

第 24 回 人工知能学会 金融情報学研究会 (SIG-FIN)

<https://sigfin.org/024/>

== 1日目：3月14日（土）プログラム ==

一般発表 15分(発表12分+質疑2分+予備1分) (招待講演はございません)
(9:30 開場)

10:00～10:45 クラスタリング・戦略分析 1 (3件) [座長]西山昇(朝日ライフアセット)

- (1)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)
- (2)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)
- (3)非同期時系列の Lead-Lag 効果推定のための新しい推定量,
伊藤克哉(Preferred Networks), 中川慧(野村アセットマネジメント)

11:00～12:00 シミュレーション 1 (4件) [座長]落合友四郎(大妻女子大学)

- (4)人工市場を用いた負の売買手数料 (リベート) が株式市場に与える影響の調査,
星野真広(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)
- (5)裁定取引へのリベートは流動性を向上させるか? -人工市場によるシミュレーション分析-,
水田孝信(スパークスアセットマネジメント)
- (6)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)
- (7)人工市場を用いたレバレッジ ETF がザラ場市場に与える影響分析,
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)

(12:00-13:30 昼休み)

13:30～14:30 機械学習 1 (4件) [座長]関和広(甲南大学)

- (8)DSGE によるニューラルネットの正則化と経済予想,
塩野剛志(クレディ・スイス証券)
- (9)銘柄属性と市場情報を用いた深層学習株式リターン予測モデルの予測根拠の分析,
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)
- (10)変分自己符号化器を用いたネットワーク埋め込みと金融ネットワークへの応用,
川上雄大(神戸大学), 江口浩二(広島大学)
- (11)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)

15:00～16:15 テキストマイニング 1 (5 件) [座長]酒井浩之(成蹊大学)

- (12)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, 木村柚里, 稲垣真太郎(みずほ証券)
- (13)ニュース記事に基づく景気指標 S-APIR の開発,
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)
- (14)Identifying Different Definitions of Future in the Assessment of Future Economic Conditions:
Application of PU Learning and Text Mining,
加藤真大(東京大学)
- (15)アナリストレポートにおけるキーワード関連文の抽出と景況感推移観測への応用,
高山将丈, 小澤誠一(神戸大学), 廣瀬勇秀, 飯塚正昭, 渡辺一男, 逸見龍太(三井住友 DS アセットマネジメント)
- (16)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)

16:30～17:30 クラスタリング・戦略分析 2 (4 件) [座長]水田孝信(スパークスアセット)

- (17)Clarification of mechanism underlying price formation process in a forex market on the basis of
clustering of position management strategies,
末重拓己(東京工業大学), Didier Sornette(スイス連邦工科大学チューリッヒ校),
高安秀樹(Sony CSL), 高安美佐子(東京工業大学)
- (18)リターンに基づくクラスタリングを用いた投資信託スタイル分析,
副島聡一郎(名古屋工業大学), 松井藤五郎(中部大学), 犬塚信博, 武藤敦子, 森山甲一(名古屋工業大学)
- (19)売買シグナルの強弱を考慮した Genetic Network Programming による 外国為替取引戦略の構築,
内田純平, 穴田一(東京都市大学)
- (20)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)

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/>

第 24 回 人工知能学会 金融情報学研究会 (SIG-FIN)

<https://sigfin.org/024/>

== 2 日目 : 3 月 15 日 (日) プログラム ==

一般発表 15 分(発表 12 分 + 質疑 2 分 + 予備 1 分) (招待講演はございません)

(9:30 開場)

10:00~10:45 シミュレーション 2 (3 件) [座長]平松賢士(アイフイスジャパン)

- (21)人工市場を用いた高頻度取引が金融市場流動性に与える影響の調査,
益田裕司(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)
- (22)強化学習を用いた期待効用ベースヘッジ手法,
上田翼(三井住友 DS アセットマネジメント)
- (23)強化学習による高頻度取引戦略の構築,
小林弘幸, 和泉潔, 松島裕康, 坂地泰紀(東京大学)

11:00~12:15 機械学習 2 (5 件) [座長]坂地泰紀(東京大学)

- (24)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)
- (25)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)
- (26)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)
- (27)多相アテンション LSTM を用いた財務時系列データの予測,
吉見脩平(神戸大学), 江口浩二(広島大学)
- (28)ファイナンシャルデータにおけるレジーム変化検出,
土屋太助

(12:15-13:30 昼休み)

13:30~14:45 テキストマイニング 2 (5 件) [座長]酒井浩之(成蹊大学)

- (29)ニュース重要単語の機械学習によるアクティブ運用,
三好勝博, 細木唯以(茨城大学), 江口潤一(大和投資信託), 鈴木智也(茨城大学, 大和投資信託)
- (30)経済因果チェーン検索システムの構築と応用,
和泉潔, 坂地泰紀(東京大学)
- (31)経済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)
- (32)トピック埋め込み回帰モデルを用いた株価予測,
許蔚然(神戸大学), 江口浩二(広島大学)
- (33)ニューステキストを用いた ESG ファクター運用,
秋山祥伍(茨城大学), 江口潤一(大和投資信託), 鈴木智也(茨城大学, 大和投資信託)

15:00～16:15 関係分析・企業分析(5件) [座長]水田孝信(スパークスアセット)

- (34)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)
- (35)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)
- (36)Relationship between corporate brand and ROA in industrial markets,
真鍋友則(Sansan), 中川慧(野村アセットマネジメント)
- (37)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, 與五澤守(日本総合研究所), 工藤剛(三井住友銀行)
- (38)パスワード漏洩イベントを用いた企業分析,
今村光良(筑波大学, 野村アセットマネジメント), 面和成(筑波大学, 情報通信研究機構)

16:30～17:30 テキストマイニング 3 (4件) [座長]平松賢士(アイフィスジャパン)

- (39)株式・債券・為替ごとの金融極性辞書の自動構築,
伊藤友助, 酒井浩之(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)
- (40)新興市場を対象とした市況情報の抽出,
高野海斗, 神田裕輝, 酒井浩之(成蹊大学), 北島良三(東京工芸大学), 中川慧(野村アセットマネジメント)
- (41)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), 木村竹子(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)
- (42)文脈を考慮した決算短信からの業績要因抽出,
加藤悠太, 酒井浩之(成蹊大学)

17:30-17:40 主催者からのお知らせ

18:00-20:00 懇親会 (10号館12階ホールにて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。 <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/>