

三井住友海上火災保険株式会社

広報部 〒101-8011 東京都千代田区神田駿河台 3-9

TEL: 03-3259-3111(代表)

www.ms-ins.com

2018年3月28日

A I 技術を活用した為替予測モデルの導入について

MS & ADインシュアランス グループの三井住友海上火災保険株式会社（社長：原 典之）は、2018年3月から、トムソン・ロイター・ジャパン株式会社（社長：富田 秀夫）および国際基督教大学 教養学部アーツ・サイエンス学科 金子 拓也 准教授と連携して、A I 技術を活用した為替予測モデルの導入を開始しました。

本モデルは、膨大なニュースやSNS等の情報を、独自テキストマイニング^(※)と心理スコアリング技術から心理指数に仕立てたトムソン・ロイターの市場心理指数を利用し、金子准教授の協力のもと、同指数と為替市場の関係性を分析することで、直近指数から将来の為替動向を予測する仕組みです。今後、投資の意思決定支援ツールとして本モデルを活用していく予定です。

三井住友海上は、今後も資産運用の高度化・効率化を通じて、収益力向上に努めていきます。

(※) 大量のテキストデータをコンピュータ等で定量的に解析し、有用な情報を取り出す技術です。

1. 為替予測モデルについて

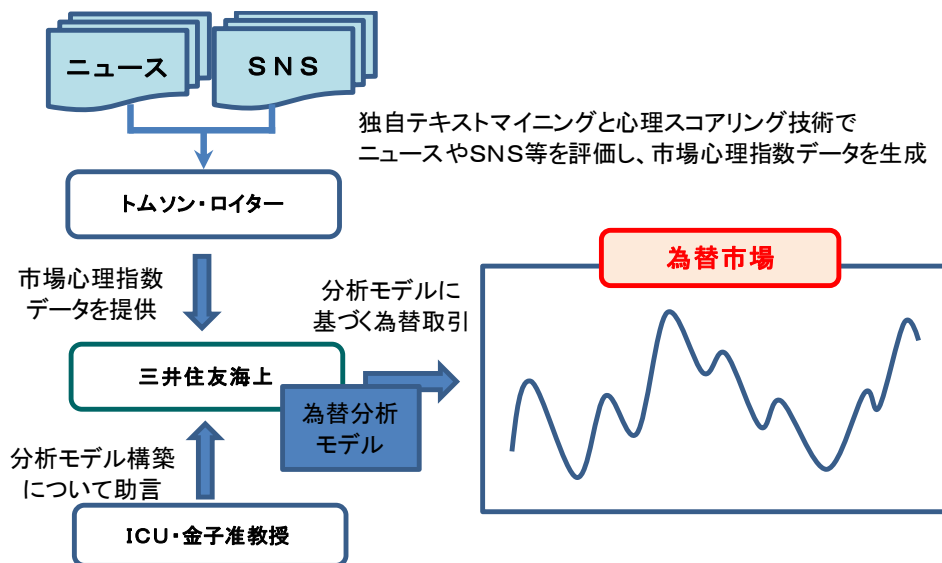
(1) モデルの概要

本モデルは、A I 技術を活用して、当社が独自に開発した為替予測モデルです。市場データならびに市場参加者の心理状態を適時適切に把握し、投資の意思決定に役立てることが可能です。

(2) モデルの仕組み

A I のテキストマイニング技術により、日々発信される膨大なニュースやSNSを読解し、人が抱く喜びや恐怖心、ストレス等のさまざまな心理を数値化する、トムソン・ロイターの市場心理指数を使用します。この指数から、世の中にあふれるニュース等が金融市場へ与える影響をリアルタイムかつ定量的・効率的に把握し、国際基督教大学 金子准教授の協力のもと、同指数と為替市場の関係性を分析することで、直近指数から将来の為替市場の動向を予測します。

<為替予測モデルのイメージ図>



(3) 導入時期

2018年3月

(4) 期待される効果

本モデルの導入により、市場予測の精度向上や投資判断の迅速化が見込まれ、効率的かつ効果的な投資業務の運営が期待されます。

2. 導入の背景

従来の人による情報分析や市場予測業務は、ニュースの確認から市場予測までに一定の時間を費やしていました。こうした中、当社は、ニュースが金融市場へ与える影響をリアルタイムかつ定量的・効率的に把握すべく、これまでよりも迅速かつ精度の高い市場予測が可能となる、本モデルを開発し、導入することとしました。

3. 今後の展開

当社は、為替市場のほか、債券等、他の金融市場への活用も検討していきます。

以 上