

第 27 回 人工知能学会 金融情報学研究会 (SIG-FIN)

<https://sigfin.org/027/>

==10月9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。)

(Zoom のブレイクアウトルームは 9:45 ごろから 19:00 ごろまでずっと解放しています。ご自由にお使いください。)

10:00-11:20 テキストマイニング 1 (4 件)[座長]水田孝信(スパークスアセット)

(01)金融極性辞書を用いたニューステキスト分析による経済動向予測

川崎拓海, 穴田一(東京都市大学)

(02)金融文書を用いた事前学習言語モデルの構築と検証

鈴木雅弘, 坂地泰紀, 平野正徳, 和泉潔(東京大学)

(03)機械学習を用いた統合報告書の ESG 関連ページの推定

河村康平(成蹊大学), 高野海斗(野村アセットマネジメント), 酒井浩之, 永並健吾(成蹊大学),
中川慧(野村アセットマネジメント)

(04)PDF 形式の金融文書における項目-数値間関係を考慮したテーブル情報抽出

青野有華, 市川幸史, 近藤浩史, 加藤淳也(日本総合研究所)

11:20-11:50 表彰式, 参加者からのお知らせ

11:50-13:00 昼休み

13:00-14:20 テキストマイニング 2 (4 件)[座長]中川慧(野村アセットマネジメント)

(05)有価証券報告書におけるリスク階層構造分析

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)

(06)特許ドメイン特化型 BERT による脱炭素関連特許技術の「見える化」

前原義明, 久々宇篤志, 長部喜幸(日本特許情報機構)

(07)金融テキストから生成した極性指標を用いた市場の因果性分析

田口怜, 渡邊光, 平野正徳, 鈴木雅弘, 坂地泰紀, 和泉潔(東京大学),
平松賢士(アイフイスジャパン, 金融データソリューションズ)

(08)因果チェーン探索による経済指標予測

和泉潔, 佐野仁美, 坂地泰紀(東京大学)

14:35-15:55 人工市場・人工経済・投資フロー(4件)[座長]坂地泰紀(東京大学)

(09)確率的にホールドの長さが決まる人工市場モデル

片平啓(筑波大学), 陳昱(東京大学), 秋山英三(筑波大学)

(10)人工市場を用いたショートサイドの市場非効率性に関する分析

則武誉人, 逸見龍太(三井住友 DS アセットマネジメント), 水田孝信(スパークスアセットマネジメント)

(11)財市場を内包したエージェントベース経済モデルの構築に関する一提案

高島幸成(長岡大学), 八木勲(工学院大学)

(12)国内株式投資信託における資金フローの非線形モデリング

吉田遼平, 中道拓馬(茨城大学), 田中陸(大和アセットマネジメント),
鈴木智也(茨城大学, 大和アセットマネジメント)

16:10-17:30 投資戦略(4件)[座長]落合友四郎(大妻女子大学)

(13)外国為替証拠金取引における解釈可能な売買戦略の構築

内田純平, 穴田一(東京都市大学)

(14)機械学習による為替フォワード取引期間の判別モデル

雉子波晶(茨城大学), 杉本誠忠(ワイジェイ FX), 酒本隆太(岡山大学),
鈴木智也(茨城大学, 大和アセットマネジメント)

(15)Thompson Sampling を用いた複数ポートフォリオの合成戦略

藤島圭吾(東京大学), 中川慧(野村アセットマネジメント)

(16)国債市場情報を用いた機械学習に基づく経済予測モデルの構築

水門善之(東京大学, 野村証券), 和泉潔, 坂地泰紀(東京大学)

19:00 ごろまで Zoom のブレイクアウトルームを解放しています。参加者同士でご自由にご歓談下さい。

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/>