

ゼロからまなぶ統計学 (カルマンフィルター:Python 編)

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 2019年9月20日(金) 午前9時30分~12時30分

状態空間方程式は予測問題の解決方法として長い歴史をもちます。モデルは柔軟性に富み、トレンド、季節性、説明変数、観測誤差など、様々な要因を組み込むことが可能です。しかし、状態空間方程式の解法には最小二乗法などのなじみのある方法を用いないために、独学でのマスターは容易ではありません。

本セミナーでは Python を用いてさまざまな時間間隔のデータを分析することで、状態空間方程式の特徴を理解するとともに予測の問題に取り組みます。

9:30-10:30 状態空間方程式入門

1. Statsmodel の状態空間方程式

10:30-12:30 Python 演習

2. 高頻度データ: 日経先物、ドル円の為替レート

3. 日次データ: 米国株価、為替レート

4. 月次データ: 株価、為替レート、経済指標、売上高等

■本セミナーに参加して修得できること

予測の本質が分かるようになり、その可能性と限界を理解できます。Statsmodel を用いてデータの予測・分析ができるようになります。予測の基礎知識、カルマンフィルターの基礎については「カルマンフィルター:エクセル編」にて行います。

■受講対象者

予測について「初心者」の方を対象としています。予測、状態空間方程式、カルマンフィルターに興味のある方であればどなたでも参加可能です。

■ノートブックパソコンは持ち込みが原則です。

PCには事前に anaconda、Statsmodel がインストールされている必要があります。インストールに問題がある場合にはご連絡ください。

参考文献:

経済・ファイナンスのための カルマンフィルター入門 (朝倉書店)

Qitta:Pythonではじめるシステムトレード:予測について

<https://qiita.com/innovation1005/items/76d8a93c261e7d357ab8>

Qitta:Pythonではじめるシステムトレード:トレンドについて

<https://qiita.com/innovation1005/private/94c1065884be5c197e85>

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



開催日

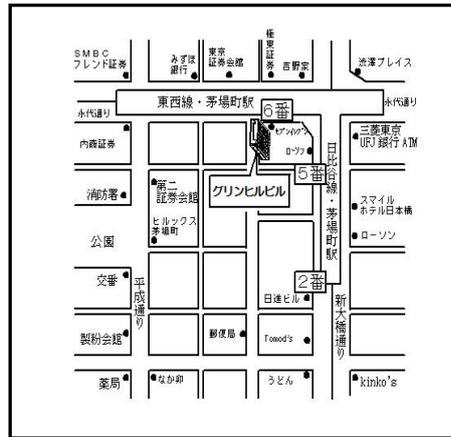
2019年9月20日(金)
9:30 ~ 12:30

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34,700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29,000円。追加申込みの場合はその旨ご記入下さい。



申込先

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

ゼロからまなぶ統計学
(カルマンフィルター:Python 編)
9 / 20

FAX 03-5695-8005

参加申込書

2019年 月 日

ご連絡・講師へのご質問等ご記入下さい	会社名	TEL FAX			
	所在地	E-Mail 〒			
お使いになるOSをお知らせください。	参加者ご氏名	部課名			
	〃	〃			
	〃	〃			
	〃	〃			
*セミナーコード 1741 (Inv-k191741)	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。