

Python 3ではじめる システムトレード

(ティックデータの分析の基礎 - 平日午前部)

◇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49800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29年11月28日(火) 午前9時30分~12時30分

システムトレード・金融データ解析において市場の構造を理解していることは大変に重要なことです。ティックデータの取得方法、データの読み込みからはじめて、各種統計量を測定してティックデータの大きな特性を理解していきます。

午前の部

1. ティックデータの取得方法
2. ティックデータの読み込み(為替レートのインターネットからのダウンロード)
3. データのタイムスタンプの処理(タイムゾーン等)
4. データの統計的性質の把握(リターン、リターンボラティリティ、実現ボラティリティ、ティックボラティリティ等)

(学習ライブラリ: pandas-datareader、pandas、numpy/scipy、statsmodels、matplotlib、monthdelta、datetime)

(注意点: バックテストには日経 225mini を用いますが、copyright の問題からデータそのものの配布はできません。実際に試したい方は、情報ベンダーから購入する必要があります。ただし、為替のデータに関してはインターネットからダウンロードします。)

ノートブックパソコン持ち込みが原則です。PCには事前に anaconda がインストールされている必要があります。参考プログラムコードは Windows 10 で動作確認をしています。また、Windows 10 以外では Mac と Linux の使用が可能です。OS は申し込みの際にお知らせください。また、anaconda のインストールに問題がある場合にはご連絡ください。Eメールにて対応させていただきます。

参考文献:

『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)、
日経ソフトウェア4, 5, 6月号連載記事「Pythonで金融分析」
日経ソフトウェア8月号連載記事「Pythonで投資の王道を学ぶ」
Quantaized price volatility model for transaction data
(Evolutionary and Institutional Economic Review)

【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29年11月28日(火)
9:30~12:30

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28,000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23,000円。追加申込みの場合は
その旨ご記入下さい。

申込先

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、49,800円(お二人目から44,000円)の特別料金となります。

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
らもお申しいただけます。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年以内にお願いたします。)

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

----- 切らずにこのままお送り下さい -----

Python3ではじめるシステムトレード
(ティックデータの分析の基礎 - 平日午前部)

参加申込書

FAX 03-5695-8005

11/28

平成29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 お使いになるOSをお知らせ ください。 *セミナーコード 2241 (Inv-292241)	会社名	TEL FAX		
	所在地	E-Mail 〒		
	参加者ご氏名	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。