

ファイナンス・セミナー 2018-2

入場無料

申込み不要

タイトル: テキストマイニングを用いた市場分析の試み

2018年9月27日(木曜日) 18:30 ~ 19:30

明治大学駿河台キャンパス アカデミーコモン9階309E 教室

講演内容: 金融市場参加者は、日々膨大なファンダメンタル情報、テクニカル情報に接している。経済資料、マーケットのテクニカル指標、重要人物の発言など、膨大な情報を取捨選択しつつ最大限に活用して市場操作を実施している。他方、コンピュータ技術の進展により、中央銀行や証券会社の分析レポート、掲示板等市場を分析したコンテンツは益々増加しており、個人、またはある組織がその全てに目を通すことは不可能に近い。

このような環境下、膨大な情報源からどのような情報を抽出、重視すべきなのか。また、人工知能技術を用いることで市場分析の補助が可能になるのではないか。このような観点から、日本の市場参加者が特に注目する日本銀行の金融経済月報を題材に、テキストマイニング技術を用いて市場分析を試み、また金融経済月報が実際の金利動向をどの程度説明しているのかについて検証を行った。

(本研究は2007年から2008年にかけて実施したものです。その後、人工知能学会等で発表した内容も一部含まれます)

講師: 三菱 UFJ 銀行 融資企画部 クレジットリスクマネジメント室
後藤 卓

講師略歴: 1997年名古屋大学工学部情報工学科卒業。

同年、現三菱 UFJ 銀行に入行。日本及び英国の市場部門にて ALM(Asset and Liability Management)、債券投資、プロップトレーディング、企画等を経験。2017年に英国から日本に帰国。現在は CCR(Counterparty Credit Risk) や CVA(Credit Valuation Adjustment) に係る規制対応、与信管理に携わる。



●お問い合わせ先: 明治大学専門職大学院事務室
TEL 03(3296)2397
E-mail guroken@mics.meiji.ac.jp

私立大学研究ブランディング事業

Math Everywhere
数理科学する 明治大学

