

2023年11月29日

各位

三井住友信託銀行株式会社

生成 AI と量子技術の金融時系列への応用に関する
Zapata AI との協働開始について

三井住友信託銀行株式会社(本社:東京都千代田区、取締役社長:大山 一也、以下「当社」)は、Zapata Computing, Inc.(本社:マサチューセッツ州ボストン、CEO & Co-Founder:Christopher J. Savoie、以下「Zapata AI 社」)と生成 AI および量子技術の金融時系列への応用に関する協働を開始し、Zapata AI 社が提供するアプリケーション開発プラットフォーム Orquestra®(※1)の、当社マーケット事業における適用を目指した共同研究開発を行うことについて合意しましたのでお知らせします。

深層生成モデルを始めとする人工知能(AI)は、新しいデータセット(データの集合体)を生成する能力が向上してきています。かかる中、当社は本協働を通じ、当社マーケット事業での生成 AI の業務利用を目指し、将来的には以下のことが可能になることを期待して、Zapata AI 社との共同研究開発を進めていきます。

<生成 AI の業務利用により、可能になることを期待していること>

- 過去の統計とトレーダーによる見通しを組み合わせることで市場変動に関するシナリオを生成することで、トレーダーが現在よりも正確かつ迅速に意思決定すること。
- リスク管理におけるストレステストの高度化や、デリバティブトレーダーのヘッジ行動への応用。
- デリバティブの価格や XVA と呼ばれる評価調整額(※2)を、現在よりも効率的に計算すること。

当社ではデジタル活用により、お客さま基盤の拡大や新たな市場の創出を図るとともに、信託グループとして培ってきた知見・ノウハウを標準化・汎用化し、高品質なサービス・ソリューション等を各ステークホルダーに幅広く提供してまいります。Zapata AI 社との共同研究開発を通じ、さらなる金融 DX 化を進めていきます。

(※1) Orquestra®

企業がさまざまなハードウェアを活用してアプリケーション開発を行うことを援助するプラットフォームのこと。

(※2) 評価調整額

デリバティブ取引を締結したカウンターパーティの信用力や、自社における資金・資本の調達コストを考慮し、デリバティブ取引の価格評価に調整を加えるものです。

以上