

Python 3ではじめる システムトレード (時系列分析：土曜午後の部)

◇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49800円の特別料金となります。◇

講師 **もりやひろゆき**
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30年6月9日(土) 午後1時30分～午後6時00分

海外では Python が非常に注目され、金融関連のデータ解析等に積極的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、時系列分析の手法を用いたシステムトレードの方法を紹介していきます。

午後の1部前半:13:30-15:00

1.回帰モデル

(ア) 線形回帰、多重回帰、正則化

午後の1部後半:15:00-16:30

2.時系列モデル

(ア) AR,ARMA

(イ) ARIMA

午後の2部:16:30-18:00

3.状態空間モデル

(ア) ローカルレベルモデル

(イ) トレンドモデル

(ウ) 季節変動モデル

受講対象者：プログラミング未経験者、Python 未経験者は午前からの参加をお勧めします。PC には Jupyter Notebook がインストールされている必要があります。問題のある方は電子メールにてご連絡ください。

ノートブックパソコン持ち込みが原則です。 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。

参考文献：

「Python3 ではじめるシステムトレード」パンローリング
「状態空間モデリングによる時系列分析入門」シーエーピー出版

【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30年6月9日(土)
13:30~18:00

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

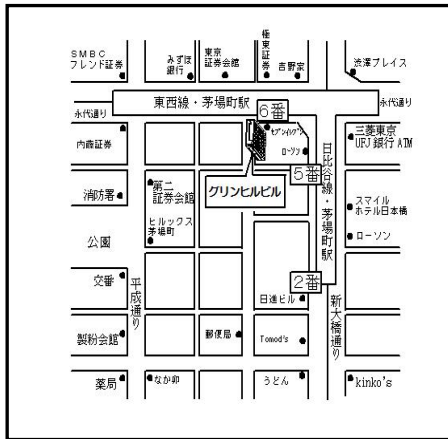
ファックス又は郵便にて参加申込書をお送り下さい。上記ホームページの申込欄か
らもお申送りいただけます。折り返し、受講証と請求書を郵送致します。参加費は下
記の普通預金口座に開催日前日までにお振込み下さい。(但し経理の都合等で間に
合わない場合は、ご連絡いただければお待ちいたします。)又当日ご参加になれな
かった場合、当社および経営調査研究会主催の他のセミナーに無料でご出席いた
だけます。(但し新しいセミナーの参加費との差額が2,000円以上の時は差額をお支
払いいただきます。また、振替は1年以内にお願いたします。)

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
(時系列分析：土曜午後の部)

参加申込書

FAX 03-5695-8005

6/9

平成30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 1069 (Inv-301069)	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。