

2019年3月20日

### 「グローバル資本市場における異常検知」に関する 東京大学 大澤研究室との共同研究開始について

ニッセイアセットマネジメント株式会社（社長：西 啓介、以下「当社」）と、国立大学法人東京大学（以下「東京大学」）大学院工学系研究科の大澤研究室は、グローバル資本市場における早期異常検知に関する共同研究を開始しました。

本共同研究は、グローバル資本市場において、様々な資産を分析し、資産間の関係が崩れる局面を早期に捉える手法の開発を目指します。本研究は、大澤幸生教授（東京大学大学院工学系研究科システム創成学専攻）と、当社・投資工学開発室が行います。最先端の学術研究を、当社がこれまで培ってまいりました資産運用のノウハウに応用することで、各資産間の結びつきが複雑化する金融市場において、相場局面変化の兆候を早期察知するノウハウの高度化を進めてまいります。

大澤幸生教授は、2000年に「チャンス発見学」を創始以来、データを活用してイノベーションを起こすことをテーマに、人々の意思決定を左右する重要事象等を発見する研究に取り組まれてきました。本研究においては、データ活用戦略策定および時系列データからの変理解に関する研究成果を活用致します。

当社は、2017年度に、投資工学開発室を立ち上げ、最新の投資理論・金融工学を活用した運用手法等の研究開発を進めてまいりました。投資工学開発センター長は、「日経ヴェリタス」アナリストランキングのクオンツ部門で16年連続1位を獲得した吉野貴晶が務めております。

当社は今後とも、お客様の長期的な資産形成に貢献できる商品や高品質なサービスの提供に向け、不断の努力を続けてまいります。引き続きご愛顧を賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

以上

#### ■ご注意事項

- ✓ 当資料は、情報提供を目的として作成しており、投資家に対する投資勧誘を目的とするものではありません。
- ✓ 当資料の内容は具体的な商品を勧誘するものではないので、手数料や報酬等の種類ごとの金額及びその合計額については、表示することができません。
- ✓ 投資する有価証券の価格の変動等により損失を生じるおそれがあります。
- ✓ 市場見通し等は、お客様の運用方針や投資判断等の参考となる情報の提供を目的としたものです。実際の投資等に係る最終的な決定は、お客様ご自身のご判断で行っていただきますようお願い申し上げます。
- ✓ 当資料に記載された運用商品、手法等は、リスクを含みます。運用実績は市場環境等により変動し、運用成果（損益）は全て投資家の皆様のもとなります。元本が保証された商品、手法ではありません。
- ✓ 当資料は、現時点で信頼できると考えられる情報を基に作成しておりますが、情報の正確性や完全性を保証するものではありません。
- ✓ 当資料に関わる一切の権利は、引用部分を除き弊社に属し、いかなる目的であれ当資料の一部または全部の無断での使用・複製は固くお断り致します。

ニッセイアセットマネジメント株式会社

金融商品取引業者 関東財務局長(金商)第 369 号

加入協会：一般社団法人投資信託協会／一般社団法人日本投資顧問業協会

審査確認番号：2018-RB38