

Python 3ではじめる システムトレード (機械学習入門2：日曜午後の部)

◇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10月21日(日) 午後1時30分~午後7時00分

投資手法、金融理論は常に進化しています。長い間、価格のパターンをどのように表現し、どのように将来の予測に生かせばよいかの問題でした。午後の部では価格のパターンをとらえるという発想から機械学習を用いてシステムトレード戦略を構築していきます。安定した収益を達成するためにはそれだけでは不十分です。統計学、金融工学をどのように利用したらよいかを学びます。

午後の部前半：13:30-17:00

1. 投資の基礎(リスクパリティ)
2. システムトレードの基礎(クロスオーバー戦略)
3. 教師あり学習を用いた取引戦略(価格予測戦略、指数予測戦略、指数構築戦略)
4. 遺伝的アルゴリズムの活用(取引戦略、ポートフォリオマネジメント)

午後の部後半：17:30-19:00

5. トレーディングライブラリの現状(Zipline、IB Python API 等)
6. AI、機械学習、遺伝的アルゴリズム、状態空間方程式を用いた戦略の評価

対象者：機械学習に興味のある方であればどなたでも参加可能です。参加者においては特にプログラミングの経験は必要ありませんが、エクセルの経験等、PCを使い慣れている方がセミナーの内容を理解するには有利かと思われます。内容は、時系列データ(株価、為替レート等)に対する機械学習を用いた分析になりますが、他の分野への応用も可能です。Jupyter Noteboo、Scikit leark が事前に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
- ・ Python 機械学習プログラミング
- ・ Pythonではじめる機械学習
- ・ 日経ソフトウェア連載 金融データをPythonで分析してみよう 2018年7月、9月、11月号
- ・ 金融工学のための遺伝的アルゴリズム

【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**
https://www.kinyu.co.jp

Facebook : <https://www.facebook.com/keichoken>
Twitter : <https://twitter.com/#!/keichoken>
Blog : <https://kinyu.co.jp/blog/>



開催日

平成30年10月21日(日)
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 <https://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
(機械学習入門2:日曜午後の部)

参加申込書

FAX 03-5695-8005

10/21

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 1979 (Inv-301979) | 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 | 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。