

Design and implement investment strategies
based on smart algorithms that learn from data using Python

Hands-On
MACHINE LEARNING
for **ALGORITHMIC TRADING**

핸즈온 머신러닝·딥러닝 알고리즘 트레이딩
파이썬, Pandas, NumPy, Scikit-learn, 케라스를 활용한 효과적인 거래 전략



스테판 젠슨 지음 홍창수·이기홍 옮김

| 지은이 소개 |

스테판 젠슨 ^{Stefan Jansen}

공인재무분석사^{CFA}이며, 어플라이드 에이아이^{Applied AI}의 창립자이고, 선임 데이터 과학자다. 여러 산업에서 사업 목적을 데이터와 AI 전략으로 전환하고자 하는 포춘 500대 기업과 스타트업 회사들을 자문하고 있으며, 데이터 과학 팀을 구축하고 ML 솔루션을 개발하고 있다. 현재의 사업을 하기 이전에 국제적 투자 회사의 매니징 파트너 겸 선임 데이터 과학자였으며, 예측 분석 도구와 투자 리서치 실무를 구축했다.

또한 15개 시장에서 사업을 하는 국제적 핀테크 스타트업의 임원이었으며, 세계은행^{World Bank}에서 근무했고, 신흥시장의 중앙은행들을 자문한 바 있으며 4개 대륙의 6개 언어로 작업했다. 하버드대학교와 베를린대학교에서 석사학위를 취득했고, 제너럴 어셈블리^{General Assembly}와 데이터캠프^{Datacamp}에서 데이터 과학을 가르치고 있다.

이러한 기회에 팩트^{Packt}출판사와 이 결과를 가능하게 한 팀에 감사한다. 특히 편집 과정을 수월하게 한 스네할 콜테^{Snehal Kotte}에게 감사한다. 응원해 준 많은 사람들에게 감사하며, 계량적 방법을 사용해 문제를 창조적으로 푸는 것에 대한 관심을 고무시켜 준 하버드대학교의 제크하우저^{Zeckhauser} 교수께 특별한 감사를 드린다. 또한 항상 호기심을 고취시키고 지지해 주신 부모님께 큰 빛을 졌다. 하지만 무엇보다도 모든 것이 가치가 있도록 만들어 준 마리아나^{Mariana}에게 감사한다.

| 옮긴이 소개 |

홍창수 (gauss92@naver.com)

경북대학교에서 경영학석사(재무전공)학위를 받고, 한국외국어대학교에서 '장의개별주식 옵션 내재변동성 실증분석'으로 경영학 박사학위를 받았다. 외환선물(주), 리딩투자증권, 한국투자증권, 한화투자증권에서 애널리스트, 옵션딜러, 리스크퀀트, 장외파생상품 마케터로 근무했다. 이후 NICE채권평가가 이름을 바꾼 NICE P&I에서 금융공학연구소 실장으로 근무했고, 현재 AI사업본부 정보사업실장으로 재직하고 있다. 저서로는 서울경제경영에서 출간한 『장의파생상품 실무입문』(서울경제경영, 2014)이 있으며, PLOS ONE^{SCIE}, 증권학회지, 재무관리연구, 금융공학연구에 재무 및 파생상품 관련 논문을 게재했다. 삼성경제연구소^{SERI} 한국금융공학포럼 시삽과 한국금융공학회 산학협력위원으로 활동하고 있다.

이기홍 (keerhee@gmail.com)

카네기멜론대학교에서 석사학위를 받고, 피츠버그대학교 Finance Ph.D, CFA, FRM이며 금융, 투자 및 경제분석 전문가다. 삼성생명, HSBC, 새마을금고 중앙회, 한국투자공사 등의 국내 우수 금융기관, 금융 공기업에서 자산운용 포트폴리오 매니저로 근무했으며, 현재 딥러닝과 강화학습을 금융에 접목시켜 이의 전파와 저변확대를 보람으로 삼고 있다. 저서(공저)로는 『금융공학프로그래밍』(한빛미디어, 2009)이 있으며, 번역서로는 길벗에서 출간한 『딥러닝 부트캠프 with 케라스』(길벗, 2017), 『프로그래머를 위한 기초해석학』(길벗, 2018) 등이 있다. 누구나 자유롭게 머신러닝과 딥러닝을 자신의 연구나 업무에 적용해 활용하는 그날이 오기를 바라며 매진하고 있다.