

2024年12月10日  
三菱UFJアセットマネジメント株式会社

## Bloomberg 社主催のプログラミングコンペで2部門受賞

三菱UFJアセットマネジメント株式会社（取締役社長 <sup>よこかわ</sup> <sup>すなお</sup> 横川 直、以下「当社」）は、Bloomberg 社主催のプログラミングコンペ（Bloomberg ハッカソン<sup>※1</sup>）において、自然言語処理部門で「審査員賞」、定量分析部門で「BQuants Mastermind 賞」をそれぞれ受賞しましたので、お知らせいたします。

当社は、更なる運用力強化のため、運用部門内のDXを推進する専担部署を2024年4月に新設し、先進テクノロジーを活用した運用業務の高度化、効率化の取り組みを加速させています。また運用部門内のCoE（Center Of Excellence）組織として、DX推進に必要なインフラ、データの企画・整備および人材育成を担い、データ分析やシステム開発の基盤整備を進めています。

本年度は、データサイエンスやAIに精通した運用者の育成を目的とした人材育成プログラムの一貫として、Bloomberg ハッカソンにエントリーし、10月の本選において、自然言語処理部門では「ナラティブ経済学に着目した為替予測モデル」<sup>※2</sup>アプリ、定量分析部門では「Factor & State - compositions」<sup>※3</sup>アプリがそれぞれ受賞いたしました。

このような高い評価をいただけたことは、当社のこれまで培ってきた知見と運用力強化に関する取り組みの成果の一つとして表れたものだと考えています。今後も更なる運用力強化に取り組み、投資家の皆さまのご期待にお応えするとともに、資産運用を通じて豊かな未来の実現に貢献してまいります。

- ※1 ハッカソンとは、システムの解析や改良を意味する「ハック（Hack）」と「マラソン（Marathon）」を組み合わせた造語
- ※2 ナラティブ経済学とは人気のある（感染性の高い）物語（ナラティブ）が人々の間で伝播していくことで、人々の経済行動を変化させ、経済的な結果に影響を及ぼすという考え方。ナラティブの変容をニュースデータから抽出、考慮することでより精度の高い経済予測ができるという考えの下、本件では為替予測に用いたモデルを開発。
- ※3 金利動向に影響があると考えられる要素は多く開発されている。マクロ要因（金利、景気サイクル）に応じた要素の組み合わせは異なるため、局面別による各要素の可視化ができるアプリを開発。

### 【授賞式の様子】

自然言語処理部門：審査員賞

受賞コンテンツ：「ナラティブ経済学に着目した為替予測モデルの開発」



定量分析部門：BQuants Mastermind 賞

受賞コンテンツ：「Factor & State - compositions」



### 【Bloomberg ハッカソン概要】

開催日	2024年10月17日
開発期間	2024年7月～2024年10月（約3カ月程度）
ハッカソン概要	金融機関が独自のアプリ開発を競うもの。今年は2部門（自然言語部門、定量分析部門）に分けて開催され、延べ14社（来場者240名）が参加
参加部門	自然言語部門（8社エントリー） 定量分析部門（6社エントリー）

以上