

第 26 回 人工知能学会 金融情報学研究会 (SIG-FIN)

<https://sigfin.org/026/>

==3月6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)

(10:15 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 10:15 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。)

10:30~11:50 テキストマイニング (4件)[座長]酒井浩之(成蹊大学)

- (1)LDA で求めた新聞記事のトピック割合と株価指数の関係性,
竹澤譲, 伊藤真利子, 大西立顕(立教大学)
- (2)BERT を用いた有価証券報告書からの ESG 関連文抽出,
土橋諒太, 中田和秀(東京工業大学)
- (3)キーワード検索数とツイートの情報を用いたビットコイン価格の騰落予測,
松田周也, 原尚幸(同志社大学)
- (4)FinMegatron: Large Financial Domain Language Models,
Xianchao Wu (NVIDIA)

11:50~12:10 参加者からのお知らせ

(12:10-13:30 昼休み) (Zoom のブレイクアウトルームはご自由にお使いいただけます)

13:30~14:30 ポートフォリオ・リバランス (3件)[座長]落合友四郎(大妻女子大学)

- (5)株価の残差リターンに注目した深層学習ポートフォリオ最適化,
今城健太郎, 南賢太郎, 伊藤克哉(Preferred Networks), 中川慧(野村アセットマネジメント)
- (6)状態空間モデルを用いたバランス型投資信託のリバランス推定,
今井崇公(野村アセットマネジメント)
- (7)シュレーディング・リスクパリティポートフォリオ,
内山祐介(MAZIN), 中川慧(野村アセットマネジメント)

14:45~16:05 人工市場・データ分析(4件) [座長]水田孝信(スパークスアセット)

- (8)人工市場を用いたレポートが取引シェアに与える影響調査,
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)
- (9)金融データにおける VC 関連の応用,
落合友四郎(大妻女子大学), ホセ ナチエル(東邦大学)
- (10)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)予約価格を用いた指値・成行注文選択による約定寿命の冪分布の再現,
吉村勇志, 陳昱(東京大学)

16:20~17:40 予測・金融モデル(4件) [座長]中川慧(野村アセット)

- (12)高頻度注文情報を用いたデータの層化と多段階事前学習による株価動向予測,
松原冬樹, 和泉潔, 坂地泰紀(東京大学)
- (13)Restricted Genetic Network Programming によるリスク回避型外国為替取引戦略の構築,
内田純平, 穴田一(東京都市大学)
- (14)テンソルを用いたマルチモーダル学習による株式価格の変動予測,
笹尾知広, 中田和秀(東京工業大学)
- (15)効率的な Deep Hedging のためのニューラルネットワーク構造,
今木翔太(東京大学), 今城健太郎, 伊藤克哉, 南賢太郎(Preferred Networks),
中川慧(野村アセットマネジメント)

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/>