

上智大学数学談話会のお知らせ

日時 2015年6月26日(金) 17:00-18:30

場所 市谷本館 201室

講演者 青木 義充 (株式会社 QUICK)

講演題目 金融データサイエンスの紹介 ～ビッグデータへの取り組み～

アブストラクト: 最近注目されているビッグデータというトピックは、IT などの技術革新により、大量のデータを容易に蓄積・共有できるようになったために広まったと考えられます。金融業界におけるビックデータといえば、ティックデータ(市場における約定と気配の価格、数量などのデータ)が挙げられます。取引所の環境が整備されたことにより、高速な取引が可能になりました(東京証券取引所では注文処理に要する時間はミリ秒単位)。その結果、取引件数が増大し、取得できるティックデータの量も膨大となりました。膨大なデータに埋もれることなく意味のある情報を引き出すためには、データが生成される背景を正しく理解し、適切なモデル化を行うことが必要となります。

本講演では、実際の金融データを例にとりながら、データの取得から解析・モデル化、妥当性の検証までのフローをトータルに科学するデータサイエンスの金融データへの応用について、ビッグデータへの取り組みを含め、初めての方々にもわかるように紹介します。

講演者略歴

青木義充 (あおき よしみつ)

株式会社 QUICK 商品戦略本部サービス企画部次長、博士(学術)総合研究大学院大学。慶應義塾大学を卒業後、一橋大学大学院国際企業戦略研究科助手を経て、QUICK に入社。総合研究大学院大学複合科学研究科統計科学専攻を修了し、現在に至る。現職で金融業界動向のマーケティング、新たな金融情報サービスの企画に従事する傍ら、一橋大学で非常勤講師も務めている。2014年2月には金融データの時系列分析の入門書「時系列データ分析」を技術評論社から出版。Amazon のカスタマーレビューで5つ星評価(5名の評価者)を得るなど、金融データ解析のわかりやすい入門書として好評を博している。

談話会委員

加藤 剛 tskato@sophia.ac.jp
中筋麻貴 nakasuji@sophia.ac.jp