

確率過程・時系列解析入門(Python 編) 午前の部

◇午前午後両講座同時お申し込みで午後の部が30,000円の特別料金となります◇

講師 **森谷博之氏** もりやひろゆき
オックスフォードファイナンシャルエデュケーション
Director, MBA(Strath), MBA(HW), MSc(London)

日時 2024年4月5日(金) 午前9時30分~12時30分

■このセミナーはZoomでご受講いただけます。お申し込み後に詳細をメールでお送りします。

時系列データ分析は、日々変化する世界を理解し、将来の動向を予測するために不可欠なツールです。わたしたちの周りには時間の経過とともに変化する多数の現象が存在し、これらの変化を数値化し、分析することでこれらの現象の背後にある原因を理解し、将来起こるであろう事態に対し対処することができます。

本セミナーでは時系列分析の基本から応用までを段階的に学びます。まず前準備として確率過程を学びます。つぎに確定的現象について学び、確率的現象と確定的現象のモデル化へと進みます。基本概念をしっかりと身につけることで、より複雑な時系列モデルや予測手法へスムーズに進むことができるよう下準備をします。実際にビジネスでの現場を想定してPythonやStatsmodelを用いて具体的なデータを分析していきます。

第1部：確率過程・時系列データ分析入門 9:30~11:00

- ・ 確率過程：パスとブラウン運動
- ・ ランダムウォーク：離散的確率過程とパラメータ推定
- ・ 自己回帰移動平均過程：定常性、ホワイトノイズ、強定常
- ・ 自己回帰和分移動平均過程：差分と単位根検定
- ・ スペクトラムとペリオドグラム：時間領域と周波数領域
- ・ テレンドとパターン：季節性ダミーと確定的テレンド

第2部：時系列解析 11:10~12:30

- ・ Deterministic Process クラス：確定的テレンド・パターンのダミー変数による分析
- ・ AutoReg クラス：自己回帰モデルの最小二乗法による最適化

■本セミナーに参加して修得できること

すべてのセッションでPythonを活用し、実際のデータセットを使用して時系列分析を行います。これにより、理論的な学習と実践的なスキルの両方を身につけることができます。

■受講対象者

統計の基礎知識を持つ方々を対象とし、Pythonを使用した時系列分析の初歩から応用までを段階的に学びます。プログラミング初心者でも理解しやすいよう、基本的なPythonのコードの書き方から説明します。

■使用ソフト：Python

■PCには事前にPython(Jupyter notebook)がインストールされている必要があります。

参考文献：

「統計学基礎」(日本統計学会編)東京図書
「統計学実践ワークブック」日本統計学会編

【講師紹介】オックスフォードファイナンシャルエデュケーション, MBA(Strath), MBA(HW), MSc(London). 国際機関、金融機関で勤務後、大学での教育活動に従事。実務家向けセミナー多数。主な訳書「物理学者ウォール街を往く」(東洋経済新報社)。主な著書「Python3ではじめるシステムトレード改訂版」(パシフィック)

※録音・録画をご遠慮下さい。

主催 **金融財務研究会**
https://www.kinyu.co.jp

Facebook : <https://www.facebook.com/keichoken>
Twitter : <https://twitter.com/keichoken05>
Blog : <https://www.kinyu.co.jp/blog/>



開催日

2024年4月5日(金)
9:30~12:30

本セミナーは Zoom で開催いたします。

インターネットに繋がるパソコンがあれば、どこでも受講できます。
原則として、参加費をお振込いただいた後に、メールで詳細をお送りいたします。

参加費

1名につき35,300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円になります。追加申込みの場合はその旨をご記入下さい。本セミナーは午前と午後の部があります。午前・午後一括お申込みの場合は、午後の部が30,000円の特別料金となります。

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 グリンヒルビル
TEL 03-5651-2030 FAX 03-5695-8005

申込方法

上記ホームページの申込欄からお申し込み下さい。参加申込書を FAX 又は郵送いただいております。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。)クレジットカードご利用の場合は、質問欄にその旨をご連絡下さい。参加費の払戻しは致しませんので、当日ご参加になれない場合は、代理の方のご出席あるいは当社および金融財務研究会主催の他のセミナーへのお振替をお願いします。(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にはセミナーの開催のために使用させていただきますが、漏洩などがないよう最善の予防、是正に努めます。詳しくは弊社ホームページをご覧ください。

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

◇クレジットカードは Visa、Mastercard、American Express、JCB、Diners Club、Discover がご利用いただけます。

----- 切らずにこのままお送り下さい -----

確率過程・時系列解析入門 (Python 編)
午前の部 **Zoom** 4 / 5

参加申込書

FAX 03-5695-8005

2024年 月 日

ご連絡・講師へのご質問等ご記入下さい 弊社からのお知らせ、メルマガの送信を <input type="checkbox"/> 受信する <input type="checkbox"/> 受信しない 講師へのメールアドレス開示に <input type="checkbox"/> 同意する <input type="checkbox"/> 同意しない クレジットカードをご利用の場合は下記に✓を入れて下さい。 <input type="checkbox"/> クレジットカード利用	会社名	TEL FAX		
	所在地	E-Mail		
セミナーコード 0951 (Fin-k240951)	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。