

【NEWS RELEASE】

2025年10月10日

SMBC日興証券株式会社

国立大学法人東京大学大学院工学系研究科 和泉研究室との共同研究開始について

SMBC日興証券株式会社(以下「当社」)は、国立大学法人東京大学大学院工学系研究科の和泉潔教授の研究室(以下「和泉研究室」)との間で、リスク管理業務への活用を目的として2025年10月より共同研究を開始いたしました。

1. 共同研究の要旨について

本共同研究は、ニュース・決算(数値/テキスト)・市場指標を統合して銘柄ごとの特定期間の予想最大下落率をAIを用いて推定し、その上で銘柄間の関係性・情報の伝播状況も考慮してそれらを調整する手法を研究開発するものです。開発した手法はデータドリブンなリスク管理の取り組みの一つとして、担保受け入れ銘柄の価格下落等の予兆検知、およびそれを起点とした迅速な与信・担保管理等に活用することを想定しています。本共同研究を通じて、金融機関のリスク管理能力を強化し、金融システム全体の健全性を保つことへの貢献、および学生や若手研究者が実社会の課題に触れ、より実践的なスキルを身に付けることに貢献することが期待できます。

2. 和泉研究室との取り組みについて

昨年度、和泉潔教授との技術顧問契約に基づき、一部の適時開示情報から個別銘柄の株価下落予兆を検知する簡易的なモデルの開発を行いました。本共同研究では、より広範なデータと多角的な視点を取り入れて本格的に取り組むものとなります。また、この取り組みをきっかけに、企業が金融市場における情報技術の最新事情、市場への人工知能応用を学生に紹介する東京大学の金融レジリエンス情報学の講義に当社リスク管理部員が登壇しています。

3. 和泉研究室について

東京大学大学院工学系研究科システム創成学専攻に所属し、金融情報学、市場シミュレーション、金融データマイニングの研究を行っています。実社会における人間行動のデータ分析および行動のモデル化、集団行動や社会経済現象のシミュレーション、実データ分析とシミュレーションの統合といった研究テーマを中心として活動しています。

以上

いっしょに、明日のこと。
Share the Future