

金融関係者、トレーダーのための Python (Jupyter Notebooks) 入門 (演習) 2 (午後の部)

◇セミナーは午前と午後の部に分かれています。

午前午後の両講座の同時お申し込みの場合は45300円の特別料金となります。◇

もりやひろゆき
講師 **森谷博之氏**

Quasars22 Private Limited(Singapore)
Director, MBA, MBA, MSc,
中央大学商学研究科兼任講師、
中央大学企業研究所客員研究員

日時 平成28年12月27日(火) 午後1時30分~午後5時00分

ついに日本でも Python が注目され始めました。海外では金融関連のデータ解析等に用いられています。また、ヘッジファンド、CTAなどのトレーディング戦略のバックテスト、マーケット分析でも活躍しています。本セミナーでは、金融関連、トレーダーの方で Python にとりあえず触れてみたいと思っている人を対象に講義と演習をまぜた形式で行います。

午後の部

前半 1 時間半

1. 日経平均株価の 1949 年からの価格データのダウンロード、グラフ表示
2. 日経平均株価の確定トレンド、確率的トレンド、自己回帰モデルを用いた分析。
(Statsmodel の統計モジュールを使用)
3. 分析結果の各種グラフ表示。
4. 簡単なモンテカルロ手法の演習
5. 経済データをダウンロードし簡単な多変量解析を紹介。
6. 日経 225 先物 mini を用いて取引戦略のバックテスト演習

後半 1 時間半

1. 約定価格の価格系列を念頭に置いて価格形成メカニズムの説明
(マーケットマイクロストラクチャ等)
2. 日経 225 先物 mini 2015 年 9 月限(8 月)を用いた価格特性の分析、演習
3. マーケットマイカートイモデル 1, 2 の演習
4. まとめ

PC に Python(Jupyter Notebooks)、追加モジュールがインストールされていることを前提に演習を進めます。PC に Python をインストールできない方は午前の部への参加をお勧めします。ノートブックパソコンは持ち込みが原則です。教科書は Windows10 を用いています。ノートブックパソコンは実費(1 万円程度)にてこちらで用意することも可能です。また、午前の部の OS は Windows 10 が好ましいですが、Mac, Linux などでも可能です。申し込みの際にはお使いになる OS をお知らせください。

教科書として「Python3 ではじめるシステムトレーディング」(2016/11/16 現在アマゾン売れ筋ランキング 1, 105 位)を用います。参加者にはパンローリング社からのご厚意により教科書が贈呈されます。演習で用いるプログラムコードは panrolling のホームページからダウンロード可能です(当日は CD にて配布)。また、12 章以降の高頻度データの取り扱いが少し複雑なところがあり、教科書で説明しきれていない部分、書き損じた部分についても説明します。

**【提供書籍：講師著『Python3 ではじめるシステムトレーディング - 環境構築と売買戦略』
(パンローリング株、税込 4, 104 円)】**

【講師紹介】

Quasars22 Private Limited(Singapore), Director, MBA, MBA, MSc, 中央大学商学研究科兼任講師、中央大学企業研究所客員研究員。主な論文に「金融市場の安定、多重性の増加、取引戦略の役割」企業研究第 30 号(2016 年 3 月)、「シンガポールの金融ビジネスの可能性とそれを支えるシステム」企業研究第 29 号(2015 年 8 月)がある。主な訳書に「シュワッガーのテクニカル分析」(1999、パンローリング)、「物理学者ウォール街を往く」(2005、東洋経済新報社)。

※録音・ビデオ撮影はご遠慮下さい。

■主催 **金融財務研究会**
http://www.kinyu.co.jp

Facebook : <http://www.facebook.com/keichoken>
Twitter : <https://twitter.com/#!/keichoken>
Blog : <http://keichoken.blogspot.com/>



開催日

平成28年12月27日(火)
13:30~17:00

会場

茅場町・グリーンヒルビル
金融財務研究会本社 セミナールーム
東京都中央区日本橋茅場町 1-10-8
TEL 03-5651-2030
地下鉄東西線・日比谷線 茅場町駅
6番出口より徒歩1分
(開場は開演の30分前です。)

参加費

1名につき35,300円
(消費税、参考資料を含む)
1社2名以上同時に参加お申込みいただいた場合、お2人目から1名につき30,000円。追加申込みの場合はその旨ご連絡下さい。
本セミナーは午前と午後の部に分かれています。午前・午後一括お申込みの場合は、45,300円の特別料金となります。

申込先

金融財務研究会 ホームページ <http://www.kinyu.co.jp/>
〒103-0025 東京都中央区日本橋茅場町 1-10-8 グリーンヒルビル
TEL 03-5651-2030 FAX 03-5695-8005

申込方法

ファックス又は郵便にて参加申込書をお送り下さい。上記ホームページの申込欄からお申し込みいただけます。折り返し、受講証と請求書を郵送致します。参加費は下記の普通預金口座に開催日前日までにお振込み下さい。(但し経理の都合等で間に合わない場合は、ご連絡いただければお待ちいたします。)又当日ご参加になれなかった場合、当社および経営調査研究会主催の他のセミナーに無料でご出席いただけます。(但し新しいセミナーの参加費との差額が2,000円以上の時は差額をお支払いいただきます。また、振替は1年以内をお願いいたします。)
ご記入いただきました個人情報、当社および関係会社の受講者名簿の整備や今後開催されるセミナーのご案内等に使用します。

振込口座

普通預金 口座名 (株)金融財務研究会

三菱東京UFJ銀行	本店	1642356	三井住友銀行	本店営業部	7397637
三菱UFJ信託銀行	本店	2818151	みずほ銀行	東京営業部	1427715
三井住友信託銀行	本店営業部	2993982	りそな銀行	東京営業部	1693669

金融関係者、トレーダーのための
Python(Jupyter Notebooks)入門(演習)2
(午後の部) 12/27

参加申込書

FAX 03-5695-8005

平成 年 月 日

ご連絡・講師へのご質問等ご記入下さい 午前午後の両講座一括お申込みの場合は下記に✓を入れてください。 <input type="checkbox"/> 午前・午後一括参加 <input type="checkbox"/> パソコン持参 (お使いになるOSをお知らせください。) *セミナーコート 2435 (Inv-282435)	会社名	TEL FAX		
	所在地	E-Mail		
	参加者ご氏名	〒		
	部課名			
	部課名			
	部課名			
	部課名			
書類送付先 (同上の場合記入不要)	ご担当者 TEL	部課名 FAX		

お申込の翌日には「受講証・請求書」を発送しておりますが、お手元に届かない場合は、弊社までご連絡下さい。

