

【NEWS RELEASE】

2025 年 11 月 4 日

各 位

S M B C グローバル・インベストメント&コンサルティング株式会社

投資信託分類を効率化する AI 技術の当社論文が国際学術会議のワークショップにて採択

S M B C グローバル・インベストメント&コンサルティング株式会社(代表取締役社長:小林 賢、以下、「SGIC」)は、このたび、金融分野の AI 技術に関する国際学術会議「ICAIF」(The ACM International Conference on AI in Finance)併設のワークショップ(AI for Finance Symposium' 25 The 2nd Workshop on LLMs and Generative AI for Finance)において、当社の論文「Mutual Fund Categorization Using Large Language Models」が採択されたことをお知らせいたします。

本論文は 2025 年 11 月 15 日にシンガポールで開催される ACM ICAIF' 25 ワークショップで発表されます。

1. 論文概要

本論文では、投資信託の有価証券届出書などの説明文をもとに、ファンドアナリストが行う投資信託カテゴリ分類を大規模言語モデル(LLMs)によって再現する手法を提案しました。当社ファンドアナリストによる分類結果を学習データに用いてモデルをファインチューニングすることで、高精度に専門家の判断を再現できることを確認しました。

2. ICAIF (ACM International Conference on AI in Finance)について

ICAIF は、金融分野における AI 技術の基礎研究から実務応用まで幅広く扱う国際的な学術会議です。学術機関だけでなく、JPMorganChase をはじめとする世界的な金融機関も参加・協賛しており、金融 AI 研究の最先端が集まる場として高い評価を得ています。

3. 国際ワークショップ (AI for Finance Symposium' 25 The 2nd Workshop on LLMs and Generative AI for Finance) について

本ワークショップは、ICAIF の一環として、大規模言語モデルや生成 AI の急速な進展を金融・会計分野で活用することに焦点を当て、金融分析、価格予測、ポートフォリオ最適化、財務報告の解析、信用評価や破産予測など、多岐にわたる応用事例を議論するワークショップです。

今回の採択は、SGIC の研究活動が国際的に評価されたことを示すものです。SGIC は、LLM 等の AI 技術の研究・開発を通じ、資産運用業務の効率化・高度化を目指します。

以 上