

# 第7回 統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター 金融シンポジウム

金融が直面する  
新環境への対応と方法論Ⅱ

2019  
12/5[木]・6[金]  
13:30-17:55 10:00-17:55

会場：フクラシア丸ノ内オアゾ Hall A  
東京都千代田区丸の内 1-6-5 丸の内北口ビルディング16F

事前登録不要・参加費無料

お問い合わせ先▶

統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター シンポジウム  
開催事務局 [山下智志、長幡英明 (nagahata@ism.ac.jp)]

詳細はホームページをご覧ください▶

[https://www.ism.ac.jp/risk/contents/pdf/finance7th\\_program.pdf](https://www.ism.ac.jp/risk/contents/pdf/finance7th_program.pdf)

第7回 金融シンポジウム

検索



地域金融機関の収益力と経営効率改善策  
亀田 制作 日本銀行 金融機構局 審議役



マネー再考：ネオマネーがもたらす決済システムの構造変化  
副島 豊 日本銀行 決済機構局 FinTech センター長



協調フィルタリングを応用した注文板市場の流動性計測  
林 高樹 慶應義塾大学大学院  
経営管理研究科(ビジネス・スクール) 教授



フィンテックと金融デジタルライゼーションの推進  
松尾元信 金融庁 総合政策局 政策立案総括審議官

池森俊文 統計数理研究所 特命教授  
岡田幸彦 筑波大学 准教授  
川崎能典 統計数理研究所 教授  
阪 智香 関西学院大学 教授  
高橋 秀 株式会社三菱UFJ銀行  
デジタル企画部 副部長  
谷口 豊 ジブラルタ生命保険株式会社 収益管理チーム

徳山祐也 住友生命保険相互会社 主計部 数理室  
野村俊一 統計数理研究所 助教  
増田弘毅 九州大学 教授  
水野貴之 国立情報学研究所 准教授  
室町幸雄 首都大学東京 教授  
山下智志 統計数理研究所  
リスク解析戦略研究センター長  
(五十音順)

## 開催趣旨

統計数理研究所リスク解析戦略研究センターでは、社会の様々なリスクに対応するために、リスク数理、リスクデータ、金融、地震、環境、資源に関する学術的課題に取り組んでいます。金融リスクに関するシンポジウムは毎年開催しており7回目を迎えました。近年、データサイエンスや機械学習などの解析方法が確立され、情報技術の発展と相まって金融の実務に大きな影響を与えています。本シンポジウムでは最新の技術・政策・実務に関する報告を集め、未来を知るための議論をいたします。ご参加の程、よろしく申し上げます。



大学共同利用機関法人情報・システム研究機構  
統計数理研究所 副所長  
リスク解析戦略研究センター センター長  
**山下 智志**

事前登録不要・参加費無料

### お問い合わせ先▶

統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター シンポジウム  
開催事務局 [山下智志、長幡英明 (nagahata@ism.ac.jp)]

### 詳細はホームページをご覧ください▶

[https://www.ism.ac.jp/risk/contents/pdf/finance7th\\_program.pdf](https://www.ism.ac.jp/risk/contents/pdf/finance7th_program.pdf)



第7回 金融シンポジウム 🔍 検索

## 会場

フクラシア丸の内オアゾ (丸の内北口ビルディング 16F)

## アクセス

丸ノ内線 東京駅 / 東西線 大手町駅から徒歩直結  
JR 東京駅 丸の内北口 目前



# 第7回 統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター 金融シンポジウム

金融が直面する  
新環境への対応と方法論II



2019  
**12/5 [木] . 6 [金]**  
13:30-17:55 10:00-17:55  
会場：フクラシア丸の内オアゾ Hall A

主催 / 大学共同利用機関法人  
情報・システム研究機構 統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター  
※本研究は JSPS 科研費 JP18H05290 (谷口正信、早稲田大学) の助成を受けたものです

# プログラム

## 12月5日 (木)

13:00-13:30	受付
13:30-13:40	開会挨拶 山下 智志 (統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター長)
<b>Session 1 金融データの数理と確率・統計モデル</b> 座長：中川 秀敏 (一橋大学大学院 経営管理研究科 教授)	
13:40-14:20	林 高樹 (慶應義塾大学大学院 経営管理研究科 (ビジネス・スクール) 教授) 協調フィルタリングを応用した 注文板市場の流動性計測
14:20-15:00	室町 幸雄 (首都大学東京 教授) レジームスイッチング金利モデルを使った リスク計測
15:00-15:40	増田 弘毅 (九州大学 教授) カテゴリカルデータ解析の非エルゴード的展開
15:40-15:55	Coffee Break
<b>Session 2 ビッグデータ分析技術のフロンティア</b> 座長：山下 智志 (統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター長)	
15:55-16:35	川崎 能典 (統計数理研究所 教授) テキスト系列からの動的トピックの抽出による ボラティリティ予測
16:35-17:15	阪 智香 (関西学院大学 教授) 財務ビッグデータの探索的データ解析 - 企業の租税回避と付加価値分配
17:15-17:55	水野 貴之 (国立情報学研究所 准教授) 複雑ネットワーク科学で紐解く 3つのグローバルリスク

## 12月6日 (金)

9:30-10:00	受付
<b>Session 3 超高齢社会におけるアクチュアリアル・モデリング</b> 座長：松山 直樹 (明治大学大学院 先端数理科学研究科 教授)	
10:00-10:40	野村 俊一 (統計数理研究所 助教) 高階テンソル時系列に対する 動的因子モデルを用いた生命表解析
10:40-11:20	徳山 祐也 (住友生命保険相互会社 主計部 数理室) 高齢の死亡率モデルとその比較評価について
11:20-12:00	谷口 豊 (ジブラルタ生命保険株式会社 収益管理チーム) 機械学習による要介護認定割合・平均介護費用の 社会的決定要因の分析
12:00-13:30	Lunch Break
<b>Session 4 金融デジタル化の諸展開</b> 座長：池森 俊文 (統計数理研究所 特命教授)	
13:30-14:10	松尾 元信 (金融庁 総合政策局 政策立案総括審議官) フィンテックと金融デジタル化の推進
14:10-14:50	副島 豊 (日本銀行 決済機構局 FinTech センター長) マネー再考：ネオマネーがもたらす 決済システムの構造変化
14:50-15:30	高橋 秀 (株式会社三菱UFJ銀行 デジタル企画部 副部長) MUFG のデジタル戦略と ブロックチェーンの活用について
15:30-15:45	Coffee Break

<b>Session 5 金融社会を支える地域金融・会計・技術</b> 座長：山下 智志 (統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター長)	
15:45-16:25	亀田 制作 (日本銀行 金融機構局 審議役) 地域金融機関の収益力と経営効率改善策
16:25-17:05	岡田 幸彦 (筑波大学 准教授) 会計情報システムを使いこなす組織能力と サービス原価企画力
17:05-17:45	池森 俊文 (統計数理研究所 特命教授) 金融デジタル化と暗号・数論
-----	
17:45-17:55	閉会挨拶 山下 智志 (統計数理研究所 リスク解析戦略研究センター長)