

Python 3ではじめる システムトレード

(ティックデータを利用した取引戦略 - 平日午後部)

◇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) 午後1時30分~午後7時00分

システムトレード・金融データ解析の基礎は需要と供給の分析です。金融市場でこの需要と供給の状態を知るためにはティックデータの分析が欠かせません。本セミナーでは、板の分析からはじめて、データの解析・取引戦略の構築に挑みます。

午後の部

1. 板情報の分析
2. 時間処理
3. データの統計的性質の把握
4. 取引戦略の構築

演習：トレード戦略を複数銘柄、複数市場で試すことは必要か？

* 演習の内容は参加者が提案することも可能です。

午前・午後の知識を用いて解決策を探すのが目的です。

(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」
Quantized 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)
13:30~19:00

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35,000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30,000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送りいただけます。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
(ティックデータを利用した取引戦略 - 平日午後部)

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 2243 (Inv-292243)	会社名	TEL		
		FAX		
	E-Mail			
	所在地	〒		
	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	部課名		
	TEL	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。