

第 29 回 人工知能学会 金融情報学研究会 (SIG-FIN)

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)

10:00-11:40 投資戦略・実証分析(5 件)[座長]落合友四郎(大妻女子大学)

(01)投資戦略の最適化の不安定性による金融市場の不安定性-人工市場を用いた分析-

水田 孝信(スパークス・アセット・マネジメント), 八木 勲(工学院大学), 高島 幸成(長岡大学)

(02)GPS データに基づく自動車生産量のリアルタイム推計値の株式投資における有効性

水門 善之(野村証券・東京大学), 田邊 洋人(野村証券)

(03)ティックサイズ変更時の状態変化

Hiroyuki Maruyama(Advanced Institute of Industrial Technology)

(04)決算説明会に関する情報開示の効果検証

真鍋 友則, 黒木 裕鷹(Sansan 株式会社), 指田 晋吾, 中川 慧(野村アセットマネジメント株式会社)

(05)確率制御を用いた暗号資産販売所における最適流動化戦略

久保 健治(株式会社メルカリ), 中川 慧(野村アセットマネジメント株式会社), 水上 大樹, Dipesh Acharya(株式会社メルコイン)

11:40-11:45 表彰式

11:45-13:00 昼休み

13:00-14:20 テキストマイニング(4 件)[座長]平松賢士(アイフイスジャパン)

(06)2 言語の極性分析を用いた中国市場インデックスの予測

Cong Liu, 坂地 泰紀, 和泉 潔(The University of Tokyo), 早川 正亮, 塚本 和哉(みずほ銀行), 加藤 大輔(みずほリサーチ&テクノロジーズ)

(07)UFO: 有価証券報告書の表を対象とした情報抽出タスクの提案

Yasutomo Kimura(Otaru University of Commerce), Takahito Kondo(Kyoto Sangyo University), Kazuma Kadowaki(The Japan Research Institute, Limited), Makoto P. Kato(University of Tsukuba)

(08)ニュースと株の埋め込みを使ったオーバーナイト株価予測

許 俊杰, 呂 良誠, 拜 亦名(シンプレクス株式会社)

(09)決算説明会テキストデータの感情極性と株式リターンの分析

黒木 裕鷹, 真鍋 友則(Sansan 株式会社), 指田 晋吾, 中川 慧(野村アセットマネジメント株式会社)

14:55-16:15 機械学習(4 件)[座長]中川 慧(野村アセットマネジメント)

(10)Graph Based Entropy を用いた株式市場のトレンドの変化点検知の検証

中田 喜之(ニッセイアセットマネジメント株式会社), 大澤 幸生(東京大学), 吉野 貴晶, 杉江 利章, 夷藤 翔(ニッセイアセットマネジメント株式会社), 西川 遥輔, 小島 湧太(東京大学)

(11)機械学習を用いた土地価格の予測

Yusuke Izutsu, Ayumu Nakagawa, Toshio Kasama(みずほリサーチ&テクノロジーズ株式会社)

(12)Neural Fractional SDE-Net による低正則パスを持つ金融時系列生成

林 晃平(東京大学), 中川 慧(野村アセットマネジメント株式会社)

(13)不確実性を考慮したトレーダー・カンパニー法による解釈可能な株価予測

Yugo Fujimoto, Kei Nakagawa(Nomura Asset Management Co., Ltd.), Kentaro Imajo Kentaro Minami(Preferred Networks, Inc)

16:50-18:10 時系列解析・最適化(4件)[座長]水門 善之(野村證券/東京大学)

(14)ARIMA-GA-SVRによる株価予測モデル

卓越, 森本 孝之(関西学院大学)

(15)金融市場での注文流の長期記憶性はどのように定量的に計測するべきか?

佐藤 優輝, 金澤 輝代士(筑波大学)

(16)非線形ホークス過程の漸近解析と強度のべき分布

金澤 輝代士(筑波大学), Didier Sornette(ETH Zurich)

(17)EC 物流における大規模商品ポートフォリオ選択問題の効率的解法検討

小池 和弘, 川村 真澄(アスクル株式会社), 佐川 大志, 田中 謙司(東京大学)

19:00 ごろまで会場で歓談できる予定です。参加者同士でご自由にご歓談下さい。

良かったと思う研究 2 つまで選んでいただくアンケートのご協力をお願いします

<https://forms.gle/hQb3qjz5snFaG1NY7> (右の QR コード)

今後の予定はホームページをご覧ください <https://sigfin.org/>

