

アルゴリズム取引の数学

足立 高德

立命館大学 BKC 社系研究機構

Abstract

アルゴリズム取引をビジネスとして行うとき、アルファ探索、戦略策定、実装、オペレーションという4つの要素が必要になる。

今回の報告では、これら4要素のうち、アルファ探索と戦略策定を中心に、そこで道具として使われる数学についていくつか紹介し、あわせてアルゴリズム取引の将来について展望する。