

ファイナンス・セミナー 2023-2

入場無料

「深層学習によるファイナンスの新展開： 金融商品の価格付け・リスク管理への応用のサーベイ」

2023年1月30日(月) 19:00~20:30

明治大学駿河台キャンパス アカデミーコモン 8階 308F 教室

講演内容

機械学習、特に深層学習や強化学習の急速な発展に伴い、それらのファイナンス分野への応用が活発に議論されている。こうした潮流を踏まえ、深層学習のファイナンスへの応用研究に関し、金融商品の価格付け・リスク管理の話題を中心に、最新の議論をまとめて解説する。特に、金融工学・数理ファイナンスの応用で最も重要なヘッジやキャリブレーションの問題に焦点を当てる。本講演では、既存技術の問題点を明確にし、それを深層学習がいかに関与するか、実務及び学術的視点から整理し、今後の課題を整理する。

講師

日本銀行 金融研究所 経済ファイナンス研究課 篠崎 裕司



講師略歴

2013年三菱 UFJ 銀行入行、デリバティブ関連業務(リスク管理/規制対応等)に携わった後、SMBC 日興証券にて金利エキゾチック・デリバティブのモデル開発に従事。その後、2020年日本銀行入行、金融機構局を経て、2022年2月より金融研究所にてファイナンス研究に従事。

実務の傍ら、東京工業大学にて計算ファイナンスの研究を行い2018年に博士(工学)を取得、2019年より東京工業大学理学院数学系非常勤講師を勤める。

開催方法

- 対面とオンラインを併用するハイブリット形式

申込方法

- 以下の URL または研究科ホームページのリンクから事前登録ください。

<https://forms.office.com/r/jHzDUzWufd>

研究科ホームページ

- 2022年度 公開講義・レクチャー実施予定一覧

https://www.meiji.ac.jp/mbs/information/22open_lecture.html

- 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