



**РАСПИСАНИЕ ЗАНЯТИЙ**  
слушателей программы повышения квалификации  
"Инвестиционные стратегии: разработка, тестирование и оценка на Python"  
группа № 2ИС-ПК  
с 18.10.2021 по 19.11.2021

Дата	День недели	Время	Ак.часов	Зачёт	Наименование дисциплины (мероприятия)	Ф.И.О. преподавателя (полностью)	Аудитория	Примечание
18.10.2021	понедельник	18 30 - 21 40	4	-	Примеры количественных стратегий инвестирования. От идеи к реализации	Теплова Т.В.	A-214	
19.10.2021	вторник	18 30 - 21 40	4	-	Введение в Python. Адаптационный курс по среде разработки, переменным и функциям	Соколова Т.В.	Компьютерный класс	
21.10.2021	четверг	18 30 - 21 40	4	-	Работа с внешними библиотеками в Python. Решения для анализа данных - pandas, numpy и matplotlib.	Соколова Т.В.	Компьютерный класс	
22.10.2021	пятница	18 30 - 21 40	4	-	Python для финансистов. Эконометрические модели	Соколова Т.В.	Компьютерный класс	
25.10.2021	понедельник	18 30 - 21 40	4	-	Выгрузка биржевых данных из бесплатных источников. Yahoo Finance, MOEX API, Quandl + дополнительное занятие по выгрузке данных из терминала Eikon (опционально)	Томтосов А.Ф.	Компьютерный класс	
27.10.2021	среда	18 30 - 21 40	4	-	Обработка биржевых данных. Работаем с пропусками, выбросами и другими врагами аналитика данных.	Томтосов А.Ф.	Компьютерный класс	
29.10.2021	пятница	18 30 - 21 40	4	-	Оценка и сравнение стратегий. Основные метрики и коэффициенты	Теплова Т.В.	A-214	
08.11.2021	понедельник	18 30 - 21 40	4	-	Построение первой стратегии Momentum. Знакомство с библиотекой Portfolio Quantitative Research	Томтосов А.Ф.	Компьютерный класс	
10.11.2021	среда	18 30 - 21 40	4	-	Промежуточная аналитика при реализации стратегий. Расчет собственных бенчмарков	Томтосов А.Ф.	Компьютерный класс	
12.11.2021	пятница	18 30 - 21 40	4	-	Практические моменты тестирования стратегий. Комиссионные издержки и ликвидность	Томтосов А.Ф.	Компьютерный класс	
15.11.2021	понедельник	18 30 - 21 40	4	-	Альтернативные стратегии инвестирования и количественный подход	Томтосов А.Ф.	Компьютерный класс	
17.11.2021	среда	18 30 - 21 40	4	-	Оценка и метрики на примере фундаментальной стратегии Value	Томтосов А.Ф.	Компьютерный класс	
19.11.2021	пятница	18 30 - 21 40	-	*зачёт	*Итоговая аттестация	Соколова Т.В., Томтосов А.Ф.	Компьютерный класс	

\*Итоговая аттестация (зачет) проводится в форме защиты разработанной инвестиционной стратегии