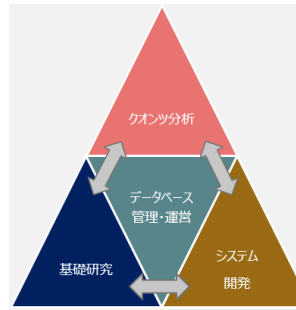


資産運用先端技術研究部

ミッション

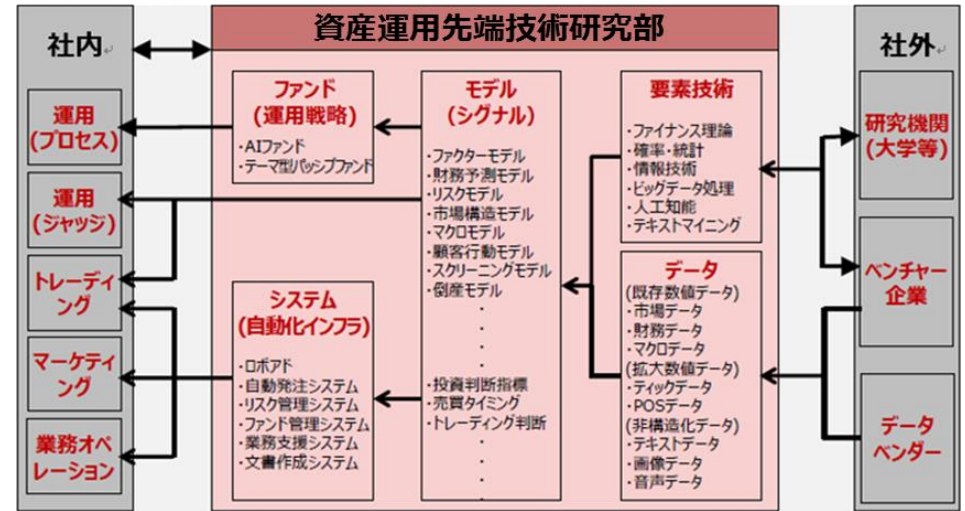
- 運用高度化・高付加価値化に資するクオンツリサーチやソリューションの提供
- 要素技術/高度IT/データエンジニアリングの活用を通じたデジタル化推進



NOMURA
野村アセットマネジメント

業務内容

- 要素技術に関する基礎研究
- 外部研究機関等との共同研究
- クオンツ・デジタル人材育成（研修等）
- 対外情報発信（学会・論文・講演等）
- 投資アイデア・モデル・新ファンドの開発
- パフォーマンスデータ等の管理・検証・改善支援
- データ・分析基盤の開発・整備
- 業務プロセスのデジタル化推進



採用関連

インターン情報

- 25卒向けインターン（クオンツ分析業務の体験）
例年11月～1月頃に開催（7日間）
- 野村パスポート（専攻分野の応用に挑戦、研究業績+1）
例年10月～12月頃に開催（10日間）
- 長期インターン（研究業績+1）
通年（1ヶ月～3か月程度）

本選考フロー



弊社採用ページ



直近の活動実績

研究成果

- Uncertainty Aware Trader-Company Method (**IEEE BIGDATA2022**)
- Dynamic Allocations for Currency Investment Strategies(**The European Journal of Finance**)
- Trader-Company Method(**AAMAS2021**)
- Deep Portfolio Optimization via Distributional Prediction of Residual Factors(**AAAI2021**)
- RM-CVaR: Regularized Multiple beta-CVaR Portfolio(**IJCAI2020**) など多数

野村パスポート(2021年度参加者)の成果

- 株価予測のためのMultiple-World Trader-Company法の提案とレジーム変化に対するロバスト性の評価 (**JSAI2022 学生奨励賞受賞**)
- Neural Rough Fractional SDE-Netによる低正則パスを持つ金融時系列生成 (**SigFin28 学生優秀論文賞受賞**)
- Fractional SDE-Net: Generation of Time Series Data with Long-term Memory (**IEEE DSAA 2022**)

JSAI2023

- **BCD-Forecast:機密金融時系列予測のためのデータ拡張バギング手法** (伊藤(三井物産)・中川・酒本(岡大))
- **FRBベージュブックコーパスの構築と分析** (高野・長谷川・内藤・中川)
- **金融オプション価格計算のための初期分布生成を伴う量子GAN** (佐野(京大)・古賀(京大)・阿部・中川)
- **局所的説明を考慮した深層マルチファクター戦略のための大域的サロゲートモデル** (藤本・中川)
- **最適輸送理論とリッチ曲率による金融ネットワークリスクの定量化** (赤松(阪大)・中川)
- **平均CVaRポートフォリオの二重ロバスト化** (中川・阿部・黒木(リクルート))
- **非ガウス型金融時系列に対する一般化双曲線過程** (内山(MAZIN)・濃野(MAZIN)・林(東大)・中川)