,  
小寺俊哉, 佐藤史仁(日興リサーチセンター), 坂地泰紀, 和泉潔(東京大学)
- (4) Combining a DSGE Model with Neural Networks for Forecasting Economic Variables,  
塩野剛志(クレディ・スイス証券)

11:20~11:30 表彰式

13:10~14:30 テキストマイニング 1 (5 階 5 0 1 教室) (4 件) [座長]酒井浩之(成蹊大学)

- (5) Supervised LDA モデルによるニューステキストを用いたマクロ経済不確実性指数の構築,  
余野京登, 和泉潔, 坂地泰紀, 島田尚, 松島裕康(東京大学)
- (6) 接触履歴を用いた地方景況感と業種間構造の分析,  
坂地泰紀, 蔵本涼太, 和泉潔, 松島裕康, 島田尚(東京大学), 砂川恵太(沖縄銀行)
- (7) ニュース記事を用いた新しい景気指標の開発と応用,  
関和広(甲南大学), 生田祐介(大阪産業大学), 松林洋一(神戸大学)
- (8) 景気の先行き判断における現在バイアス, Masahiro Kato(東京大学)

13:10~14:30 テクニカル分析 (4 階 4 0 1 教室 : 開場 13:00) (4 件) [座長]落合友四郎(大妻女子大学)

- (9) 時系列モデルを用いたマルチアセット市場における統計的裁定戦略, 今井崇公, 中川慧(野村アセットマネジメント)
- (10) 機械学習によるテクニカル分析の影響の調査, 片寄諒亮, 吉岡真治(北海道大学)
- (11) 機械学習による金融時系列モデルのパラメータ推定, 高石哲弥(広島経済大学)
- (12) 遺伝的プログラミングを用いたテクニカル指標による金融取引の戦略構築, 加藤旺樹, 穴田一(東京都市大学)

14:45~15:45 テキストマイニング 2 (5 階 5 0 1 教室) (3 件) [座長]坂地泰紀(東京大学)

- (13) 新興市場を対象とした市況情報の抽出,  
神田裕輝, 酒井浩之, 北島良三(成蹊大学), 中川慧(野村アセットマネジメント)
- (14) 会社四季報を用いた理論株価の推定 : Kaggle を参考に, 吉川満(大和大学)
- (15) 日銀「主な意見」の発言者分類モデルの作成と政策変更予測への応用,  
末廣徹(みずほ証券, 法政大学), 木村柚里, 稲垣真太郎(みずほ証券)

14:45~15:45 関係分析 (4 階 4 0 1 教室) (3 件) [座長]平松賢士(アイフィスジャパン)

- (16) Relationship between corporate brand and ROE in industrial markets,  
真鍋友則(Sansan), 中川慧(野村アセットマネジメント)

(17) 日本株式市場における daytime と overnight return の間の VC 相関解析,

落合友四郎(大妻女子大学), Jose Nacher(東邦大学)

(18) グラフエンベディングを活用した潜在取引関係予測,

藤塚理史(日本総合研究所), 工藤剛(三井住友銀行)

16:00~17:00 テキストマイニング 3 (5階501教室) (3件) [座長]関和広(甲南大学)

(19) 因果チェーンを用いたリードラグ効果の実証分析,

中川慧, 指田晋吾(野村アセットマネジメント), 坂地泰紀, 和泉潔(東京大学)

(20) テキストマイニングを利用したテーマに関連する上場企業検索ツールの開発, 平野正徳, 坂地泰紀(東京大学), 木村笙

子(大和投資信託), 和泉潔, 松島裕康(東京大学), 長尾慎太郎(大和投資信託), 加藤惇雄(大和総研)

(21) 株式・債券・為替ごとの金融極性辞書構築のための表現獲得,

伊藤友助, 酒井浩之, 北島良三(成蹊大学), 末廣徹, 稲垣真太郎, 木村柚里(みずほ証券)

16:00~17:00 人工市場と取引分析 (4階401教室) (3件) [座長]西山昇(朝日ライフアセット)

(22) 人工市場を用いたザラ場市場におけるレバレッジド ETF の取引手法の検討,

丸山隼矢(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)

(23) 人工市場を用いた株式貸借市場の流動性の変化が市場に与える影響の分析,

宮崎文吾, 中川慧(野村アセットマネジメント)

(24) GCN による取引関係グラフからの企業の特徴量抽出, 森正和(日本総合研究所), 工藤剛(三井住友銀行)

17:15~18:15 実証的分析 (5階501教室) (3件) [座長]水田孝信(スパークス・アセット)

(25) 暗号資産(仮想通貨)の資産クラスとしての特性 - マクロ的視点における Bitcoin および Ethereum の解釈 -,

伊藤彰朗, 今村光良, 中川慧(野村アセットマネジメント)

(26) 潜在因子モデルを用いた日本株クロスセクション分析の実証研究, 笠原晃恭(大阪大学)

(27) t 過程潜在変数モデルによるポートフォリオ生成, 内山祐介(MAZIN), 中川慧(野村アセットマネジメント)

17:15~17:55 市場予測・運用 (4階401教室) (2件) [座長]平松賢士(アイフィスジャパン)

(28) 売買シグナルの強弱を考慮した Genetic Network Programming による外国為替取引における売買戦略の構築,

内田純平, 穴田一(東京都市大学)

(29) PointNet#を利用したボラティリティによる価格帯推定,

河合継(クリスタルメソッド), 石塚唯矢(クリスタルメソッド, 早稲田大学), 棚橋夏彦(クリスタルメソッド, 東京大学)

18:30-20:30 懇親会 (研究会が開催される同じ建物(6号館)の6階で立食形式で行う予定です)

---

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。 <http://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。 <http://sigfin.org/>