

2022 年 9 月 26 日
ニッセイアセットマネジメント株式会社

当社ファイナンステクノロジー運用部浅井謙輔が日本応用数理学会論文賞を受賞しました

日本応用数理学会論文賞（2022 年度）を受賞

当社ファイナンステクノロジー運用部浅井謙輔が、このたび、東出卓朗氏らとの共著論文「初到達時間を用いたペアポートフォリオ最適化問題の新定式化」にて、2022 年度の一般社団法人日本応用数理学会論文賞・応用部門を受賞いたしました。

本論文では、投資戦略手法の一つであるペアトレーディング戦略（2つの株式のうち相対的に高い方を売り安い方を買って、価格差が収束した時に反対売買で収益を得ようとする戦略）について、新しい視点での定式化を行い実際のポートフォリオ運用への応用可能性を示しました。

ペア構築からペア解消までの時間が短く、その不確実性は低い方が望ましいというアイデアをもとに定式化を行った点や、単独のペアではなくポートフォリオでの投資を検証し、実際の運用への応用を意識していた点が、先行研究にはあまり見られない着眼点、新規性として評価されての受賞となりました。

https://jsiam.org/award/best_paper_award/best_paper_award2022/

※. 日本応用数理学会論文賞は、日本応用数理学会論文誌、英文論文誌 Japan Journal of Industrial and Applied Mathematics 及び JSIAM Letters に掲載された論文のうち、毎年 1 回、特に優秀なものを選び、その著者に贈呈される。

浅井 謙輔（あさい けんすけ） / ニッセイアセットマネジメント ファイナンステクノロジー運用部ポートフォリオ・マネジャー。中央大学大学院理工学研究科経営システム工学専攻修士課程修了後、ニッセイアセットマネジメントに入社。現在は、クオンツファンドマネージャーとして主に株式運用に従事しながら、中央大学理工学部共同研究員として連続最適化の共同研究に携わる。その他、金融工学や機械学習の分野に関心を持つ。