

2020年11月

各位

日本ファイナンス学会
第2回秋季研究大会実行委員会

**日本ファイナンス学会 特別公開セッション
「オルタナティブデータと機械学習が拓く新たなファイナンス実務と研究」のご案内**

日本ファイナンス学会では、学会の活動状況を広く一般の方にも知って頂くため、2020年12月5日(土)に開催される第2回秋季研究大会のセッションの一つを、特別公開セッション(無料参加可)とすることにいたしました。セッションはZoomウェビナーを利用して開催されます。視聴をご希望の方は、以下の方法でお申込みください。先着順で受け付け、定員に達し次第、締め切らせて頂きます。

【特別公開セッション】のご案内

日時：2020年12月5日(土) 15:10-17:30

テーマ：「オルタナティブデータと機械学習が拓く新たなファイナンス実務と研究」

内容：

15:10-15:15: 当セッションの目的・背景のご紹介

15:15-15:50: 講演1 「機械学習・AIの技術的進展と最新事例の紹介」
東京工業大学 経営工学系 准教授 中田和秀 氏

15:55-16:30: 講演2 「資産運用におけるオルタナティブデータ・機械学習の応用事例とその課題」
関西学院大学 経営戦略研究科 教授 岡田克彦 氏

16:35-17:30: パネル討論 「ファイナンス実務におけるオルタナティブデータと機械学習の活用可能性」

パネリスト： 野村アセットマネジメント 師岡勇弥 氏
三菱UFJトラスト投資工学研究所 久木田徹 氏
東京工業大学 中田和秀 氏
関西学院大学 岡田克彦 氏

モデレーター：みずほ第一FT 伊藤敬介 氏

【申し込み方法】

以下のURLの「申し込みフォームへ(一般参加の方へ)」よりお申込みください。

<https://nfa-net.jp/seminar/2020fopensession/>

視聴用URLは、後日、ご登録のメールアドレスにご案内申し上げます。

※日本ファイナンス学会会員の方は、事前にご案内する「第2回秋季研究大会」の視聴用URL付プログラムより視聴が可能となりますので、特別公開セッションの個別申し込みは不要です。

【日本ファイナンス学会入会のご案内】

今回を機に日本ファイナンス学会にご入会頂いた場合、(1) 12月5日に開催される第2回秋季研究大会全セッションに参加可能となります。(2) 2021年1月入会扱いとして来年度の年会費よりお支払い頂きます(2021年4月請求)。第2回秋季研究大会のプログラム、および日本ファイナンス学会の入会方法は、以下のとおりです。

【日本ファイナンス学会第2回秋季研究大会オンライン開催のご案内】

日時： 2020年12月5日(土) 9:15-17:30

プログラム： 以下のURLよりご参照ください

<https://nfa-net.jp/seminar/2122/>

【日本ファイナンス学会の入会方法】

日本ファイナンス学会には、以下の3つの会員区分があります。

1. 正会員(個人) ...年会費 10,000円
2. 法人会員.....年会費 50,000円(1口)
3. 特別賛助会員.....年会費 100,000円(1口;お申込みは2口以上から)

会費は、会計年度(4月~翌年3月)ごとの1年一括払いです。但し、今回を機に日本ファイナンス学会にご入会頂いた場合、今年度の年会費(~2021年3月末)は2021年1月入会扱いとして免除し、来年度の年会費よりお支払い頂きます(2021年4月請求)。

日本ファイナンス学会入会のお申し込みは、以下のURLからお願いします。

<https://nfa-net.jp/admission/>

皆様のご入会をお待ち申し上げます。

<問合せ先>

日本ファイナンス学会 第2回秋季研究大会事務局

(担当: 中川・小林)

〒160-8519 東京都新宿区南元町19

一般社団法人金融財政事情研究会 内

Tel:03-3354-2377 Fax:03-3359-7947

E-mail: nfa2020fall@nfa-net.jp

日本ファイナンス学会 特別公開セッション
「オルタナティブデータと機械学習が拓く新たなファイナンス実務と研究」
講師のご紹介

講演1: 中田 和秀 氏(なかた かずひで)

講演テーマ: 「機械学習・AI の技術的進展と最新事例の紹介」

東京工業大学工学院経営工学系准教授。理学院理財科学研究センターと超スマート社会卓越教育院も担当。東京大学工学部物理工学科、東京工業大学社会理工学研究科経営工学専攻を経て、2016年より現職。東京工業大学で博士(理学)を取得。専門は機械学習、最適化、オペレーションズ・リサーチ。日本応用数理学会「応用数理」編集委員、日本経営工学会 論文誌エリアエディタ、日本オペレーションズ学会数理計画研究部会幹事を歴任。2003年に船井情報科学新興賞、2015年と2017年に日本ソーシャルデータサイエンス学会より研究奨励賞、2016年に日本オペレーションズ・リサーチ学会より第36回事例研究賞を受賞。

講演2: 岡田 克彦 氏(おかだ かつひこ)

講演テーマ: 「資産運用におけるオルタナティブデータ・機械学習の応用事例とその課題」
関西学院大学大学院経営戦略研究科 教授。モルガン・スタンレー証券、UBS証券を経て、1996年シンガポールでHalberdier Capital Management Pte. Ltdを共同創業。帰国後2005年に関西学院大学着任。10年よりERATO 湊離散構造処理系プロジェクト共同研究者、12年にAI研究者らと(株)Magne-Max Capital Managementを創業、現在CEO/CIOを兼務。同社は2015年からYahoo! Japanと資本提携し、データ駆動型モデルで公募・私募投信・ヘッジファンドの運用助言を行う。行動経済学会常任理事、神戸大学博士(経営学)。

パネル討論:

師岡 勇弥 氏(もろおか ゆうや)

野村アセットマネジメント株式会社 運用部 株式グループ マルチ α チーム チームリーダー。日本総合研究所を経て、2006年野村アセットマネジメント入社。クオンツアナリスト業務を経験した後、2009年より定量手法をベースとしたポートフォリオマネジメントを担当。現在はAIやビッグデータを活用した株式プロダクトの運用および運用チームを統括。証券アナリスト協会検定会員(CMA)、CFA協会認定証券アナリスト(CFA)。東京工業大学大学院社会理工学研究科修士課程修了

久木田 徹 氏(くきた とおる)

株式会社 三菱UFJトラスト投資工学研究所 (MTEC) 研究員。クオンツとして株式のトレーディングから長期の運用モデル構築まで携わりつつ、リスク管理についても市場・信用・オペ及びそれらの統合に対応。現在はデータガバナンスや機械学習の実務適用を担当。東京都立大学理学修士。

中田 和秀 氏(なかた かずひで) (前掲)

岡田 克彦 氏(おかだ かつひこ) (前掲)

伊藤 敬介 氏(いとう けいすけ) (パネル討論モデレーター)

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社 取締役、日本ファイナンス学会常任理事。現・みずほ銀行入行後、フィナンシャルエンジニアリング部を経て、2017年より現職。日本CFA協会会長、現代ファイナンス共同編集者、証券アナリストジャーナル編集委員などを歴任。著書に、「新・証券投資論II」(日本経済新聞出版社、共著)がある。証券アナリスト協会検定会員(CMA)、CFA協会認定証券アナリスト(CFA)、国際公認投資アナリスト(CIIA)。早稲田大学工学修士、スタンフォード大学MBA。

2020年度 日本ファイナンス学会 第2回秋季研究大会 招待講演のご紹介

(12月5日 13:20-14:50 に招待講演を開催いたします。こちらは日本ファイナンス学会会員が聴講可能です)

近年のファイナンス研究は、テキスト・データ等の解析やビッグデータを用いた機械学習を実施することで、主に株価データや企業財務データを利用した伝統的な研究では提示しえなかった新たな知見を生み出しつつある。一方で、これらのオルタナティブ・データの分析には一定のスキルが必要であり、さまざまな注意点もある。本招待講演では、オルタナティブ・データの分析経験を豊富に持つ二名の講師を迎え、今後どのようなテーマの研究が期待されるか、研究に着手するにあたってどのような準備が必要か、などについて講義および議論をする予定です。

座長: 本多 俊毅 氏 (一橋大学大学院経営管理研究科教授)

講演1: 三輪 宏太郎 氏(みわ こうたろう)

講演テーマ: 「定性情報と企業価値」

九州大学経済学研究院 准教授。東京大学大学院博士課程修了(学術)。東京海上アセットマネジメント クオンツアナリストを経て、2020年10月より現職。専門は、行動ファイナンス、マーケットマイクロストラクチャー。主要論文として、Trading Hours Extension and Intraday Price Behavior(International Review of Economic & Finance)、Short-term Return Reversals and Intraday Transactions(Quarterly Journal of Finance)、Slow Price Reactions to Analysts' Recommendation Revisions (Quantitative Finance)など。アナリストレポートのテキスト情報に関する論文で、Australian Securities Exchange (ASX) Prize(受賞論文“Textual Opinion in Analyst Reports”)、SFM Research Paper Award(受賞論文:”The Informational Role of Analysts' Qualitative Research Outputs”)を国際学会において受賞。

講演2: 宮川 大介 氏(みやかわ だいすけ)

講演テーマ: 「リサーチテーマとしてのビッグデータと機械学習」

一橋大学大学院経営管理研究科 准教授。日本政策投資銀行、ハーバード大学などを経て2014年より現職。日本銀行金融研究所客員研究員、内閣府経済社会総合研究所客員研究員、中小企業庁中小企業政策審議会委員。研究分野は、企業・個人の行動解析・予測、取引ネットワーク分析、金融市場のマイクロ実証分析。民間企業との多数の共同研究実績を有し、機械学習手法を用いた複数の特許(企業パフォーマンス予測アルゴリズム、不正会計検知アルゴリズム、最適価格設定アルゴリズム)を取得。カリフォルニア大学ロサンゼルス校(UCLA)Ph.D. in economics。

以上