

2015年8月吉日

各位

日本保険・年金リスク学会
研究会担当理事
伊藤・金村・河野・原田

JARIP 研究会のご案内

拝啓 時下益々ご清栄のこととお慶び申し上げます。

日本保険・年金リスク学会（JARIP）の研究会を下記のとおり開催しますので、各位の積極的なご参加をお願い申し上げます。

敬具

記

1. 研修会の概要

日時：2015年9月12日（土曜日） 午後3時から6時

場所：日本大学文理学部 百周年記念館 2階第2会議室 （地図は次頁）

〔住所〕東京都世田谷区桜上水 3-25-40

講師：足立 高德 博士

立命館大学理工学部客員教授（講師略歴は次頁）

講演題目：「A Note on Algorithmic Trading based on Some Personal Experience
（個人的経験に基づくアルゴリズム取引の実際）」

講演概要：

ウォール街の投資銀行で14年間かかわってきたHFT（高頻度取引）の個人的経験を概観します。

アルゴリズム・ビジネスの階層構造に触れた後、話者が主に従事してきた確率的株価指数裁定取引についてコードの断片なども交えて少し詳しく説明します。

さらに超短期アルファなどのHFT特有の話題を概説した後、HFTの将来がどのようになるかを予想してみます。

I overview a brief history of HFT based on my 14 years' personal experience of the algorithmic trading business at a wall-street company.

Starting with descriptions about layers of the algo business, I mention a stochastic index arbitrage business that I employed in some detail.

After reviewing some HFT specific issues such as super short-period alpha, I try to forecast what is going on with HFT in near future.

2. 参加申し込み

期日:2015年9月10日(木) (JARIP会員以外も参加可能です)
学会サイトの【専用申込フォーム】よりお願い申し上げます。
<https://fs222.formasp.jp/c442/form6/>

3. 参加費

無料。(資料代等の実費をカバーするために従来お願いしていたカンパも不要)

4. 講師略歴

1985年東京工業大学大学院理工学研究科博士後期課程単位取得退学。
1985-1997年, ソフトウェアハウスを起業・経営し日本初のC++処理系を開発販売したりする。
1997年より2011年までMorgan Stanleyに勤務。Executive Director。
2000-2008年はニューヨーク本社にて自己勘定アルゴリズム取引のチームに所属する。
2014年一橋大学大学院国際企業戦略研究科博士後期課程修了。Ph. D(経営)
2014年4月より現職。
日本金融・証券計量・工学学会(JAFEE)会員。
情報処理学会情報企画調査会 SC22/C++小委員会委員。

[会場地図] 日本大学文理学部 百周年記念館 2階第2会議室
京王線 下高井戸あるいは桜上水下車、徒歩8分



以上