

Zoom セミナー

KDE とマルコフ連鎖モンテカルロ法入門 (Python 編) 午後の部

◇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◇
もりやひろゆき

講師 **森谷博之氏**

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6月4日 (火) 午後1時30分～午後4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。

モンテカルロシミュレーションはその柔軟性と扱いやすさから複雑な構造をもつ金融商品の価格評価やリスク管理に幅広く応用されています。その応用範囲は一変量の市場リスク・信用リスクの評価から複雑な相関構造をもつバスケットオプションの評価、ポートフォリオ分析までと多岐にわたります。複雑な構造を持つ時系列データ・乱数の生成は容易ではありません。そこで活躍するのがカーネル密度推定とマルコフ連鎖モンテカルロ法 (MCMC) です。

本セミナーの午後の部では、午前の部で学んだ基礎知識をもとに Python の豊富なライブラリーを用いて、基本的な応用を学びます。午後の部ではカーネル密度推定を用いて実データを同定し、MCMC でサンプリングして、リスク評価、投資戦略の構築を行います。

第1部: KDEとMCMC 13:30～15:00

- ・カーネル密度推定 (KDE): カーネル関数とバンド幅
- ・1変量KDE: ヒストグラムとの比較
- ・単変量混合分布の例: 実データをKDEにより同定
- ・分布としてのKDEと特性値: エントロピー、CDFなど
- ・ハザードレート: 累積ハザード関数の可視化

第2部: より豊かな表現を求めて 15:10～16:30

- ・単変量混合分布を用いたクレジットリスクの評価
- ・多変量混合分布を用いたバスケットオプションの評価とヘッジ
- ・その他: 時間の許す範囲でその他の例を紹介

■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データ分析を行います。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 を使用したデータ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に説明します。

■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。

■本セミナーは事前に講師とメールで打ち合わせを行います。そのため、講師にメールアドレスを開示させていただきます。ご了承の上お申込みいただきますようお願いいたします。

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
- statsmodels のリファレンスとサンプル

【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、金融機関での勤務後、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」(パンローリング)
※録音・録画はご遠慮下さい。

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

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



開催日

2024年6月4日(火)
13:30~16:30

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35,500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 又は郵送いただいたお申し込みも承ります。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。)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

KDE とマルコフ連鎖モンテカルロ法入門
(Python 編)午後の部 **Zoom** 6 / 4

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 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 セミナーコード 0955 (Fin- k240955)	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 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。